

# DeAM-Fonds WOP 2

Portfolio-Gesamtbericht  
30. Juni 2023 - 31. Juli 2023



Informationen zu ökologischen und/oder sozialen Merkmalen  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

---

DeAM-Fonds WOP 2 berichtete gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“).

Offenlegung entsprechend Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen (Taxonomie-Verordnung):  
Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Portfolio-Entwicklung  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

**Vermögensentwicklung**

		<b>Berichtsstichtag</b> 31.07.2023	<b>Vergleichsstichtag</b> 30.06.2023	<b>Veranderung</b>
Vermogen	EUR	163.375.759,00	162.345.636,29	1.030.122,71
Anteile	Stuck	1.199.879	1.200.350	-471
Ausgabepreis	EUR/Stuck	136,16	135,25	0,91
Rucknahmepreis	EUR/Stuck	136,16	135,25	0,91

**Wertentwicklung in %**

	<b>BVI</b>	<b>BVI</b> ex. tax	<b>Rol</b> (mit KSt.*)	<b>Rol</b> (ohne KSt.)
Berichtszeitraum (30.06.2023 - 31.07.2023)	0,67	0,67		
Laufendes Geschaftsjahr (31.12.2022 - 31.07.2023)	3,48	3,48		
Geschaftsjahr (Vorjahr) (31.12.2021 - 31.12.2022)	-9,71	-9,71		
Laufendes Kalenderjahr (31.12.2022 - 31.07.2023)	3,48	3,48		
Kalenderjahr (Vorjahr) (31.12.2021 - 31.12.2022)	-9,71	-9,71		

**Mittelflusse 30.06.2023 - 31.07.2023**

Neuanlagen / Wiederanlagen	EUR	152.021,93		
Rucknahmen	EUR	215.506,08		
Ausschuttungen	EUR	0,00	pro Anteil	0,00
Kapitalertragsteuer	EUR	0,00	pro Anteil	0,00
Korperschaftsteuer	EUR	0,00	pro Anteil	0,00

	<b>BVI</b>	<b>BVI</b> ex. tax	<b>Rol</b> (mit KSt.*)	<b>Rol</b> (ohne KSt.)
5 Jahre (31.07.2018 - 31.07.2023)	2,75	2,75		
PerAnnum	0,54	0,54	0,31	0,31
10 Jahre (31.07.2013 - 31.07.2023)	20,10	19,73		
PerAnnum	1,85	1,82	1,72	1,68
Seit Auflegung (29.12.2003 - 31.07.2023)	92,77	90,34		
PerAnnum	3,41	3,34	5,18	5,11

\*) einschlielich Kapitalertragsteuer/Soli

**Anlagestruktur in %**

	<b>31.07.2023</b>	<b>30.06.2023</b>
Aktien gesamt	24,270	23,967
Barvermogen	11,282	11,640
Derivate	-0,013	-0,049
Fonds	5,490	5,468
Renten gesamt	59,006	58,991
Sonstige Vermogenswerte	-0,035	-0,018

Vermögenswerte Portfolio gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Vermögenswerte	Kurswert	% *	Stückzinsen	% *	Marktwert	% *
<b>Gesamt</b>	<b>162.977.205,16</b>	<b>99,76</b>	<b>398.553,85</b>	<b>0,24</b>	<b>163.375.759,01</b>	<b>100,00</b>
<b>Aktien inkl. Aktienfonds</b>	<b>39.650.562,38</b>	<b>24,27</b>			<b>39.650.562,38</b>	<b>24,27</b>
Euroländer	34.902.943,19	21,36			34.902.943,19	21,36
Europa ohne Euroländer	4.747.619,19	2,91			4.747.619,19	2,91
<b>Renten inkl. Rentenfonds</b>	<b>104.976.128,98</b>	<b>64,25</b>	<b>395.305,58</b>	<b>0,24</b>	<b>105.371.434,56</b>	<b>64,50</b>
EUR	93.375.511,62	57,15	375.583,99	0,23	93.751.095,61	57,38
Sonstige Währungen	2.631.085,36	1,61	19.721,59	0,01	2.650.806,95	1,62
Rentenfonds	8.969.532,00	5,49			8.969.532,00	5,49
<b>Derivate</b>	<b>-20.800,00</b>	<b>-0,01</b>			<b>-20.800,00</b>	<b>-0,01</b>
Futures	-20.800,00	-0,01			-20.800,00	-0,01
<b>Barvermögen</b>	<b>18.428.660,83</b>	<b>11,28</b>	<b>3.248,27</b>	<b>0,00</b>	<b>18.431.909,10</b>	<b>11,28</b>
Bankkonten bereits valuiert in EUR	17.913.847,86	10,96	3.018,93	0,00	17.916.866,79	10,97
Bankkonten bereits valuiert in Fremdwährung	514.812,97	0,32	229,34	0,00	515.042,31	0,32
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	<b>-57.347,03</b>	<b>-0,04</b>			<b>-57.347,03</b>	<b>-0,04</b>
Forderungen aus Dividenden / Zinsen	5.269,59	0,00			5.269,59	0,00
Quellensteuerforderungen	8.233,09	0,01			8.233,09	0,01
Verwaltungsvergütung	-70.849,71	-0,04			-70.849,71	-0,04

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Aktien gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Wertpapierbezeichnung ISIN / ID	Branche nach Stoxx Branche nach MSCI	Stuck Ø Dev.kurs	Einstand Kurs	Buchwert lokal Buchwert	Kurswert lokal Kurswert	Wahr.-G/V WP-G/V	Gesamt-G/V	% * % AV
<b>Aktien gesamt</b>						<b>37.205,42</b>	<b>9.907.328,11</b>	<b>24,270</b>
				<b>29.743.234,27</b>	<b>39.650.562,38</b>	<b>9.870.122,69</b>		<b>100,000</b>
<b>Aktien</b>						<b>37.205,42</b>	<b>9.907.328,11</b>	<b>24,270</b>
				<b>29.743.234,27</b>	<b>39.650.562,38</b>	<b>9.870.122,69</b>		<b>100,000</b>
<b>CHF Schweizer Franken</b>	<b>Aktueller Kurs</b>	<b>0,960600</b>		<b>873.698,82</b>	<b>944.776,78</b>	<b>85.474,35</b>	<b>159.467,65</b>	<b>0,602</b>
				<b>824.060,12</b>	<b>983.527,77</b>	<b>73.993,30</b>		<b>2,480</b>
<b>Schweiz</b>								
Cie Financiere Richemont Reg. CH0210483332	Konsumguter & Dienstleistungen Gebrauchsguter & Bekleidung	2.110 0,978945	147,882 140,500	312.031,80 318.743,11	296.455,00 308.614,41	6.087,00 -16.215,70	-10.128,70	0,189 0,778
Holcim CH0012214059	Bauwesen und Materialien Grundstoffe	7.791 1,106065	54,121 60,860	421.655,27 381.221,05	474.160,26 493.608,43	57.728,84 54.658,54	112.387,38	0,302 1,245
Nestle Reg. CH0038863350	Lebensmittel, Getranke & Tabak Lebensmittel, Getranke & Tabak	1.618 1,128254	86,534 107,640	140.011,75 124.095,96	174.161,52 181.304,93	21.658,51 35.550,46	57.208,97	0,111 0,457
<b>DKK Danische Krone</b>	<b>Aktueller Kurs</b>	<b>7,451898</b>		<b>2.836.733,90</b>	<b>3.556.490,00</b>	<b>-582,25</b>	<b>96.004,67</b>	<b>0,292</b>
				<b>381.254,82</b>	<b>477.259,49</b>	<b>96.586,92</b>		<b>1,204</b>
<b>Danemark</b>								
Novo-Nordisk B DK0060534915	Gesundheitswesen Pharmazeutika, Biotechnologie &	3.290 7,440532	862,229 1.081,000	2.836.733,90 381.254,82	3.556.490,00 477.259,49	-582,25 96.586,92	96.004,67	0,292 1,204
<b>EUR Euro</b>	<b>Aktueller Kurs</b>	<b>1,000000</b>		<b>26.832.836,60</b>	<b>36.002.372,13</b>	<b>0,00</b>	<b>9.169.535,53</b>	<b>22,037</b>
				<b>26.832.836,60</b>	<b>36.002.372,13</b>	<b>9.169.535,53</b>		<b>90,799</b>
<b>Deutschland</b>								
Allianz DE0008404005	Versicherungen Versicherungen	6.799 1,000000	160,678 218,100	1.092.446,16 1.092.446,16	1.482.861,90 1.482.861,90	0,00 390.415,74	390.415,74	0,908 3,740
BASF Reg. DE000BASF111	Chemie Grundstoffe	10.100 1,000000	61,305 48,945	619.182,35 619.182,35	494.344,50 494.344,50	0,00 -124.837,85	-124.837,85	0,303 1,247

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Aktien gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Wertpapierbezeichnung ISIN / ID	Branche nach Stoxx Branche nach MSCI	Stuck Ø Dev.kurs	Einstand Kurs	Buchwert lokal Buchwert	Kurswert lokal Kurswert	Wahr.-G/V WP-G/V	Gesamt-G/V	% * % AV
<b>Aktien ...</b>								
<b>EUR ...</b>								
<b>Deutschland ...</b>								
Bayer DE000BAY0017	Gesundheitswesen Pharmazeutika, Biotechnologie &	10.225 1,000000	56,835 53,420	581.138,17 581.138,17	546.219,50 546.219,50	0,00 -34.918,67	-34.918,67	0,334 1,378
Deutsche Post Reg. DE0005552004	Industrieguter und Dienstleistungen Transportwesen	18.827 1,000000	29,087 46,835	547.621,90 547.621,90	881.762,55 881.762,55	0,00 334.140,65	334.140,65	0,540 2,224
Deutsche Telekom Reg. DE0005557508	Telekommunikation Telekommunikationsdienste	61.670 1,000000	11,067 19,890	682.492,19 682.492,19	1.226.616,30 1.226.616,30	0,00 544.124,11	544.124,11	0,751 3,094
Evonik Industries Reg. DE000EVNK013	Chemie Grundstoffe	9.380 1,000000	29,309 18,795	274.919,30 274.919,30	176.297,10 176.297,10	0,00 -98.622,20	-98.622,20	0,108 0,445
Infineon Technologies Reg. DE0006231004	Technologie Halbleiter & Halbleiterausrustung	13.934 1,000000	37,165 39,510	517.860,73 517.860,73	550.532,34 550.532,34	0,00 32.671,61	32.671,61	0,337 1,388
Mercedes-Benz Group DE0007100000	Automobilhersteller und Zulieferer Kraftfahrzeuge & Komponenten	9.784 1,000000	65,109 73,480	637.022,87 637.022,87	718.928,32 718.928,32	0,00 81.905,45	81.905,45	0,440 1,813
PUMA DE0006969603	Konsumguter & Dienstleistungen Gebrauchsguter & Bekleidung	5.292 1,000000	56,758 61,300	300.364,13 300.364,13	324.399,60 324.399,60	0,00 24.035,47	24.035,47	0,199 0,818
SAP DE0007164600	Technologie Software & Dienste	8.678 1,000000	90,161 124,580	782.421,00 782.421,00	1.081.105,24 1.081.105,24	0,00 298.684,24	298.684,24	0,662 2,727
Siemens Energy DE000ENER6Y0	Energie Investitionsguter	14.925 1,000000	19,370 15,425	289.101,33 289.101,33	230.218,13 230.218,13	0,00 -58.883,20	-58.883,20	0,141 0,581
Siemens Reg. DE0007236101	Industrieguter und Dienstleistungen Investitionsguter	7.735 1,000000	104,113 155,240	805.310,20 805.310,20	1.200.781,40 1.200.781,40	0,00 395.471,20	395.471,20	0,735 3,028
Volkswagen Pref. DE0007664039	Automobilhersteller und Zulieferer Kraftfahrzeuge & Komponenten	3.121 1,000000	159,852 121,320	498.897,12 498.897,12	378.639,72 378.639,72	0,00 -120.257,40	-120.257,40	0,232 0,955
<b>Frankreich</b>								
Air Liquide FR0000120073	Chemie Grundstoffe	7.985 1,000000	127,934 163,540	1.021.553,65 1.021.553,65	1.305.866,90 1.305.866,90	0,00 284.313,25	284.313,25	0,799 3,293

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Aktien gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Wertpapierbezeichnung ISIN / ID	Branche nach Stoxx Branche nach MSCI	Stuck Ø Dev.kurs	Einstand Kurs	Buchwert lokal Buchwert	Kurswert lokal Kurswert	Wahr.-G/V WP-G/V	Gesamt-G/V	% * % AV
<b>Aktien ...</b>								
<b>EUR ...</b>								
<b>Frankreich ...</b>								
AXA FR0000120628	Versicherungen Versicherungen	40.044 1,000000	20,439 28,115	818.457,02 818.457,02	1.125.837,06 1.125.837,06	0,00 307.380,04	307.380,04	0,689 2,839
BNP Paribas FR0000131104	Banken Banken	12.819 1,000000	45,092 60,160	578.037,97 578.037,97	771.191,04 771.191,04	0,00 193.153,07	193.153,07	0,472 1,945
Bureau Veritas FR0006174348	Industrieguter und Dienstleistungen Kommerzielle & professionelle	12.490 1,000000	21,532 25,100	268.932,22 268.932,22	313.499,00 313.499,00	0,00 44.566,78	44.566,78	0,192 0,791
Capgemini FR0000125338	Technologie Software & Dienste	2.457 1,000000	114,200 164,600	280.588,13 280.588,13	404.422,20 404.422,20	0,00 123.834,07	123.834,07	0,248 1,020
Compagnie de Saint-Gobain (C.R.) FR0000125007	Bauwesen und Materialien Investitionsguter	7.910 1,000000	38,722 61,470	306.289,97 306.289,97	486.227,70 486.227,70	0,00 179.937,73	179.937,73	0,298 1,226
Credit Agricole FR0000045072	Banken Banken	30.700 1,000000	13,243 11,272	406.572,26 406.572,26	346.050,40 346.050,40	0,00 -60.521,86	-60.521,86	0,212 0,873
EssilorLuxottica FR0000121667	Gesundheitswesen Gesundheitswesen: Ausstattung &	4.170 1,000000	133,124 182,020	555.126,69 555.126,69	759.023,40 759.023,40	0,00 203.896,71	203.896,71	0,465 1,914
Groupe Danone (C.R.) FR0000120644	Lebensmittel, Getranke & Tabak Lebensmittel, Getranke & Tabak	11.760 1,000000	59,877 56,180	704.153,14 704.153,14	660.676,80 660.676,80	0,00 -43.476,34	-43.476,34	0,404 1,666
Kering FR0000121485	Konsumguter & Dienstleistungen Gebrauchsguter & Bekleidung	485 1,000000	470,460 525,300	228.173,11 228.173,11	254.770,50 254.770,50	0,00 26.597,39	26.597,39	0,156 0,643
L'Oreal FR0000120321	Konsumguter & Dienstleistungen Haushaltsartikel &	2.070 1,000000	415,492 425,100	860.068,73 860.068,73	879.957,00 879.957,00	0,00 19.888,27	19.888,27	0,539 2,219
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton FR0000121014	Konsumguter & Dienstleistungen Gebrauchsguter & Bekleidung	3.325 1,000000	298,368 848,400	992.074,19 992.074,19	2.820.930,00 2.820.930,00	0,00 1.828.855,81	1.828.855,81	1,727 7,114
Publicis Groupe FR0000130577	Medien Medien & Unterhaltung	4.179 1,000000	70,648 73,220	295.238,21 295.238,21	305.986,38 305.986,38	0,00 10.748,17	10.748,17	0,187 0,772
Sanofi FR0000120578	Gesundheitswesen Pharmazeutika, Biotechnologie &	17.155 1,000000	82,467 97,300	1.414.725,41 1.414.725,41	1.669.181,50 1.669.181,50	0,00 254.456,09	254.456,09	1,022 4,210

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Aktien gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Wertpapierbezeichnung ISIN / ID	Branche nach Stoxx Branche nach MSCI	Stück Ø Dev.kurs	Einstand Kurs	Buchwert lokal Buchwert	Kurswert lokal Kurswert	Wahr.-G/V WP-G/V	Gesamt-G/V	% * % AV
<b>Aktien ...</b>								
<b>EUR ...</b>								
<b>Frankreich ...</b>								
Schneider Electric FR0000121972	Industriegüter und Dienstleistungen Investitionsgüter	5.955 1,000000	87,627 162,480	521.820,89 521.820,89	967.568,40 967.568,40	0,00 445.747,51	445.747,51	0,592 2,440
TotalEnergies FR0000120271	Energie Energie	28.210 1,000000	43,245 55,200	1.219.952,13 1.219.952,13	1.557.192,00 1.557.192,00	0,00 337.239,87	337.239,87	0,953 3,927
Veolia Environnement FR0000124141	Versorger Versorger	17.451 1,000000	28,416 29,620	495.891,85 495.891,85	516.898,62 516.898,62	0,00 21.006,77	21.006,77	0,316 1,304
VINCI FR0000125486	Bauwesen und Materialien Investitionsgüter	6.626 1,000000	71,364 106,960	472.854,60 472.854,60	708.716,96 708.716,96	0,00 235.862,36	235.862,36	0,434 1,787
<b>Irland</b>								
Linde IE000S9YS762	Chemie Grundstoffe	1.887 1,000000	181,075 352,350	341.687,73 341.687,73	664.884,45 664.884,45	0,00 323.196,72	323.196,72	0,407 1,677
Smurfit Kappa IE00B1RR8406	Industriegüter und Dienstleistungen Grundstoffe	9.588 1,000000	36,711 36,220	351.982,18 351.982,18	347.277,36 347.277,36	0,00 -4.704,82	-4.704,82	0,213 0,876
<b>Italien</b>								
ENEL IT0003128367	Versorger Versorger	105.619 1,000000	7,664 6,288	809.496,63 809.496,63	664.132,27 664.132,27	0,00 -145.364,36	-145.364,36	0,407 1,675
<b>Niederlande</b>								
AEGON NL0000303709	Versicherungen Versicherungen	68.391 1,000000	4,645 4,948	317.647,75 317.647,75	338.398,67 338.398,67	0,00 20.750,92	20.750,92	0,207 0,853
ASML Holding NL0010273215	Technologie Halbleiter & Halbleiterausrustung	4.615 1,000000	222,309 655,000	1.025.956,60 1.025.956,60	3.022.825,00 3.022.825,00	0,00 1.996.868,40	1.996.868,40	1,850 7,624
Heineken NL0000009165	Lebensmittel, Getranke & Tabak Lebensmittel, Getranke & Tabak	2.380 1,000000	94,070 90,640	223.886,15 223.886,15	215.723,20 215.723,20	0,00 -8.162,95	-8.162,95	0,132 0,544

\* bezogen auf Portfolio gesamt



Bestand Aktien gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Wertpapierbezeichnung ISIN / ID	Branche nach Stoxx Branche nach MSCI	Stuck Ø Dev.kurs	Einstand Kurs	Buchwert lokal Buchwert	Kurswert lokal Kurswert	Wahr.-G/V WP-G/V	Gesamt-G/V	% * % AV
<b>Aktien ...</b>								
<b>EUR ...</b>								
<b>Niederlande ...</b>								
ING Groep NL0011821202	Banken	95.600	9,130	872.844,08	1.268.420,80	0,00	395.576,72	0,776
	Banken	1,000000	13,268	872.844,08	1.268.420,80	395.576,72		3,199
Koninklijke Ahold Delhaize NL0011794037	Korperpflege, Drogerie und Basiskonsumguter: Vertrieb &	11.005	28,384	312.367,96	348.308,25	0,00	35.940,29	0,213
		1,000000	31,650	312.367,96	348.308,25	35.940,29		0,878
Stellantis NL00150001Q9	Automobilhersteller und Zulieferer Kraftfahrzeuge & Komponenten	44.950	15,153	681.139,38	847.667,10	0,00	166.527,72	0,519
		1,000000	18,858	681.139,38	847.667,10	166.527,72		2,138
<b>Schweiz</b>								
STMicroelectronics NL0000226223	Technologie Halbleiter & Halbleiterausrustung	9.610	24,146	232.041,69	467.718,70	0,00	235.677,01	0,286
		1,000000	48,670	232.041,69	467.718,70	235.677,01		1,180
<b>Spanien</b>								
Banco Santander Reg. ES0113900J37	Banken	218.966	4,240	928.483,82	807.656,09	0,00	-120.827,73	0,494
	Banken	1,000000	3,689	928.483,82	807.656,09	-120.827,73		2,037
Bankinter ES0113679I37	Banken	59.385	5,443	323.259,24	350.609,04	0,00	27.349,80	0,215
	Banken	1,000000	5,904	323.259,24	350.609,04	27.349,80		0,884
Cellnex Telecom ES0105066007	Telekommunikation Telekommunikationsdienste	6.200	36,194	224.400,01	232.314,00	0,00	7.913,99	0,142
		1,000000	37,470	224.400,01	232.314,00	7.913,99		0,586
Iberdrola (new) ES0144580Y14	Versorger	38.337	9,309	356.860,51	438.575,28	0,00	81.714,77	0,268
	Versorger	1,000000	11,440	356.860,51	438.575,28	81.714,77		1,106
Iberdrola Right ES06445809Q1	Utilities	38.337	0,255	9.789,56	11.742,62	0,00	1.953,06	0,007
	Versorger	1,000000	0,306	9.789,56	11.742,62	1.953,06		0,030
Solaria Energia Y Medio Ambiente ES0165386014	Versorger	13.923	23,049	320.905,41	197.706,60	0,00	-123.198,81	0,121
	Versorger	1,000000	14,200	320.905,41	197.706,60	-123.198,81		0,499

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Aktien gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Wertpapierbezeichnung ISIN / ID	Branche nach Stoxx Branche nach MSCI	Stück Ø Dev.kurs	Einstand Kurs	Buchwert lokal Buchwert	Kurswert lokal Kurswert	Wahr.-G/V WP-G/V	Gesamt-G/V	% * % AV
<b>Aktien ...</b>								
<b>EUR ...</b>								
<b>Vereinigtes Konigreich</b>								
Unilever GB00B10RZP78	Korperpflege, Drogerie und Haushaltsartikel &	12.824 1,000000	33,593 49,260	430.800,28 430.800,28	631.710,24 631.710,24	0,00 200.909,96	200.909,96	0,387 1,593
<b>GBP Pfund Sterling</b>	<b>Aktueller Kurs</b>	<b>0,858700</b>		<b>1.126.805,91</b> <b>1.312.145,41</b>	<b>1.518.318,58</b> <b>1.768.159,52</b>	<b>77,61</b> <b>455.936,50</b>	<b>456.014,11</b>	<b>1,082</b> <b>4,459</b>
<b>Vereinigtes Konigreich</b>								
Compass Group GB00BD6K4575	Konsumguter & Dienstleistungen Verbraucherdienste	18.332 0,893445	11,983 20,120	219.664,81 245.862,70	368.839,84 429.532,83	9.948,19 173.721,94	183.670,13	0,263 1,083
HSBC Holdings GB0005405286	Banken Banken	71.865 0,861488	4,437 6,487	318.862,15 370.129,32	466.188,26 542.900,03	1.201,93 171.568,78	172.770,71	0,332 1,369
Shell GB00BP6MXD84	Energie Energie	18.145 0,832550	18,692 23,405	339.162,56 407.378,10	424.683,73 494.565,89	-12.405,98 99.593,77	87.187,79	0,303 1,247
Tate & Lyle GB00BP92CJ43	Lebensmittel, Getranke & Tabak Lebensmittel, Getranke & Tabak	34.550 0,862665	7,210 7,485	249.116,39 288.775,29	258.606,75 301.160,77	1.333,47 11.052,01	12.385,48	0,184 0,760
<b>SEK Schwedische Krone</b>	<b>Aktueller Kurs</b>	<b>11,593531</b>		<b>4.001.780,76</b> <b>392.937,32</b>	<b>4.860.520,10</b> <b>419.243,47</b>	<b>-47.764,29</b> <b>74.070,44</b>	<b>26.306,15</b>	<b>0,257</b> <b>1,057</b>
<b>Schweden</b>								
Swedbank SE0000242455	Banken Banken	25.171 10,184233	158,984 193,100	4.001.780,76 392.937,32	4.860.520,10 419.243,47	-47.764,29 74.070,44	26.306,15	0,257 1,057

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Gesamt</b>										
						106.540.812,10	96.006.596,98	395.305,58	96.401.902,56	59,006
					52.963,65	-10.551.250,60	-10.498.286,95			100,000
<b>Renten</b>										
						106.540.812,10	96.006.596,98	395.305,58	96.401.902,56	59,006
					52.963,65	-10.551.250,60	-10.498.286,95			100,000
<b>EUR</b>	<b>Aktueller Kurs 1,0000</b>			<b>104.997.123</b>		<b>103.976.854,64</b>	<b>93.375.511,62</b>	<b>375.583,99</b>	<b>93.751.095,61</b>	<b>57,384</b>
						<b>103.976.854,64</b>	<b>93.375.511,62</b>	<b>375.583,99</b>	<b>93.751.095,61</b>	<b>97,250</b>
					<b>0,00</b>	<b>-10.565.820,50</b>	<b>-10.565.820,50</b>			
1,125 XS1565699763 IE	Ryanair 17/15.08.23 MTN Industrie Industrie	15.08.2023 0,04 0,04	4,51 0,04 0,04	1.374.000 100,070 99,859	1,0000  0,00	1.374.965,62 1.374.965,62 3.729,31	1.372.062,66 1.372.062,66 3.729,31	14.864,61 14.864,61 BBB+	1.386.927,27 1.386.927,27	0,849 1,439
1,125 XS1586555861 DE	Volkswagen Int. Finance 17/02.1 Industrie Industrie	02.10.2023 0,17 0,17	3,77 0,17 0,17	1.000.000 100,132 99,540	1,0000  0,00	1.001.318,56 1.001.318,56 583,04	995.400,00 995.400,00 583,04	9.339,04 9.339,04 A-	1.004.739,04 1.004.739,04	0,615 1,042
1,750 AT0000A105W3 AT	Austria 13/20.10.23 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	20.10.2023 0,22 0,22	3,46 0,22 0,22	2.200.000 101,465 99,614	1,0000  0,00	2.232.220,10 2.232.220,10 -38.732,53	2.191.508,00 2.191.508,00 -38.732,53	30.061,64 30.061,64 AA+	2.221.569,64 2.221.569,64	1,360 2,304
1,875 XS1531174388 GB	Barclays 16/08.12.23 MTN Finanzinstitute Finanzen	08.12.2023 0,36 0,36	3,79 0,36 0,35	1.155.000 103,483 99,310	1,0000  0,00	1.195.231,54 1.195.231,54 -45.494,11	1.147.030,50 1.147.030,50 -45.494,11	14.002,40 14.002,40 BBB+	1.161.032,90 1.161.032,90	0,711 1,204
0,000 IT0005454050 IT	Buoni Poliennali Del Tes 21/30.0 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	30.01.2024 0,50 0,50	3,73 0,50 0,49	2.600.000 96,820 98,163	1,0000  0,00	2.517.320,00 2.517.320,00 30.528,93	2.552.238,00 2.552.238,00 30.528,93	0,00 0,00 BBB-	2.552.238,00 2.552.238,00	1,562 2,647

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
1,000 XS1956025651 ES	Santander Consumer Finance 19 Finanzinstitute Finanzen	27.02.2024 0,58 0,58	3,94 0,58 0,56	600.000 100,130 98,328	1,0000  0,00	600.781,71 600.781,71 -8.590,44	589.968,00 589.968,00 -8.590,44	2.547,95 2.547,95 A	592.515,95 592.515,95	0,363 0,615
0,000 FR0013344751 FR	France 18/25.03.24 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	25.03.2024 0,65 0,65	3,51 0,65 0,64	1.700.000 100,386 97,783	1,0000  0,00	1.706.560,96 1.706.560,96 -42.465,45	1.662.311,00 1.662.311,00 -42.465,45	0,00 0,00 AA	1.662.311,00 1.662.311,00	1,017 1,724
1,750 XS1586337872 US	Liberty Mutual Fin. Europe 17/27. Finanzinstitute Finanzen	27.03.2024 0,66 0,66	4,80 0,66 0,64	270.000 101,399 98,040	1,0000  0,00	273.778,03 273.778,03 -8.780,59	264.708,00 264.708,00 -8.780,59	1.639,55 1.639,55 BBB	266.347,55 266.347,55	0,163 0,276
1,250 XS2003442436 IE	AIB Group 19/28.05.24 MTN Finanzinstitute Finanzen	28.05.2024 0,83 0,83	4,04 0,83 0,81	850.000 100,179 97,763	1,0000  0,00	851.518,10 851.518,10 -16.759,93	830.985,50 830.985,50 -16.759,93	1.886,95 1.886,95 BBB	832.872,45 832.872,45	0,510 0,864
0,625 XS2015267953 FR	Banque Stellantis France 19/21.0 Industrie Industrie	21.06.2024 0,89 0,89	4,14 0,89 0,87	510.000 99,864 96,989	1,0000  0,00	509.305,23 509.305,23 -12.407,30	494.643,90 494.643,90 -12.407,30	357,07 357,07 BBB+	495.000,97 495.000,97	0,303 0,513
1,125 FR0013396512 FR	Orange 19/15.07.24 MTN Industrie Industrie	15.07.2024 0,96 0,96	3,94 0,96 0,94	600.000 100,613 97,406	1,0000  0,00	603.679,89 603.679,89 -19.076,26	584.436,00 584.436,00 -19.076,26	313,52 313,52 BBB+	584.749,52 584.749,52	0,358 0,607
0,200 XS1881014374 XB	European Investment Bank 18/15 Supranationale Nicht klassifiziert	15.07.2024 0,96 0,96	3,57 0,96 0,94	1.404.000 101,146 96,886	1,0000  0,00	1.420.087,98 1.420.087,98 -56.972,32	1.360.279,44 1.360.279,44 -56.972,32	130,43 130,43 AAA	1.360.409,87 1.360.409,87	0,833 1,411

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
1,750 FR0011962398 FR	France O.A.T. 13/25.11.24 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	25.11.2024 1,32 1,32	3,39 1,30 1,28	1.310.000 106,960 97,910	1,0000  0,00	1.401.181,68 1.401.181,68 -106.558,72	1.282.621,00 1.282.621,00 -106.558,72	15.639,25 15.639,25 AA	1.298.260,25 1.298.260,25	0,795 1,347
1,500 CH0341440334 CH	UBS Group 16/30.11.24 Finanzinstitute Finanzen	30.11.2024 1,33 1,33	2,97 1,32 1,31	910.000 100,666 98,095	1,0000  0,00	916.060,93 916.060,93 -22.064,47	892.664,50 892.664,50 -22.064,47	9.124,93 9.124,93 A-	901.789,43 901.789,43	0,552 0,935
0,625 DE000A11QTD2 DE	KfW 15/15.01.25 Agencies Sonstige offentliche Schuldner	15.01.2025 1,46 1,46	3,43 1,45 1,43	880.000 102,233 96,062	1,0000  0,00	899.652,79 899.652,79 -52.829,59	845.345,60 845.345,60 -52.829,59	2.983,56 2.983,56 AAA	848.329,16 848.329,16	0,519 0,880
0,125 XS2058556296 US	Thermo Fisher Scientific 19/01.0 Industrie Industrie	01.03.2025 1,58 1,58	3,89 1,58 1,55	545.000 99,416 94,321	1,0000  0,00	541.815,01 541.815,01 -24.526,90	514.049,45 514.049,45 -24.526,90	284,78 284,78 A-	514.334,23 514.334,23	0,315 0,534
0,000 DE000A1RQDR4 DE	Hessen 20/10.03.25 S.2001 LSA Sonstige offentliche Schuldner Sonstige offentliche Schuldner	10.03.2025 1,61 1,61	3,50 1,61 1,58	1.844.000 100,130 94,621	1,0000  0,00	1.846.396,34 1.846.396,34 -127.591,77	1.744.802,02 1.744.802,02 -127.591,77	0,00 0,00 AA+	1.744.802,02 1.744.802,02	1,068 1,810
1,125 XS1974922442 NO	Norsk Hydro 19/11.04.25 Industrie Industrie	11.04.2025 1,70 1,70	4,32 1,69 1,64	1.213.000 101,750 94,869	1,0000  0,00	1.234.226,88 1.234.226,88 -78.048,43	1.150.760,97 1.150.760,97 -78.048,43	4.175,90 4.175,90 BBB-	1.154.936,87 1.154.936,87	0,707 1,198
1,750 XS1810775145 ID	Indonesia 18/24.04.25 Staatsanleihen (in Sonstige offentliche Schuldner	24.04.2025 1,73 1,73	4,23 1,71 1,67	1.101.000 100,879 95,937	1,0000  0,00	1.110.676,40 1.110.676,40 -52.928,25	1.056.266,37 1.056.266,37 -52.928,25	5.211,70 5.211,70 BBB	1.061.478,07 1.061.478,07	0,650 1,101

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
1,600 ES00000126Z1 ES	Spain 15/30.04.25 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	30.04.2025 1,75 1,75	3,42 1,73 1,70	1.950.000 102,931 96,961	1,0000  0,00	2.007.152,26 2.007.152,26 -111.436,92	1.890.739,50 1.890.739,50 -111.436,92	7.927,87 7.927,87 BBB+	1.898.667,37 1.898.667,37	1,162 1,970
0,500 FR0012517027 FR	France O.A.T. 15/25.05.25 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	25.05.2025 1,82 1,82	3,27 1,81 1,78	3.786.000 99,829 95,188	1,0000  0,00	3.779.521,82 3.779.521,82 -156.186,64	3.603.817,68 3.603.817,68 -156.186,64	3.517,05 3.517,05 AA	3.607.334,73 3.607.334,73	2,208 3,742
0,800 BE00000334434 BE	Belgium 14/22.06.25 S.74 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	22.06.2025 1,89 1,89	3,24 1,89 1,86	2.100.000 101,827 95,580	1,0000  0,00	2.138.360,91 2.138.360,91 -122.889,49	2.007.180,00 2.007.180,00 -122.889,49	1.836,07 1.836,07 AA-	2.009.016,07 2.009.016,07	1,230 2,084
1,250 XS2199343513 NL	ISS Finance 20/07.07.25 MTN Industrie Industrie	07.07.2025 1,93 1,93	4,29 1,92 1,87	520.000 100,063 94,460	1,0000  0,00	520.327,43 520.327,43 -27.952,90	491.192,00 491.192,00 -27.952,90	443,99 443,99 BBB-	491.635,99 491.635,99	0,301 0,510
0,625 XS2023872174 LU	Aroundtown 19/09.07.25 MTN Finanzinstitute Industrie	09.07.2025 1,94 1,94	7,44 1,93 1,83	900.000 98,738 88,096	1,0000  0,00	888.637,91 888.637,91 -84.634,31	792.864,00 792.864,00 -84.634,31	353,48 353,48 BBB+	793.217,48 793.217,48	0,486 0,823
1,207 XS2430287529 ZA	Prosus 22/19.01.26 Reg S Industrie Industrie	19.01.2026 2,47 2,47	4,73 2,43 2,36	420.000 100,000 91,950	1,0000  0,00	420.000,00 420.000,00 -33.810,00	386.190,00 386.190,00 -33.810,00	2.694,42 2.694,42 BBB-	388.884,42 388.884,42	0,238 0,403
0,125 FR0013486701 FR	Societe Generale 20/24.02.26 M Finanzinstitute Finanzen	24.02.2026 2,57 2,57	4,16 2,57 2,50	1.400.000 99,989 90,352	1,0000  0,00	1.399.849,38 1.399.849,38 -132.867,00	1.264.928,00 1.264.928,00 -132.867,00	757,53 757,53 A	1.265.685,53 1.265.685,53	0,775 1,313

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
0,500 FI4000197959 FI	Finland 16/15.04.26 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.04.2026 2,71 2,71	3,04 2,69 2,65	1.150.000 101,079 93,502	1,0000  0,00	1.162.411,63 1.162.411,63 -85.482,83	1.075.273,00 1.075.273,00 -85.482,83	1.696,72 1.696,72 AA+	1.076.969,72 1.076.969,72	0,659 1,117
2,125 XS1138360166 US	Walgreens Boots Alliance 14/20. Industrie Industrie	20.11.2026 3,31 3,31	4,43 3,18 3,09	1.050.000 107,321 93,028	1,0000  0,00	1.126.866,82 1.126.866,82 -149.404,27	976.794,00 976.794,00 -149.404,27	15.527,05 15.527,05 BBB-	992.321,05 992.321,05	0,607 1,029
0,600 XS2102283061 NL	ABN AMRO Bank 20/15.01.27 M Finanzinstitute Finanzen	15.01.2027 3,46 3,46	4,15 3,42 3,34	900.000 100,440 88,780	1,0000  0,00	903.960,82 903.960,82 -104.052,41	799.020,00 799.020,00 -104.052,41	2.929,32 2.929,32 BBB+	801.949,32 801.949,32	0,491 0,832
0,375 DE000A3E5MG8 DE	Vonovia 21/16.09.27 MTN Finanzinstitute Industrie	16.06.2027 3,88 3,88	4,69 3,85 3,74	800.000 99,947 85,010	1,0000  0,00	799.576,00 799.576,00 -119.346,00	680.080,00 680.080,00 -119.346,00	377,05 377,05 BBB+	680.457,05 680.457,05	0,416 0,706
1,625 XS2027364327 LU	Logicor Financing 19/15.07.27 M Agencies Industrie	15.07.2027 3,96 3,96	5,79 3,85 3,70	1.220.000 106,991 85,642	1,0000  0,00	1.305.290,20 1.305.290,20 -259.650,77	1.044.832,40 1.044.832,40 -259.650,77	920,83 920,83 BBB	1.045.753,23 1.045.753,23	0,640 1,085
1,450 ES0000012A89 ES	Spain 17/31.10.27 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	31.10.2027 4,25 4,25	3,23 4,10 4,04	2.450.000 102,266 93,026	1,0000  0,00	2.505.505,14 2.505.505,14 -217.548,38	2.279.137,00 2.279.137,00 -217.548,38	26.668,08 26.668,08 BBB+	2.305.805,08 2.305.805,08	1,411 2,392
1,625 FR0013298676 FR	Holding d'Infrastructures Transp. Industrie Industrie	27.11.2027 4,33 4,33	4,16 4,16 4,06	1.500.000 95,898 90,147	1,0000  0,00	1.438.472,17 1.438.472,17 -77.404,36	1.352.205,00 1.352.205,00 -77.404,36	16.494,86 16.494,86 BBB-	1.368.699,86 1.368.699,86	0,838 1,420

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
0,250 XS2292954893 US	Goldman Sachs Group 21/26.01. Finanzinstitute Finanzen	26.01.2028 4,49 4,49	4,13 4,46 4,35	1.260.000 99,420 84,379	1,0000  0,00	1.252.692,00 1.252.692,00 -186.901,60	1.063.175,40 1.063.175,40 -186.901,60	1.613,84 1.613,84 A	1.064.789,24 1.064.789,24	0,652 1,105
1,500 XS1755428502 ES	Naturgy Finance 18/29.01.28 MT Versorger Versorger	29.01.2028 4,50 4,50	3,62 4,34 4,26	1.100.000 100,614 91,345	1,0000  0,00	1.106.754,00 1.106.754,00 -101.608,55	1.004.795,00 1.004.795,00 -101.608,55	8.317,81 8.317,81 BBB	1.013.112,81 1.013.112,81	0,620 1,051
0,750 AT0000A1ZGE4 AT	Austria 18/20.02.28 MTN Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	20.02.2028 4,56 4,56	2,98 4,48 4,42	1.700.000 101,323 90,630	1,0000  0,00	1.722.482,40 1.722.482,40 -178.830,74	1.540.710,00 1.540.710,00 -178.830,74	5.658,90 5.658,90 AA+	1.546.368,90 1.546.368,90	0,947 1,604
0,500 XS2058556536 US	Thermo Fisher Scientific 19/01.0 Industrie Industrie	01.03.2028 4,58 4,58	3,61 4,53 4,44	1.250.000 98,890 87,056	1,0000  0,00	1.236.122,29 1.236.122,29 -143.022,02	1.088.200,00 1.088.200,00 -143.022,02	2.612,70 2.612,70 A-	1.090.812,70 1.090.812,70	0,668 1,132
0,500 XS2126161764 GB	RELX Finance 20/10.03.28 Industrie Industrie	10.03.2028 4,61 4,61	3,55 4,56 4,47	340.000 99,967 87,220	1,0000  0,00	339.887,26 339.887,26 -42.298,90	296.548,00 296.548,00 -42.298,90	668,85 668,85 BBB+	297.216,85 297.216,85	0,182 0,308
0,900 IE00BDHDPR44 IE	Ireland 18/15.05.28 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.05.2028 4,79 4,79	2,84 4,70 4,64	5.400.000 101,428 91,405	1,0000  0,00	5.477.135,03 5.477.135,03 -530.092,28	4.935.870,00 4.935.870,00 -530.092,28	10.357,38 10.357,38 AA-	4.946.227,38 4.946.227,38	3,028 5,131
1,332 XS2054210252 DE	Wintershall Dea Finance 19/25.0 Industrie Industrie	25.09.2028 5,15 5,15	4,84 4,94 4,78	1.400.000 104,680 84,335	1,0000  0,00	1.465.520,00 1.465.520,00 -284.830,00	1.180.690,00 1.180.690,00 -284.830,00	15.838,03 15.838,03 BBB	1.196.528,03 1.196.528,03	0,732 1,241

\* bezogen auf Portfolio gesamt



Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einsatz Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
2,125 PTOTEV0E0018 PT	Portugal 18/17.10.28 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	17.10.2028 5,21 5,21	2,97 4,90 4,84	3.000.000 104,491 95,951	1,0000  0,00	3.134.717,29 3.134.717,29 -254.751,85	2.878.530,00 2.878.530,00 -254.751,85	50.301,37 50.301,37 BBB	2.928.831,37 2.928.831,37	1,793 3,038
0,625 AT000B049754 AT	UniCredit Bank Austria19/20.03.2 Covered / Pfandbriefe Covered / Pfandbriefe	20.03.2029 5,64 5,64	3,42 5,53 5,43	700.000 100,313 85,874	1,0000  0,00	702.188,50 702.188,50 -98.172,79	601.118,00 601.118,00 -98.172,79	1.601,78 1.601,78 AAA	602.719,78 602.719,78	0,369 0,625
1,100 IE00BH3SQ895 IE	Ireland 19/15.05.29 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.05.2029 5,79 5,79	2,84 5,62 5,55	3.500.000 104,830 90,806	1,0000  0,00	3.669.052,67 3.669.052,67 -487.785,31	3.178.210,00 3.178.210,00 -487.785,31	8.204,92 8.204,92 AA-	3.186.414,92 3.186.414,92	1,950 3,305
0,000 DE0001102473 DE	Germany 19/15.08.29 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.08.2029 6,04 6,04	2,48 6,04 5,98	5.900.000 101,644 86,261	1,0000  0,00	5.996.995,69 5.996.995,69 -954.359,03	5.089.399,00 5.089.399,00 -954.359,03	0,00 0,00 AAA	5.089.399,00 5.089.399,00	3,115 5,279
0,750 XS2384269366 SE	Heimstaden Bostad Treasury 21/ Finanzinstitute Industrie	06.09.2029 6,10 6,10	8,42 5,89 5,52	1.400.000 98,891 64,512	1,0000  0,00	1.384.476,09 1.384.476,09 -477.875,49	903.168,00 903.168,00 -477.875,49	9.464,38 9.464,38 BBB	912.632,38 912.632,38	0,559 0,947
0,600 ES0000012F43 ES	Spain 19/31.10.29 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	31.10.2029 6,25 6,25	3,26 6,11 6,01	2.200.000 105,460 85,188	1,0000  0,00	2.320.118,68 2.320.118,68 -444.300,27	1.874.136,00 1.874.136,00 -444.300,27	9.909,04 9.909,04 BBB+	1.884.045,04 1.884.045,04	1,153 1,954
0,625 XS2133071774 DK	Carlsberg Breweries 20/09.03.30 Industrie Industrie	09.03.2030 6,61 6,61	3,87 6,46 6,32	360.000 100,187 81,409	1,0000  0,00	360.674,77 360.674,77 -66.966,15	293.072,40 293.072,40 -66.966,15	891,39 891,39 BBB	293.963,79 293.963,79	0,180 0,305

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
0,375 DE000A11QTF7 DE	KfW 15/23.04.30 MTN Agencies Sonstige offentliche Schuldner	23.04.2030 6,73 6,73	3,02 6,64 6,55	2.125.000 103,174 84,124	1,0000  0,00	2.192.446,94 2.192.446,94 -403.314,26	1.787.635,00 1.787.635,00 -403.314,26	2.177,25 2.177,25 AAA	1.789.812,25 1.789.812,25	1,096 1,857
0,000 DE0001102507 DE	Deutschland, Bundesrepublik 20/ Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.08.2030 7,04 7,04	2,44 7,04 6,98	4.700.000 95,470 84,380	1,0000  0,00	4.487.090,00 4.487.090,00 -545.087,61	3.965.860,00 3.965.860,00 -545.087,61	0,00 0,00 AAA	3.965.860,00 3.965.860,00	2,427 4,114
1,000 XS1394791492 NL	ABN AMRO Bank 16/13.04.31 M Covered / Pfandbriefe Covered / Pfandbriefe	13.04.2031 7,70 7,70	3,26 7,40 7,28	1.300.000 101,208 84,794	1,0000  0,00	1.315.698,80 1.315.698,80 -207.090,42	1.102.322,00 1.102.322,00 -207.090,42	3.907,10 3.907,10 AAA	1.106.229,10 1.106.229,10	0,677 1,148
0,000 EU000A3KSXE1 XB	European Union 21/04.07.31 MT Supranationale Sonstige offentliche Schuldner	04.07.2031 7,93 7,93	3,06 7,93 7,81	1.150.000 99,169 78,756	1,0000  0,00	1.140.441,03 1.140.441,03 -232.687,38	905.694,00 905.694,00 -232.687,38	0,00 0,00 AAA	905.694,00 905.694,00	0,554 0,939
0,000 DE0001102564 DE	Germany 21/15.08.31 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.08.2031 8,04 8,04	2,43 8,04 7,97	4.750.000 94,464 82,414	1,0000  0,00	4.487.040,00 4.487.040,00 -584.671,57	3.914.665,00 3.914.665,00 -584.671,57	0,00 0,00 AAA	3.914.665,00 3.914.665,00	2,396 4,061
0,000 DE0001102580 DE	Bundesrepub. Deutschland 22/15 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.02.2032 8,55 8,55	2,44 8,55 8,47	4.275.123 94,218 81,405	1,0000  0,00	4.027.917,65 4.027.917,65 -553.069,25	3.480.163,88 3.480.163,88 -553.069,25	0,00 0,00 AAA	3.480.163,88 3.480.163,88	2,130 3,610
1,650 PTOTEOE0031 PT	Obrigacoes Do Tesouro 22/16.07 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	16.07.2032 8,96 8,96	3,22 8,35 8,22	2.900.000 86,928 87,947	1,0000  0,00	2.520.912,00 2.520.912,00 29.605,56	2.550.463,00 2.550.463,00 29.605,56	2.091,80 2.091,80 BBB	2.552.554,80 2.552.554,80	1,562 2,648

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon % ISIN / ID Risikoland	Wertpapierbezeichnung Branche nach Barclays Branche nach Merrill Lynch	Falligkeit WAL RLZ	Rendite Duration Mod. Dur.	Nominal Einstand Kurs	Ø Dev.kurs Wahr.-G/V	Buchwert lokal Buchwert WP-G/V	Kurswert lokal Kurswert Gesamt-G/V	Stuckzinsen lokal Stuckzinsen Mittel-Rating	Wert lokal Wert Rating intern	% * % RV
<b>Renten ...</b>										
0,350 IE00BMD03L28 IE	Ireland 22/18.10.32 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	18.10.2032 9,22 9,22	2,91 9,03 8,91	2.200.000 87,167 79,589	1,0000  0,00	1.917.674,00 1.917.674,00 -165.896,57	1.750.958,00 1.750.958,00 -165.896,57	6.054,52 6.054,52 AA-	1.757.012,52 1.757.012,52	1,075 1,823
2,550 ES0000012K61 ES	Spain 22/31.10.2032 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	31.10.2032 9,25 9,25	3,43 8,15 8,01	1.600.000 91,925 93,084	1,0000  0,00	1.470.800,00 1.470.800,00 18.557,98	1.489.344,00 1.489.344,00 18.557,98	30.627,95 30.627,95 BBB+	1.519.971,95 1.519.971,95	0,930 1,577
1,250 FR0013313582 FR	France O.A.T. 17/25.05.34 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	25.05.2034 10,82 10,82	3,12 10,08 9,93	3.030.000 82,894 83,074	1,0000  0,00	2.511.694,25 2.511.694,25 6.307,53	2.517.142,20 2.517.142,20 6.307,53	7.036,89 7.036,89 AA	2.524.179,09 2.524.179,09	1,545 2,618
0,000 DE0001102515 DE	Germany 20/15.05.35 Staatsanleihen (in Staaten (in Landeswahrung)	15.05.2035 11,79 11,79	2,55 11,79 11,67	3.430.000 95,691 74,287	1,0000  0,00	3.282.185,07 3.282.185,07 -754.507,28	2.548.044,10 2.548.044,10 -754.507,28	0,00 0,00 AAA	2.548.044,10 2.548.044,10	1,560 2,643
0,400 EU000A3K4C42 XB	European Union 21/04.02.37 S.N Supranationale Sonstige offentliche Schuldner	04.02.2037 13,52 13,52	3,23 13,06 12,85	1.815.000 100,354 69,381	1,0000  0,00	1.821.427,99 1.821.427,99 -560.520,19	1.259.265,15 1.259.265,15 -560.520,19	3.540,49 3.540,49 AAA	1.262.805,64 1.262.805,64	0,773 1,310
<b>GBP</b>	<b>Aktueller Kurs 0,8587</b>			<b>2.300.000</b>		<b>2.247.150,16</b> <b>2.563.957,46</b> <b>52.963,65</b>	<b>2.259.313,00</b> <b>2.631.085,36</b> <b>67.533,55</b>	<b>16.934,93</b> <b>19.721,59</b>	<b>2.276.247,93</b> <b>2.650.806,95</b>	<b>1,623</b> <b>2,750</b>
1,250 XS1850250710 DE	KfW 18/29.12.23 MTN Agencies Sonstige offentliche Schuldner	29.12.2023 0,41 0,41	5,58 0,41 0,40	2.300.000 97,702 98,231	0,8764  52.963,65	2.247.150,16 2.563.957,46 14.569,90	2.259.313,00 2.631.085,36 67.533,55	16.934,93 19.721,59 AAA	2.276.247,93 2.650.806,95	1,623 2,750

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Renten gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Kupon %	Wertpapierbezeichnung	Fälligkeit	Rendite	Nominal	Ø Dev.kurs	Buchwert lokal	Kurswert lokal	Stückzinsen lokal	Wert lokal	% *
ISIN / ID	Branche nach Barclays	WAL	Duration	Einstand		Buchwert	Kurswert	Stückzinsen	Wert	% RV
Risikoland	Branche nach Merrill Lynch	RLZ	Mod. Dur.	Kurs	Währ.-G/V	WP-G/V	Gesamt-G/V	Mittel-Rating	Rating intern	

Renten ...

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Kennzahlen Renten  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswahrung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

	Buchwert	Kurswert	Stuckzinsen	Marktwert	Restlaufzeit (Jahre)	Kupon (%)	Lfd. Rendite (%)	Rendite (%)	Duration (Jahre)	Mod. Dur.	Mod. Dur. sensitivity	% *
<b>Renten</b>												
<b>Gesamt</b>	<b>106.540.812,10</b>	<b>96.006.596,98</b>	<b>395.305,58</b>	<b>96.401.902,56</b>	<b>4,727</b>	<b>0,775</b>	<b>0,873</b>	<b>3,431</b>	<b>4,617</b>	<b>4,478</b>	<b>4,547</b>	<b>100,000</b>
Bis 1 Jahr	16.850.725,18	16.676.656,36	94.864,75	16.771.521,11	0,483	0,912	0,929	4,083	0,483	0,470	0,472	17,398
1 - 2 Jahre	17.284.010,36	16.272.303,09	51.498,58	16.323.801,67	1,700	0,907	0,952	3,699	1,690	1,630	1,657	16,933
2 - 3 Jahre	2.982.261,01	2.726.391,00	5.148,67	2.731.539,67	2,610	0,423	0,462	3,798	2,597	2,502	2,541	2,833
3 - 4 Jahre	4.135.693,84	3.500.726,40	19.754,25	3.520.480,65	3,645	1,273	1,447	4,821	3,564	3,399	3,451	3,652
4 - 5 Jahre	15.079.050,29	13.560.640,40	72.392,42	13.633.032,82	4,561	0,992	1,099	3,292	4,457	4,315	4,383	14,142
5 - 6 Jahre	8.971.478,46	7.838.548,00	75.946,10	7.914.494,10	5,469	1,457	1,601	3,238	5,244	5,080	5,160	8,210
6 - 7 Jahre	12.254.712,17	9.947.410,40	22.442,06	9.969.852,46	6,227	0,283	0,342	3,306	6,161	5,966	6,058	10,342
7 - 8 Jahre	6.943.229,83	5.973.876,00	3.907,10	5.977.783,10	7,298	0,182	0,218	2,687	7,242	7,051	7,158	6,201
8 - 9 Jahre	11.035.869,65	9.945.291,88	2.091,80	9.947.383,68	8,453	0,401	0,481	2,637	8,297	8,084	8,207	10,319
9 - 10 Jahre	3.388.474,00	3.240.302,00	36.682,47	3.276.984,47	9,233	1,276	1,506	3,151	8,626	8,364	8,497	3,399
10 - 11 Jahre	2.511.694,25	2.517.142,20	7.036,89	2.524.179,09	10,817	1,250	1,505	3,117	10,081	9,776	9,929	2,618
11 - 12 Jahre	3.282.185,07	2.548.044,10	0,00	2.548.044,10	11,790	0,000	0,000	2,553	11,790	11,496	11,668	2,643
13 - 14 Jahre	1.821.427,99	1.259.265,15	3.540,49	1.262.805,64	13,515	0,400	0,577	3,232	13,060	12,651	12,846	1,310

\* bezogen auf Renten

Bestand Fonds  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

ISIN / ID	Wertpapierbezeichnung	Stück	Ø Dev.kurs	Einstand	Kurs	Kurswert	% *	Unreal. Ergebnis Zwischengewinn <sup>1</sup>
<b>Gesamt</b>						<b>8.969.532,00</b>	<b>5,490</b>	<b>-1.395.108,00</b>
<b>Rentenfonds</b>						<b>8.969.532,00</b>	<b>5,490</b>	<b>-1.395.108,00</b>
<b>EUR Euro</b>	<b>Aktueller Kurs</b>	<b>1,000000</b>				<b>8.969.532,00</b>	<b>5,490</b>	<b>-1.395.108,00</b>
LU0300357802	DWS Invest Euro Corporate Bonds FC	57.200	1,000000	181,200	156,810	8.969.532,00	5,490	-1.395.108,00 147.576,00

<sup>1</sup>im unrealisierten Ergebnis enthaltene ordentliche Ertragskomponente

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Bankkonten  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Währung	Zinssatz % p.a.	Fälligkeit	Bestand lokal	Devisenkurs	Bestand	Vorgerechnete Zinsen	Wert	% *
<b>Gesamt</b>					<b>18.428.660,83</b>	<b>3.248,27</b>	<b>18.431.909,10</b>	<b>11,282</b>
<b>Bankkonten</b>					<b>18.428.660,83</b>	<b>3.248,27</b>	<b>18.431.909,10</b>	<b>11,282</b>
<b>CHF</b>		<b>Schweizer Franken</b>	<b>977,76</b>	<b>0,960600</b>	<b>1.017,86</b>	<b>0,61</b>	<b>1.018,47</b>	<b>0,001</b>
		Bankkonten bereits valuiert	977,76		1.017,86	0,61	1.018,47	0,001
<b>DKK</b>		<b>Dänische Krone</b>	<b>7.448,38</b>	<b>7,451898</b>	<b>999,53</b>	<b>0,00</b>	<b>999,53</b>	<b>0,001</b>
		Bankkonten bereits valuiert	7.448,38		999,53	0,00	999,53	0,001
<b>EUR</b>		<b>Euro</b>	<b>17.913.847,86</b>	<b>1,000000</b>	<b>17.913.847,86</b>	<b>3.018,93</b>	<b>17.916.866,79</b>	<b>10,967</b>
		Bankkonten bereits valuiert	17.913.847,86		17.913.847,86	3.018,93	17.916.866,79	10,967
<b>GBP</b>		<b>Pfund Sterling</b>	<b>221.029,91</b>	<b>0,858700</b>	<b>257.401,84</b>	<b>177,84</b>	<b>257.579,68</b>	<b>0,158</b>
		Bankkonten bereits valuiert	221.029,91		257.401,84	177,84	257.579,68	0,158
<b>JPY</b>		<b>Yen</b>	<b>1.993,00</b>	<b>157,158573</b>	<b>12,68</b>	<b>-0,01</b>	<b>12,67</b>	<b>0,000</b>
		Bankkonten bereits valuiert	1.993,00		12,68	-0,01	12,67	0,000
<b>NOK</b>		<b>Norwegische Krone</b>	<b>2.667,07</b>	<b>11,215289</b>	<b>237,81</b>	<b>0,00</b>	<b>237,81</b>	<b>0,000</b>
		Bankkonten bereits valuiert	2.667,07		237,81	0,00	237,81	0,000
<b>SEK</b>		<b>Schwedische Krone</b>	<b>2.815.633,14</b>	<b>11,593531</b>	<b>242.862,03</b>	<b>0,00</b>	<b>242.862,03</b>	<b>0,149</b>
		Bankkonten bereits valuiert	2.815.633,14		242.862,03	0,00	242.862,03	0,149
<b>USD</b>		<b>US-Dollar</b>	<b>13.552,33</b>	<b>1,103499</b>	<b>12.281,22</b>	<b>50,89</b>	<b>12.332,11</b>	<b>0,008</b>
		Bankkonten bereits valuiert	13.552,33		12.281,22	50,89	12.332,11	0,008

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Bestand Futures  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

ISIN / ID	Wertpapierbezeichnung	Fälligkeit	Kontraktgröße	Whg.	Nominal	Einstand	Kurs	Tägliche Variation Margin	Unreal. Ergebnis	% *
<b>Gesamt</b>								<b>-20.800,00</b>	<b>-325.780,00</b>	<b>-0,013</b>
<b>Futures auf Aktien</b>								<b>-20.800,00</b>	<b>-325.780,00</b>	<b>-0,013</b>
VGU320232	EURO STOXX 50 SEP 23	15.09.2023	10	EUR	-208	4.348,375	4.505,000	-20.800,00	-325.780,00	-0,013

\* bezogen auf Portfolio gesamt



Konzernübersicht Wertpapiere exkl. Fonds  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

	Kurswert inkl. Stückzins	% *	% anrechenbar
Agache SE	2.820.930,00	1,727	1,727
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	2.820.930,00	1,727	1,727
Asml Holding N.V.	3.022.825,00	1,850	1,850
ASML Holding N.V.	3.022.825,00	1,850	1,850
Austria, Republic of	3.767.938,54	2,306	2,306
Austria, Republic of	3.767.938,54	2,306	2,306
BASF SE	1.690.872,53	1,035	1,035
BASF SE	494.344,50	0,303	0,303
Wintershall Dea Finance B.V.	1.196.528,03	0,732	0,732
Belgium, Kingdom of	2.009.016,07	1,230	1,230
Belgium, Kingdom of	2.009.016,07	1,230	1,230
Deutschland, Bundesrepublik	18.998.131,98	11,629	11,629
Deutschland, Bundesrepublik	18.998.131,98	11,629	11,629
European Union	2.168.499,64	1,327	1,327
European Union	2.168.499,64	1,327	1,327
French Republic	9.092.085,07	5,565	5,565
French Republic	9.092.085,07	5,565	5,565
Hessen, Land	1.744.802,02	1,068	1,068
Hessen, Land	1.744.802,02	1,068	1,068
Ireland, Republic	9.889.654,82	6,053	6,053
Ireland, Republic	9.889.654,82	6,053	6,053
Italien, Republik	2.552.238,00	1,562	1,562
Italy, Republic of	2.552.238,00	1,562	1,562
Kadmon Holdings Inc.	1.669.181,50	1,022	1,022
Sanofi S.A.	1.669.181,50	1,022	1,022
Kreditanstalt für Wiederaufbau	5.288.948,36	3,237	3,237
Kreditanstalt für Wiederaufbau	5.288.948,36	3,237	3,237
Portugal, Republic of	5.481.386,17	3,355	3,355
Portugal, Republic of	5.481.386,17	3,355	3,355
Spain, Kingdom of	7.608.489,44	4,657	4,657
Spain, Kingdom of	7.608.489,44	4,657	4,657
Stichting AdministratiekantoorBeheer Financiële In	1.908.178,42	1,168	1,168
ABN AMRO Bank N.V., Amsterdam	1.908.178,42	1,168	1,168

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Konzernübersicht Wertpapiere exkl. Fonds  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

	<b>Kurswert inkl. Stückzins</b>	<b>% *</b>	<b>% anrechenbar</b>
Sonstige Konzerne unter 1%	56.339.287,38	34,485	34,485

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Währungsgewichtungen Portfolio gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag) Inkl. vorgerechneter Zinsen

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Währung	Aktien inkl. Aktienfonds		Renten inkl. Rentenfonds		Devisentermingeschäfte		Kasse inkl. Geldmarktfonds		Sonstiges		Gesamt	
	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *
<b>Gesamt</b>	<b>39.650.562,38</b>	<b>24,27</b>	<b>105.371.434,56</b>	<b>64,50</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>18.431.909,10</b>	<b>11,28</b>	<b>-78.147,03</b>	<b>-0,05</b>	<b>163.375.759,01</b>	<b>100,00</b>
CHF	983.527,77	0,60	0,00	0,00	0,00	0,00	1.018,47	0,00	0,00	0,00	984.546,24	0,60
DKK	477.259,49	0,29	0,00	0,00	0,00	0,00	999,53	0,00	761,08	0,00	479.020,10	0,29
EUR	36.002.372,13	22,04	102.720.627,61	62,87	0,00	0,00	17.916.866,79	10,97	-84.177,70	-0,05	156.555.688,83	95,83
GBP	1.768.159,52	1,08	2.650.806,95	1,62	0,00	0,00	257.579,68	0,16	5.269,59	0,00	4.681.815,74	2,87
JPY	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	12,67	0,00	0,00	0,00	12,67	0,00
NOK	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	237,81	0,00	0,00	0,00	237,81	0,00
SEK	419.243,47	0,26	0,00	0,00	0,00	0,00	242.862,03	0,15	0,00	0,00	662.105,50	0,41
USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	12.332,11	0,01	0,00	0,00	12.332,11	0,01

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Ländergewichtungen Portfolio gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag) Inkl. vorgerechneter Zinsen

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Land	Aktien inkl. Aktienfonds		Renten inkl. Rentenfonds		Devisentermingeschäfte		Kasse inkl. Geldmarktfonds		Sonstiges		Gesamt	
	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *
<b>Gesamt</b>	<b>39.650.562,38</b>	<b>24,27</b>	<b>105.371.434,56</b>	<b>64,50</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>18.431.909,10</b>	<b>11,28</b>	<b>-78.147,03</b>	<b>-0,05</b>	<b>163.375.759,01</b>	<b>100,00</b>
Belgien	0,00	0,00	2.009.016,07	1,23	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.009.016,07	1,23
Dänemark	477.259,49	0,29	293.963,79	0,18	0,00	0,00	999,53	0,00	0,00	0,00	772.222,81	0,47
Deutschland	9.292.706,60	5,69	28.913.606,48	17,70	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	38.206.313,08	23,39
Eurozone	0,00	0,00	8.969.532,00	5,49	0,00	0,00	17.916.866,79	10,97	-20.800,00	-0,01	26.865.598,79	16,44
Finnland	0,00	0,00	1.076.969,72	0,66	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.076.969,72	0,66
Frankreich	15.853.995,86	9,70	12.806.220,95	7,84	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	28.660.216,81	17,54
Indonesien	0,00	0,00	1.061.478,07	0,65	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.061.478,07	0,65
Irland	1.012.161,81	0,62	12.109.454,54	7,41	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	13.121.616,35	8,03
Italien	664.132,27	0,41	2.552.238,00	1,56	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3.216.370,27	1,97
Japan	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	12,67	0,00	0,00	0,00	12,67	0,00
Luxemburg	0,00	0,00	1.838.970,71	1,13	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.838.970,71	1,13
Niederlande	6.041.343,02	3,70	2.399.814,41	1,47	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8.441.157,43	5,17
Norwegen	0,00	0,00	1.154.936,87	0,71	0,00	0,00	237,81	0,00	0,00	0,00	1.155.174,68	0,71
Österreich	0,00	0,00	4.370.658,32	2,68	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4.370.658,32	2,68
Portugal	0,00	0,00	5.481.386,17	3,36	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5.481.386,17	3,36
Schweden	419.243,47	0,26	912.632,38	0,56	0,00	0,00	242.862,03	0,15	0,00	0,00	1.574.737,88	0,96
Schweiz	1.451.246,47	0,89	901.789,43	0,55	0,00	0,00	1.018,47	0,00	0,00	0,00	2.354.054,37	1,44
Spanien	2.038.603,63	1,25	9.214.118,20	5,64	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	11.252.721,83	6,89
Südafrika	0,00	0,00	388.884,42	0,24	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	388.884,42	0,24

\* bezogen auf Portfolio gesamt

WeightCountry

Ländergewichtungen Portfolio gesamt  
vom 31.07.2023 (Buchungstag) Inkl. vorgerechneter Zinsen

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Land	Aktien inkl. Aktienfonds		Renten inkl. Rentenfonds		Devisentermingeschäfte		Kasse inkl. Geldmarktfonds		Sonstiges		Gesamt	
	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *	Marktwert	% *
Supranational	0,00	0,00	3.528.909,51	2,16	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3.528.909,51	2,16
Ungeschlüsselt	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-57.347,03	-0,04	-57.347,03	-0,04
Vereinigte Staaten	0,00	0,00	3.928.604,77	2,40	0,00	0,00	12.332,11	0,01	0,00	0,00	3.940.936,88	2,41
Vereinigtes Königreich	2.399.869,76	1,47	1.458.249,75	0,89	0,00	0,00	257.579,68	0,16	0,00	0,00	4.115.699,19	2,52

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Branchengewichtungen  
vom 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Branchen Aktien	Betrag	%	% *	Branchen Renten	Betrag	%	% *
<b>Gesamt</b>	<b>39.650.562,38</b>	<b>100,000</b>	<b>24,270</b>	<b>Gesamt</b>	<b>96.401.902,56</b>	<b>100,000</b>	<b>59,006</b>
Technologie	5.526.603,48	13,938	3,383	Staatsanleihen (in Landeswährung)	60.475.909,81	62,733	37,016
Konsumgüter & Dienstleistungen	5.018.204,34	12,656	3,072	Industrie	11.260.750,59	11,681	6,893
Banken	4.506.070,87	11,364	2,758	Finanzinstitute	9.273.289,28	9,619	5,676
Industriegüter und Dienstleistungen	3.710.888,71	9,359	2,271	Agencies	6.334.701,59	6,571	3,877
Gesundheitswesen	3.451.683,89	8,705	2,113	Supranationale	3.528.909,51	3,661	2,160
Versicherungen	2.947.097,63	7,433	1,804	Sonstige öffentliche Schuldner	1.744.802,02	1,810	1,068
Chemie	2.641.392,95	6,662	1,617	Covered / Pfandbriefe	1.708.948,88	1,773	1,046
Energie	2.281.976,02	5,755	1,397	Staatsanleihen (in Fremdwährung)	1.061.478,07	1,101	0,650
Automobilhersteller und Zulieferer	1.945.235,14	4,906	1,191	Versorger	1.013.112,81	1,051	0,620
Versorger	1.817.312,77	4,583	1,112				
Bauwesen und Materialien	1.688.553,09	4,259	1,034	Einteilung in Anlehnung an Barclays			
Telekommunikation	1.458.930,30	3,679	0,893	* bezogen auf Portfolio gesamt			
Lebensmittel, Getränke & Tabak	1.358.865,70	3,427	0,832				
Körperpflege, Drogerie und Einkaufszentrum	980.018,49	2,472	0,600				
Medien	305.986,38	0,772	0,187				
Utilities	11.742,62	0,030	0,007				

Einteilung in Anlehnung an Stoxx

\* bezogen auf Portfolio gesamt

Umsätze Wertpapiere  
vom 01.07.2023 bis 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

ISIN / ID	Wertpapierbezeichnung	Kupon %	Fälligkeit	Transaktion	Handelstag Handelszeit	Nominal/Stück Whg.	Einstand	Kurs	Ausmachender Betrag	Realisierter Gewinn/Verlust Zwischengewinn <sup>1</sup>
<b>Aktien gesamt</b>										
DE0006969603	PUMA			Kauf	24.07.2023 09:13:00	5.292 EUR	56,758	56,747	-300.364,13	
ES0144580Y14	Iberdrola (new)			Auslieferung	07.07.2023 11:19:02	EUR			0,00	
ES06445809Q1	Iberdrola Right			Einlieferung	07.07.2023 11:19:02	38.337 EUR	0,255		0,00	
FR0000120628	AXA			Kauf	24.07.2023 09:11:00	3.960 EUR	27,737	27,649	-109.838,42	
FR0000121667	EssilorLuxottica			Verkauf	24.07.2023 09:05:00	-1.060 EUR	133,124	176,628	187.188,02	46.076,68
FR0000130577	Publicis Groupe			Kauf	24.07.2023 09:14:00	4.179 EUR	70,648	70,423	-295.238,21	
GB00BD6K4575	Compass Group			Verkauf	24.07.2023 09:04:00	-9.947 GBP	11,983	21,107	242.622,96	109.217,10
NL0000303709	AEGON			Verkauf	24.07.2023 09:30:00	-41.575 EUR	4,645	4,750	197.445,91	4.347,33
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M. Ericsson B (Free)			Verkauf	24.07.2023 09:15:00	-35.912 SEK	103,301	52,359	162.409,81	-198.946,38
<b>Renten gesamt</b>										
ES0000012B62	Spain 18/30.07.23	0,350	30.07.2023	Fälligkeit	30.07.2023 00:16:46	-2.200.000 EUR	100,052	100,000	2.200.000,00	-1.153,73
PTOTEYOE0031	Obrigacoes Do Tesouro 22/16.07.32	1,650	16.07.2032	Kauf	12.07.2023 13:39:00	2.900.000 EUR	86,928	86,928	-2.580.822,82	

<sup>1</sup>im unrealisierten Ergebnis enthaltene ordentliche Ertragskomponente

Umsätze Wertpapiere  
vom 01.07.2023 bis 31.07.2023 (Buchungstag)

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Wertpapierart	Käufe Kurswert	Verkäufe Kurswert	Realisierte Gewinne <sup>1</sup>	Realisierte Verluste <sup>1</sup>	Saldo
Aktien gesamt					
Euroland	704.088,59	384.710,88	50.424,01	0,00	50.424,01
Deutschland	300.304,07	0,00	0,00	0,00	0,00
Sonstige Euroländer	403.784,52	384.710,88	50.424,01	0,00	50.424,01
Sonstiges Europa	0,00	405.114,95	109.217,10	-198.946,38	-89.729,28
Renten gesamt					
Euro / Euroländer	2.520.912,00	2.200.000,00	0,00	-1.153,73	-1.153,73
Sonstige Euroländer	2.520.912,00	2.200.000,00	0,00	-1.153,73	-1.153,73
<b>Gesamt</b>	<b>3.225.000,59</b>	<b>2.989.825,83</b>	<b>159.641,11</b>	<b>-200.100,11</b>	<b>-40.459,00</b>

<sup>1</sup>in den realisierten Gewinnen und Verlusten sind ggf. Zwischengewinne als ordentliche Ertragskomponente enthalten



# Ertrags- und Aufwandsrechnung

vom 31.07.2023 (Buchungstag) Umlaufende Anteile: 1.199.879 Geschäftsjahr: 01.01. - 31.12.

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Art der Positionen	Gesamt in EUR	pro Anteil	Art der Positionen	Gesamt in EUR	pro Anteil
<b>Ertrag</b>			<b>Aufwendungen</b>		
Zinsen aus Liquiditätsanlagen Inland	265.791,47	0,22	All-In-Fee	0,00	0,00
Zinsen aus Liquiditätsanlagen Ausland	0,00	0,00	Performance Fee	0,00	0,00
Wertpapierzinsen Inland	-3.243,47	0,00	Verwaltungsvergütung	-501.535,31	-0,42
Wertpapierzinsen Ausland	458.619,82	0,38	Depotgebühren	-8.823,73	-0,01
Dividenden Inland	322.842,45	0,27	Depotbankgebühren	-11.673,56	-0,01
Körperschaftsteuer	-48.426,37	-0,04	Zinsaufwendungen	-3.086,68	0,00
Dividenden Ausland	818.644,30	0,68	Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-9.757,40	-0,01
Quellensteuer	-23.500,06	-0,02	Erfolgsabh. Vergütung aus WP-Leihe-Erträge	0,00	0,00
davon anrechenbare Quellensteuer	-22.499,45	-0,02	WP-Leihe inkl. Kompensationen	0,00	0,00
davon nicht anrechenbare Quellensteuer	-1.000,61	0,00	WP-Pensionsgeschäfte	0,00	0,00
Erträge aus WP Darlehen	0,00	0,00	Kompensationszahlungen	0,00	0,00
Erträge aus Pensionsgeschäften	0,00	0,00	Tax d'Abonnement	0,00	0,00
Erträge aus Kompensationszahlungen	0,00	0,00	Sonstige Aufwendungen	-883,42	0,00
Erträge aus Investmentanteilen	0,00	0,00	davon Rechtskosten	0,00	0,00
erstattete Quellensteuer	0,00	0,00	davon Provision	0,00	0,00
Bestandsprovisionen	0,00	0,00	davon andere Aufwendungen	-883,42	0,00
Erträge aus Rechtsansprüchen	39,97	0,00	davon Aufwandsausgleich Zwischenausüttung	0,00	0,00
sonstige Erträge	0,00	0,00			
<b>Summe Erträge</b>	<b>1.790.768,11</b>	<b>1,49</b>	<b>Summe Aufwendungen</b>	<b>-535.760,10</b>	<b>-0,45</b>
davon Ertrags- u. Aufwandsausgleich	7.591,87	0,01	davon Ertrags- u. Aufwandsausgleich	-2.480,61	0,00
			Kap.Ertragst. incl. Soli.	0,00	0,00

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

<b>Art der Positionen</b>	<b>Gesamt in EUR</b>
Ordentliche Erträge des laufenden Geschäftsjahres	1.790.768,11
Ordentliche Aufwendungen des laufenden Geschäftsjahres	-535.760,10
Ausschüttung/Thesaurierung aus den laufenden Erträgen	0,00
<b>Ausschüttungsfähiger laufender Ertrag</b>	<b>1.255.008,01</b>
<b>Ergebnis des vorangegangenen Jahres vor Ausschüttungsbeschluß</b>	<b>0,00</b>
Ausschüttungsfähiges laufendes außerordentliches Ergebnis	-241.014,50
Ausschüttung/Thesaurierung aus dem außerordentlichen Ergebnis	0,00
Ausschüttungsfähiger Vortrag aus Vorjahren	31.011.969,96
<b>Ausschüttungsfähiger Gesamtbetrag</b>	<b>32.025.963,47</b>

Alle hier aufgeführten ausschüttungsfähigen Beträge sind rein investmentrechtlich und vorbehaltlich einer Validierung durch die Fachabteilung (EoY-Taxes).

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**Basiswahrung: **EUR**Nummer: **011 0440**ISIN: **DE0003429221**

Art der Positionen	realisierte Gewinne		realisierte Verluste		realisiertes Ergebnis	
	in EUR	pro Anteil	in EUR	pro Anteil	in EUR	pro Anteil
Aktien Inland	0,00	0,00	-202.506,08	-0,17	-202.506,08	-0,17
Aktien Ausland	1.249.365,93	1,04	-569.528,79	-0,47	679.837,14	0,57
Renten Inland	1.002,96	0,00	-288.195,79	-0,24	-287.192,83	-0,24
Renten Ausland	0,00	0,00	-88.503,78	-0,07	-88.503,78	-0,07
Indexzertifikate Inland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Indexzertifikate Ausland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Investmentanteile Inland	12,64	0,00	0,00	0,00	12,64	0,00
Investmentanteile Ausland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Optionen	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Futures	825.957,30	0,69	-1.183.858,68	-0,99	-357.901,38	-0,30
Swaps	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Wahrung	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Devisentermingeschafte	29.656,57	0,02	-14.416,78	-0,01	15.239,79	0,01
Sonstiges	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Verlust Sonstige Gebuhren	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Gesamt</b>	<b>2.105.995,40</b>	<b>1,76</b>	<b>-2.347.009,90</b>	<b>-1,96</b>	<b>-241.014,50</b>	<b>-0,20</b>
Art der Positionen	unrealisierte Gewinne		unrealisierte Verluste		unrealisiertes Ergebnis	
	in EUR	pro Anteil	in EUR	pro Anteil	in EUR	pro Anteil
Aktien Inland	2.101.448,47	1,75	-437.519,32	-0,36	1.663.929,15	1,39
Aktien Ausland	8.759.784,53	7,30	-516.385,57	-0,43	8.243.398,96	6,87
Renten Inland	66.722,25	0,06	-3.831.835,40	-3,19	-3.765.113,15	-3,14
Renten Ausland	91.921,90	0,08	-6.896.952,04	-5,75	-6.805.030,14	-5,67
Indexzertifikate Inland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Indexzertifikate Ausland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Investmentanteile	0,00	0,00	-1.395.108,00	-1,16	-1.395.108,00	-1,16
Optionen	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Futures	0,00	0,00	-325.780,00	-0,27	-325.780,00	-0,27
Swaps	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Wahrung	0,19	0,00	-48.049,94	-0,04	-48.049,75	-0,04
Devisentermingeschafte	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Sonstiges	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Gesamt</b>	<b>11.019.877,34</b>	<b>9,18</b>	<b>-13.451.630,27</b>	<b>-11,21</b>	<b>-2.431.752,93</b>	<b>-2,03</b>

## Mittelaufkommen

vom 01.07.2023 bis 31.07.2023 (Buchungstag), Geschäftsjahr: 01.01 - 31.12

Name: **DeAM-Fonds WOP 2**

Basiswährung: **EUR**

Nummer: **011 0440**

ISIN: **DE0003429221**

Art	Abrechnungstag	Pro Anteil	Stück	Preis	Betrag	Aktiengewinn	Zwischengewinn	Immobilien-gewinn
						in %	pro Anteil	in %
Neuanlage / Wiederanlage	06.07.2023		1.036,0000	135,2200	140.087,92			
Rücknahme	06.07.2023		-1.224,0000	135,2200	-165.509,28			
Rücknahme	07.07.2023		-37,0000	134,5500	-4.978,35			
Rücknahme	10.07.2023		-261,0000	134,0300	-34.981,83			
Neuanlage / Wiederanlage	11.07.2023		89,0000	134,0900	11.934,01			
Rücknahme	19.07.2023		-74,0000	135,6300	-10.036,62			
<b>Gesamt Neuanlagen / Wiederanlagen</b>			<b>1.125,0000</b>	<b>135,1306*</b>	<b>152.021,93</b>			
<b>Gesamt Rücknahmen</b>			<b>-1.596,0000</b>	<b>135,0289*</b>	<b>-215.506,08</b>			
<b>Gesamt</b>			<b>-471,0000</b>		<b>-63.484,15</b>			

\* Durchschnittspreis

## Disclaimer

### Zusätzliche Kundeninformation:

Die Informationen über

1. Kosten,
2. die Transaktionsinformationen Auftragsart (type of the order) und
3. den Ausführungsplatz (venue identification)

sind noch nicht in diesem Bericht enthalten und werden auf Anfrage zur Verfügung gestellt.

Wir arbeiten bereits an einem Report, der auch diese Informationen automatisch enthält.