



**FMM-FONDS**  
**HALBJAHRESBERICHT**  
**ZUM 30. JUNI 2024**

---

Verwaltung, Vertrieb und Beratung	3
Vermögensübersicht	4
Ertrags- und Aufwandsrechnung	5
Vermögensaufstellung	6
Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	15
Anhang	19

---

Der Verkaufsprospekt einschließlich Anlagebedingungen, die Basisinformationsblätter 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 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.

# VERWALTUNG, VERTRIEB UND BERATUNG

## VERWALTUNGSGESELLSCHAFT UND AIFM

DJE Investment S.A.  
R.C.S. Luxembourg B 90 412  
22A, Schaffmill  
L-6778 Grevenmacher, Luxembourg

## VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT (LEITUNGSORGAN)

(Stand: 30. Juni 2024)

## VORSITZENDER DES VERWALTUNGSRATES

Dr. Jens Ehrhardt  
Vorstandsvorsitzender  
der DJE Kapital AG  
Pullach

## GESCHÄFTSFÜHRENDE STELLVERTRETENDE VERWALTUNGSRATSVORSITZENDE

Dr. Ulrich Kaffarnik  
Vorstand 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  
Lukas Baginski  
Manuela Kugel (seit dem 01.01.2024)

## 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 INFORMATIONSTELLE BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND

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

## VERTRIEBS- UND INFORMATIONSTELLE BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND

DJE Kapital AG  
Pullacher Straße 24  
D-82049 Pullach

## FONDSMANAGER

DJE Kapital AG  
Pullacher Straße 24  
D-82049 Pullach

## 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

## 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 DIE SCHWEIZ

## ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ

NPB Neue Privat Bank AG  
Limmatquai 1  
CH-8001 Zürich

## VERTRETER IN DER SCHWEIZ

FIRST INDEPENDENT FUND SERVICES LTD.  
Feldeggstrasse 12  
CH-8008 Zürich

## ANTEILKLASSENMERKMALE DES FONDS

	FMM-Fonds P	FMM-Fonds XP
WP-Kenn-Nr.:	847811	A3ENGF
ISIN-Code:	DE0008478116	DE000A3ENGF3
Auflegungsdatum	17.08.1987	01.03.2024
Fondswährung	EUR	EUR
Ertragsverwendung	thesaurierend	ausschüttend
Anzahl der Anteile	801.187,220	826.914,818
Anteilwert (in Fondswährung)	694,07	105,46
Anleger	private Anleger	private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	bis zu 5%, derzeit 5%	bis zu 5%, derzeit 0%
Rücknahmeabschlag	entfällt	entfällt
Mindestanlagesumme <sup>1</sup>	entfällt	3.000.000,00 EUR
Verwaltungsvergütung	bis zu 1,6% p. a., derzeit 1,55%	bis zu 1,6% p. a., derzeit 0,95%

## VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>2</sup>
<b>I. VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>		
<b>1. Aktien – Gliederung nach Branche</b>		
Finanzwesen	125.432.329,79	19,50
IT	67.137.330,80	10,44
Versorgungsbetriebe	60.268.919,25	9,37
Nicht-Basiskonsumgüter	49.188.386,43	7,65
Industrie	48.499.922,18	7,54
Roh-, Hilfs- u. Betriebsstoffe	33.583.269,89	5,22
Telekommunikationsdienste	30.864.677,62	4,80
Gesundheitswesen	29.992.982,39	4,66
Energie	24.623.642,09	3,83
Immobilien	7.265.897,45	1,13
Basiskonsumgüter	4.749.081,07	0,74
<b>Summe</b>	<b>481.606.438,96</b>	<b>74,88</b>
<b>2. Verzinsliche Wertpapiere – Gliederung nach Land/Region</b>		
Vereinigte Staaten von Amerika	29.553.534,39	4,59
Italien	16.421.269,52	2,55
Deutschland	10.892.865,20	1,69
<b>Summe</b>	<b>56.867.669,11</b>	<b>8,83</b>
<b>3. Zertifikate</b>	<b>14.530.276,95</b>	<b>2,26</b>
<b>4. Investmentanteile</b>	<b>5.467.731,98</b>	<b>0,85</b>
<b>5. Derivate</b>	<b>-1.219.738,12</b>	<b>-0,19</b>
<b>6. Bankguthaben</b>	<b>82.101.060,16</b>	<b>12,76</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>8.106.667,11</b>	<b>1,26</b>
<b>Summe</b>	<b>647.460.106,15</b>	<b>100,65</b>
<b>II. VERBINDLICHKEITEN</b>	<b>-4.174.692,26</b>	<b>-0,65</b>
<b>III. FONDSVERMÖGEN</b>	<b>643.285.413,89</b>	<b>100,00</b>

1 | Die Gesellschaft ist befugt, nach ihrem Ermessen auch geringere Beträge zu akzeptieren.

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

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS

	Total EUR	FMM-Fonds P EUR	FMM-Fonds XP <sup>1</sup> EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>516.369.307,07</b>	<b>516.369.307,07</b>	<b>0,00</b>
1. Mittelzufluss (netto)	85.751.256,48	3.211.293,80	82.539.962,68
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheinverkäufen	124.499.502,97	36.699.407,78	87.800.095,19
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheinrücknahmen	-38.748.246,49	-33.488.113,98	-5.260.132,51
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-68.988,23	-95.117,93	26.129,70
3. Ergebnis des Geschäftsjahres	41.233.838,57	36.590.738,70	4.643.099,87
Davon nicht realisierte Gewinne	30.634.749,30	28.439.189,00	2.195.560,30
Davon nicht realisierte Verluste	-3.491.074,77	-3.969.100,06	478.025,29
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>643.285.413,89</b>	<b>556.076.221,64</b>	<b>87.209.192,25</b>

## ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG

(inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis 30. Juni 2024

	Total EUR	FMM-Fonds P EUR	FMM-Fonds XP <sup>1</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller	5.301.723,14	4.583.669,25	718.053,89
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	5.754.382,38	5.184.060,83	570.321,55
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	415.166,21	366.126,97	49.039,24
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	1.389.511,67	1.261.526,74	127.984,93
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	1.043.613,64	949.836,66	93.776,98
6. Erträge aus Investmentanteilen	19.689,00	19.689,00	0,00
7. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-748.205,50	-646.865,74	-101.339,76
8. Abzug ausländischer Quellensteuer	-729.748,90	-664.122,20	-65.626,70
9. Sonstige Erträge	3.168,01	2.739,15	428,86
<b>Summe der Erträge</b>	<b>12.449.299,65</b>	<b>11.056.660,66</b>	<b>1.392.638,99</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	5.480,13	5.057,35	422,78
2. Verwaltungsvergütung	4.339.428,06	4.156.461,39	182.966,67
3. Verwahrstellenvergütung	90.346,86	81.749,10	8.597,76
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	22.251,05	21.044,63	1.206,42
5. Sonstige Aufwendungen	80.465,14	72.415,15	8.049,99
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>4.537.971,24</b>	<b>4.336.727,62</b>	<b>201.243,62</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>7.911.328,41</b>	<b>6.719.933,04</b>	<b>1.191.395,37</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne	42.394.264,07	38.107.133,53	4.287.130,54
2. Realisierte Verluste	-36.215.428,44	-32.706.416,81	-3.509.011,63
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>6.178.835,63</b>	<b>5.400.716,72</b>	<b>778.118,91</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>14.090.164,04</b>	<b>12.120.649,76</b>	<b>1.969.514,28</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	30.634.749,30	28.439.189,00	2.195.560,30
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-3.491.074,77	-3.969.100,06	478.025,29
<b>VI. Nicht Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>27.143.674,53</b>	<b>24.470.088,94</b>	<b>2.673.585,59</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>41.233.838,57</b>	<b>36.590.738,70</b>	<b>4.643.099,87</b>

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück	Bestand 30.06.2024	Käufe Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE</b>								
<b>Aktien</b>								
<b>Bermudas</b>								
BMG4069C1486	Great Eagle Holdings Ltd.	STK	4.104.000,00	1.236.000,00	0,00	11,0200	5.416.037,56	0,84
BMG5256W1029	Kingmaker Footwear Holdings Ltd.	STK	46.398.000,00	23.254.000,00	0,00	0,7200	4.000.593,98	0,62
							<b>9.416.631,54</b>	<b>1,46</b>
<b>Cayman Inseln</b>								
US01609W1027	Alibaba Group Holding Ltd. ADR	STK	81.245,00	81.245,00	0,00	72,3700	5.498.130,40	0,85
KYG7082H1276	Pico Far East Holdings Ltd.	STK	13.752.000,00	0,00	0,00	1,8200	2.997.298,33	0,47
							<b>8.495.428,73</b>	<b>1,32</b>
<b>China</b>								
CNE1000003X6	Ping An Insurance [Group] Co. of China Ltd.	STK	278.500,00	557.000,00	278.500,00	35,4000	1.180.650,03	0,18
							<b>1.180.650,03</b>	<b>0,18</b>
<b>Dänemark</b>								
DK0010244508	A.P.Moeller-Maersk A/S	STK	1.250,00	1.250,00	0,00	12.250,0000	2.053.742,67	0,32
DK0062498333	Novo-Nordisk AS	STK	124.328,00	133.121,00	51.700,00	1.000,4000	16.681.786,40	2,59
							<b>18.735.529,07</b>	<b>2,91</b>
<b>Deutschland</b>								
DE0008404005	Allianz SE	STK	99.856,00	9.856,00	0,00	261,6000	26.122.329,60	4,06
DE0005909006	Bilfinger SE	STK	36.000,00	36.000,00	0,00	49,2000	1.771.200,00	0,28
DE0005810055	Dte. Börse AG	STK	54.530,00	14.130,00	17.000,00	193,9500	10.576.093,50	1,64
DE0005557508	Dte. Telekom AG	STK	406.446,00	78.176,00	0,00	23,5000	9.551.481,00	1,48
DE000DWS1007	DWS Group GmbH & Co. KGaA	STK	148.260,00	70.960,00	0,00	33,5400	4.972.640,40	0,77
DE000ENAG999	E.ON SE	STK	1.969.350,00	841.350,00	440.800,00	12,3650	24.351.012,75	3,79
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK	104.630,00	119.030,00	111.400,00	28,0400	2.933.825,20	0,46
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK	21.420,00	5.560,00	13.840,00	236,8000	5.072.256,00	0,79
DE0008430026	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München	STK	23.014,00	7.438,00	7.724,00	469,8000	10.811.977,20	1,68
DE0007037129	RWE AG	STK	725.668,00	704.880,00	318.912,00	32,2400	23.395.536,32	3,64
DE0007164600	SAP SE	STK	51.800,00	15.400,00	0,00	187,9800	9.737.364,00	1,51
DE0007274136	Sto SE & Co. KGaA -VZ-	STK	24.510,00	2.680,00	0,00	159,4000	3.906.894,00	0,61
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA	STK	8.900,00	8.900,00	0,00	60,2000	535.780,00	0,08
DE000TUAG505	TUI AG	STK	1.811.700,00	647.020,00	0,00	6,6520	12.051.428,40	1,87
							<b>145.789.818,37</b>	<b>22,66</b>
<b>Finnland</b>								
FI0009007132	Fortum Oyj	STK	419.899,00	314.114,00	279.000,00	13,9450	5.855.491,56	0,91
							<b>5.855.491,56</b>	<b>0,91</b>
<b>Frankreich</b>								
FR000121972	Schneider Electric SE	STK	5.750,00	5.750,00	0,00	225,9500	1.299.212,50	0,20
FR000120271	TotalEnergies SE	STK	274.000,00	93.059,00	0,00	62,4500	17.111.300,00	2,66
							<b>18.410.512,50</b>	<b>2,86</b>

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

## Fortsetzung – Vermögensaufstellung

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück	Bestand 30.06.2024	Käufe Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Großbritannien</b>								
GB00B1XZS820	Anglo American Plc.	STK	66.000,00	95.800,00	29.800,00	25,0250	1.952.766,61	0,30
GB00B10RZP78	Unilever Plc.	STK	53.000,00	53.000,00	0,00	51,5000	2.729.500,00	0,42
							<b>4.682.266,61</b>	<b>0,72</b>
<b>Hongkong</b>								
HK0160011786	Hon Kwok Land Investment Co. Ltd.	STK	11.113.000,00	8.150.000,00	0,00	1,3900	1.849.859,89	0,29
							<b>1.849.859,89</b>	<b>0,29</b>
<b>Indien</b>								
US45104G1040	ICICI Bank Ltd. ADR	STK	82.490,00	82.490,00	0,00	29,0100	2.237.736,02	0,35
INE758E01017	Jio Financial Services Ltd.	STK	381.760,00	330.000,00	0,00	358,3000	1.533.081,62	0,24
INE002A01018	Reliance Industries Ltd.	STK	40.000,00	139.800,00	151.560,00	3.133,5000	1.404.810,47	0,22
US8565522039	State Bank of India GDR	STK	26.900,00	26.900,00	0,00	102,2000	2.570.768,66	0,40
							<b>7.746.396,77</b>	<b>1,21</b>
<b>Irland</b>								
IE00B4BNMY34	Accenture Plc.	STK	7.050,00	7.050,00	0,00	303,1900	1.998.774,55	0,31
IE000S9YS762	Linde Plc.	STK	51.087,00	10.692,00	9.800,00	440,2200	21.030.034,73	3,27
							<b>23.028.809,28</b>	<b>3,58</b>
<b>Italien</b>								
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	60.000,00	60.000,00	0,00	34,6350	2.078.100,00	0,32
							<b>2.078.100,00</b>	<b>0,32</b>
<b>Japan</b>								
JP3143600009	ITOCHU Corporation	STK	121.600,00	121.600,00	0,00	7.854,0000	5.550.659,07	0,86
JP3183200009	Japan Exchange Group Inc.	STK	510.100,00	259.900,00	0,00	3.752,0000	11.123.417,41	1,73
JP3210200006	Kajima Corporation	STK	110.600,00	110.600,00	0,00	2.781,5000	1.787.945,48	0,28
JP3877600001	Marubeni Corporation	STK	303.300,00	303.300,00	0,00	2.975,5000	5.245.083,98	0,82
JP3898400001	Mitsubishi Corporation	STK	108.300,00	108.300,00	0,00	3.148,0000	1.981.450,66	0,31
JP3902400005	Mitsubishi Electric Corporation	STK	83.700,00	83.700,00	0,00	2.567,5000	1.248.981,46	0,19
JP3893600001	Mitsui & Co. Ltd.	STK	381.000,00	312.800,00	29.600,00	3.651,0000	8.084.569,34	1,26
JP3885780001	Mizuho Financial Group Inc.	STK	87.000,00	87.000,00	0,00	3.358,0000	1.697.930,95	0,26
JP3970300004	Recruit Holdings Co. Ltd.	STK	54.900,00	9.900,00	0,00	8.607,0000	2.746.276,30	0,43
JP3500610005	Resona Holdings Inc.	STK	1.217.800,00	647.500,00	0,00	1.064,5000	7.534.279,32	1,17
JP3420600003	Sekisui House Ltd.	STK	67.000,00	67.000,00	0,00	3.563,0000	1.387.428,80	0,22
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	STK	174.900,00	138.900,00	0,00	10.725,0000	10.902.025,46	1,69
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc.	STK	519.100,00	381.200,00	0,00	6.005,0000	18.116.909,80	2,82
							<b>77.406.958,03</b>	<b>12,04</b>
<b>Kanada</b>								
CA13321L1085	Cameco Corporation	STK	25.690,00	59.290,00	72.764,00	51,7600	1.243.420,98	0,19
							<b>1.243.420,98</b>	<b>0,19</b>
<b>Luxemburg</b>								
LU0633102719	Samsonite International SA	STK	993.400,00	993.400,00	0,00	23,3000	2.771.869,61	0,43
							<b>2.771.869,61</b>	<b>0,43</b>

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück	Bestand 30.06.2024	Käufe Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Niederlande</b>								
NL0010273215	ASML Holding NV	STK	4.000,00	6.050,00	2.050,00	969,4000	3.877.600,00	0,60
NL0011821202	ING Groep NV	STK	218.000,00	218.000,00	0,00	16,0680	3.502.824,00	0,54
NL0000395903	Wolters Kluwer NV	STK	12.645,00	12.645,00	0,00	155,1000	1.961.239,50	0,30
							<b>9.341.663,50</b>	<b>1,44</b>
<b>Norwegen</b>								
NO0010096985	Equinor ASA	STK	182.359,00	13.335,00	205.091,00	304,3500	4.864.110,64	0,76
NO0003053605	Storebrand ASA	STK	194.000,00	194.000,00	0,00	108,7000	1.848.137,21	0,29
							<b>6.712.247,85</b>	<b>1,05</b>
<b>Österreich</b>								
AT000000STR1	Strabag SE	STK	37.200,00	37.200,00	0,00	39,1000	1.454.520,00	0,23
							<b>1.454.520,00</b>	<b>0,23</b>
<b>Schweden</b>								
SE0015811963	Investor AB	STK	21.400,00	21.400,00	0,00	289,8500	544.524,72	0,08
							<b>544.524,72</b>	<b>0,08</b>
<b>Schweiz</b>								
CH0012214059	Holcim Ltd.	STK	81.000,00	81.000,00	0,00	79,4800	6.693.574,55	1,04
CH0244767585	UBS Group AG	STK	73.900,00	88.300,00	221.000,00	26,7200	2.053.033,89	0,32
							<b>8.746.608,44</b>	<b>1,36</b>
<b>Spanien</b>								
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. (BBVA)	STK	102.100,00	102.100,00	0,00	9,3400	953.614,00	0,15
ES0148396007	Industria de Diseño Textil S.A.	STK	71.500,00	71.500,00	0,00	46,6000	3.331.900,00	0,52
							<b>4.285.514,00</b>	<b>0,67</b>
<b>Südkorea</b>								
KR7005380001	Hyundai Motor Co. Ltd.	STK	6.500,00	6.500,00	0,00	295.000,0000	1.299.709,22	0,20
KR7005931001	Samsung Electronics Co. Ltd. -VZ-	STK	21.500,00	43.000,00	21.500,00	63.600,0000	926.843,49	0,14
KR7000660001	SK Hynix Inc.	STK	48.500,00	37.900,00	0,00	236.500,0000	7.774.701,25	1,21
							<b>10.001.253,96</b>	<b>1,55</b>
<b>Taiwan</b>								
US8740391003	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR	STK	17.600,00	62.200,00	72.100,00	171,6300	2.824.656,82	0,44
							<b>2.824.656,82</b>	<b>0,44</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>								
US02079K1079	Alphabet Inc.	STK	54.710,00	119.090,00	64.380,00	186,8600	9.559.669,53	1,49
US02079K3059	Alphabet Inc.	STK	17.240,00	1.260,00	117.300,00	185,4100	2.989.029,74	0,46
US0231351067	Amazon.com Inc.	STK	72.870,00	63.670,00	9.200,00	197,8500	13.481.699,55	2,10
US0378331005	Apple Inc.	STK	87.300,00	87.300,00	0,00	214,1000	17.477.959,60	2,72
US1941621039	Colgate-Palmolive Co.	STK	22.000,00	22.000,00	0,00	98,1700	2.019.581,07	0,31
US2091151041	Consolidated Edison Inc.	STK	79.500,00	79.500,00	0,00	89,6800	6.666.878,62	1,04
US2786421030	eBay Inc.	STK	38.500,00	38.500,00	0,00	53,0500	1.909.879,37	0,30
US5324571083	Eli Lilly and Company	STK	12.208,00	19.750,00	30.142,00	909,0400	10.377.370,79	1,61

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

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück/ WHG	Bestand 30.06.2024	Käufe Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>								
US5949181045	Microsoft Corporation	STK	24.261,00	18.761,00	20.000,00	452,8500	10.273.605,62	1,60
US64110L1061	Netflix Inc.	STK	8.175,00	16.950,00	8.775,00	684,3400	5.231.419,02	0,81
US67066G1040	NVIDIA Corporation	STK	68.224,00	101.318,00	33.094,00	123,9900	7.910.130,69	1,23
US68389X1054	Oracle Corporation	STK	14.400,00	70.000,00	55.600,00	140,1800	1.887.593,04	0,29
US74762E1029	Quanta Services Inc.	STK	53.318,00	7.300,00	0,00	267,0600	13.315.041,22	2,07
US8716071076	Synopsys Inc.	STK	4.400,00	500,00	3.850,00	595,0000	2.448.101,74	0,38
US8725401090	TJX Companies Inc.	STK	33.429,00	33.429,00	0,00	110,5500	3.455.747,10	0,54
							<b>109.003.706,70</b>	<b>16,95</b>
<b>Summe Aktien</b>							<b>481.606.438,96</b>	<b>74,85</b>
<b>VERZINSLICHE WERTPAPIERE</b>								
<b>EUR</b>								
DE0005229942	15,000% Bertelsmann SE & Co. KGaA Genussscheine v.00(2199)	EUR	1.496.860,00	300.000,00	0,00	267,0000	3.996.616,20	0,62
							<b>3.996.616,20</b>	<b>0,62</b>
<b>USD</b>								
US912828D564	2,375% Vereinigte Staaten von Amerika v.14(2024)	USD	100.000,00	100.000,00	0,00	99,6680	93.199,90	0,01
US912828A70	1,500% Vereinigte Staaten von Amerika v.16(2026)	USD	350.000,00	350.000,00	0,00	93,6250	306.421,83	0,05
US9128285J52	3,000% Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2025)	USD	4.200.000,00	4.200.000,00	0,00	97,5117	3.829.710,30	0,60
US91282CHL81	4,625% Vereinigte Staaten von Amerika v.23(2025)	USD	24.000.000,00	5.500.000,00	3.000.000,00	99,5625	22.344.305,22	3,47
							<b>26.573.637,25</b>	<b>4,13</b>
<b>Summe verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>30.570.253,45</b>	<b>4,75</b>
<b>ZERTIFIKATE</b>								
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>								
IE00B579F325	Invesco Physical Markets Plc./ Gold Unze Zert. v.09(2100)	STK	6.500,00	6.500,00	0,00	209,9200	1.364.480,00	0,21
DE000A2T0VU5	XTrackers ETC PLC/ Gold Unze Zert. v.20(2080)	STK	392.166,00	582.471,00	1.873.145,00	33,5720	13.165.796,95	2,05
							<b>14.530.276,95</b>	<b>2,26</b>
<b>Summe Zertifikate</b>							<b>14.530.276,95</b>	<b>2,26</b>
<b>Summe börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>526.706.969,36</b>	<b>81,86</b>

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

ISIN	Gattungsbezeichnung	WHG/ Anteile	Bestand 30.06.2024	Käufe Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>AN ORGANISIERTEN MÄRKTEN ZUGELASSENE ODER IN DIESE EINBEZOGENE WERTPAPIERE</b>								
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								
<b>EUR</b>								
IT0005560948	4,200% Italien Reg.S. v.23(2034)	EUR	14.900.000,00	2.700.000,00	2.500.000,00	101,6620	15.147.638,00	2,35
DE000A351SD3	5,750% SGL CARBON SE/ SGL CARBON SE Reg.S. CV v.23(2028)	EUR	700.000,00	700.000,00	0,00	101,7620	712.334,00	0,11
XS2581393134	6,875% Telecom Italia S.p.A. Reg.S. v.23(2028)	EUR	496.000,00	1.050.000,00	1.954.000,00	105,3950	522.759,20	0,08
XS2798883752	6,875% Telecom Italia S.p.A. Reg.S. v.24(2028)	EUR	704.000,00	704.000,00	0,00	106,6580	750.872,32	0,12
XS2776523669	5,875% TUI AG Reg.S. Sustain- ability Linked Bond v.24(2029)	EUR	6.100.000,00	6.100.000,00	0,00	101,3750	6.183.875,00	0,96
							<b>23.317.478,52</b>	<b>3,62</b>
<b>USD</b>								
US90353TAC45	8,000% Uber Technologies Inc. 144A v.18(2026)	USD	3.160.000,00	660.000,00	0,00	100,8450	2.979.897,14	0,46
							<b>2.979.897,14</b>	<b>0,46</b>
<b>Summe verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>26.297.375,66</b>	<b>4,08</b>
<b>Summe an organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>26.297.375,66</b>	<b>4,08</b>
<b>NICHT NOTIERTE WERTPAPIERE</b>								
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								
<b>EUR</b>								
DE000A3827U8	7,250% DAH Energie v.12(2018)	EUR	400.000,00	400.000,00	0,00	0,0100	40,00	0,00
							<b>40,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Summe verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>40,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Summe nicht notierte Wertpapiere</b>							<b>40,00</b>	<b>0,00</b>
<b>INVESTMENTANTEILE</b>								
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>								
FR0010361683	Amundi MSCI India II UCITS ETF (0,85%)	ANT	171.639,00	171.639,00	0,00	31,8560	5.467.731,98	0,85
<b>Summe der gruppenfremden Investmentanteile</b>							<b>5.467.731,98</b>	<b>0,85</b>
<b>Summe der Anteile an Investmentanteilen</b>							<b>5.467.731,98</b>	<b>0,85</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>558.472.117,00</b>	<b>86,79</b>

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

**DERIVATE**

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

Derivate	WHG	Bestand 30.06.2024	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>AKTIENINDEX-DERIVATE</b>				
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
DAX Index Future September 2024	EUX EUR	Anzahl -41	-178.675,00	-0,03
Nasdaq 100 Index Future September 2024	CME USD	Anzahl -17	-61.202,54	-0,01
Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Future September 2024	CME USD	Anzahl -71	-325.322,61	-0,05
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>			<b>-565.200,15</b>	<b>-0,09</b>
<b>ZINS-DERIVATE</b>				
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>				
<b>Zins-Terminkontrakte</b>				
CBT 30YR US Ultra Bond Future September 2024	CBT USD	32.500.000	188.978,63	0,03
<b>Summe der Zins-Derivate</b>			<b>188.978,63</b>	<b>0,03</b>
<b>DEISEN-DERIVATE</b>				
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>				
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>				
<b>Offene Positionen (OTC)<sup>1</sup></b>				
CNH		-150.000.000,00	55.290,44	0,01
USD		-85.000.000,00	-898.807,04	-0,14
<b>Summe der Devisen-Derivate</b>			<b>-843.516,60</b>	<b>-0,13</b>

<sup>1</sup> | 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 30.06.2024	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>BANKGUTHABEN, NICHT VERBRIEFTE GELDMARKTINSTRUMENTE UND GELDMARKTFONDS</b>				
<b>Bankguthaben</b>				
DZ PRIVATBANK S.A., Niederlassung Frankfurt	EUR	45.479.839,48	45.479.839,48	7,07
Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	6.107.281,70	6.107.281,70	0,95
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	AUD	215.537,83	133.708,33	0,02
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	CAD	8.468,69	5.777,13	0,00
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	CHF	5.892.472,80	6.126.504,87	0,95
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	CNH	506,64	64,92	0,00
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	GBP	568.759,18	672.451,15	0,10
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	HKD	38.236.073,45	4.578.951,12	0,71
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	ILS	25.725,83	6.398,03	0,00
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	INR	301.790.813,54	3.382.470,84	0,53
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	JPY	71.996.637,13	418.439,13	0,07
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	MXN	226.607,43	11.529,08	0,00
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	MYR	8.061,10	1.598,03	0,00
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	NZD	374,44	212,57	0,00
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	SGD	2.569.107,02	1.770.943,01	0,28
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	TRY	6.857,62	195,36	0,00
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	TWD	1.167.642,98	33.643,55	0,01
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	USD	14.298.105,34	13.370.212,59	2,08
Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	ZAR	16.327,66	839,27	0,00
<b>Summe der Bankguthaben</b>			<b>82.101.060,16</b>	<b>12,77</b>
<b>Summe der Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>			<b>82.101.060,16</b>	<b>12,77</b>
<b>SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>				
Forderungen WP-Geschäfte	EUR	631.003,48	631.003,48	0,10
Zinsansprüche	EUR	1.510.310,71	1.510.310,71	0,23
Dividendenansprüche	EUR	478.275,96	478.275,96	0,07
Einschüsse (Initial Margins)	EUR	4.142.224,56	4.142.224,56	0,64
Steuerrückerstattungsansprüche	EUR	1.197.459,44	1.197.459,44	0,19
Forderungen aus Anteilumsatz	EUR	147.392,96	147.392,96	0,02
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>			<b>8.106.667,11</b>	<b>1,25</b>
<b>VERBINDLICHKEITEN AUS KREDITAUFNAHME</b>				
Bankverbindlichkeiten in Nicht-EU/EWR-Währungen	KRW	-104.359,00	-70,74	0,00
<b>Summe Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>			<b>-70,74</b>	<b>0,00</b>

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

Derivate	WHG	Bestand 30.06.2024	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>SONSTIGE VERBINDLICHKEITEN</b>				
Verbindlichkeiten WP-Geschäfte	EUR	-3.259.199,69	-3.259.199,69	-0,51
Verbindlichkeiten für abzuführende Verwaltungsvergütung	EUR	-697.781,14	-697.781,14	-0,11
Verbindlichkeiten aus Anteilumsatz	EUR	-191.541,63	-191.541,63	-0,03
Sonstige Verbindlichkeiten <sup>1</sup>	EUR	-26.099,06	-26.099,06	0,00
<b>Summe sonstige Verbindlichkeiten</b>			<b>-4.174.621,52</b>	<b>-0,65</b>
<b>Fondsvermögen</b>			<b>643.285.413,89</b>	<b>100,00</b>
<b>ZURECHNUNG AUF DIE ANTEILKLASSEN</b>				
<b>FMM-Fonds</b>				
Anteilwert	EUR			694,07
Umlaufende Anteile	STK			801.187,220
<b>FMM-Fonds XP</b>				
Anteilwert	EUR			105,46
Umlaufende Anteile	STK			826.914,818
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen</b>	<b>(in %)</b>			<b>86,79</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen</b>	<b>(in %)</b>			<b>-0,19</b>

<sup>1</sup> | Diese Position setzt sich im Wesentlichen aus der Abgrenzung für die Verwaltungs- und verwahrestellenvergütung zusammen.

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

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

**WERTPAPIER-, DEISENKURSE, MARKTSÄTZE**

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

Wertpapierkurse	Kurse per 28.06.2024 oder letztbekannte
Alle anderen Vermögensgegenstände	Kurse per 28.06.2024
Deisenkurse	Kurse per 28.06.2024

**DEISENKURSE**

Deisenkurse (in Mengennotiz)	WHG	Kurse
Australischer Dollar	AUD	1,612000 = 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,845800 = 1 Euro (EUR)
Chinesischer Renminbi (Off Shore)	CNH	7,804300 = 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	DKK	7,455900 = 1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	HKD	8,350400 = 1 Euro (EUR)
Indische Rupie	INR	89,222000 = 1 Euro (EUR)
Israelischer Schekel	ILS	4,020900 = 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	172,060000 = 1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	CAD	1,465900 = 1 Euro (EUR)
Malaysischer Ringit	MYR	5,044400 = 1 Euro (EUR)
Mexikanischer Peso	MXN	19,655300 = 1 Euro (EUR)
Neuseeländischer Dollar	NZD	1,761500 = 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	11,410300 = 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	SEK	11,391200 = 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,961800 = 1 Euro (EUR)
Singapur Dollar	SGD	1,450700 = 1 Euro (EUR)
Südafrikanischer Rand	ZAR	19,454600 = 1 Euro (EUR)
Südkoreanischer Won	KRW	1.475,330000 = 1 Euro (EUR)
Taiwan Dollar	TWD	34.706300 = 1 Euro (EUR)
Türkische Lira	TRY	35.103100 = 1 Euro (EUR)
US Amerikanischer Dollar	USD	1,069400 = 1 Euro (EUR)

**MARKTSCHLÜSSEL**

**A) Terminbörse**

CBT	Chicago Board of Trade
CME	Chicago Mercantile Exchange
EUX	EUREX, Frankfurt

**B) 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
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Australien</b>				
AU000000NST8	Northern Star Resources Ltd.	STK	282.900,00	282.900,00
<b>Cayman Inseln</b>				
KYG022421088	Alchip Technologies Ltd.	STK	0,00	21.000,00
<b>Dänemark</b>				
DK0060257814	Zealand Pharma A/S	STK	27.676,00	27.676,00
<b>Deutschland</b>				
DE000BASF111	BASF SE	STK	60.800,00	60.800,00
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK	403.654,00	403.654,00
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG	STK	114.300,00	114.300,00
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK	0,00	168.100,00
DE000A3E00M1	IONOS Group SE	STK	0,00	54.050,00
DE000KSAG888	K+S Aktiengesellschaft	STK	90.000,00	90.000,00
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK	0,00	84.100,00
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK	0,00	202.600,00
DE000ZAL1111	Zalando SE	STK	122.000,00	122.000,00
<b>Finnland</b>				
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK	0,00	84.000,00
<b>Frankreich</b>				
FR0000120644	Danone S.A.	STK	29.000,00	29.000,00
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	16.900,00	16.900,00
<b>Großbritannien</b>				
GB0000456144	Antofagasta Plc.	STK	100.415,00	100.415,00
JE00BRX98089	CVC Capital Partners Plc.	STK	129.600,00	129.600,00
<b>Indien</b>				
US40415F1012	HDFC Bank Ltd. ADR	STK	0,00	38.700,00
<b>Indonesien</b>				
ID1000095003	PT Bank Mandiri [Persero] TBK	STK	5.160.000,00	5.160.000,00
<b>Italien</b>				
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK	563.000,00	563.000,00
<b>Japan</b>				
JP3116000005	Asahi Group Holdings Ltd.	STK	21.000,00	104.000,00
JP3304200003	Komatsu Ltd.	STK	103.500,00	103.500,00
JP3266400005	Kubota Corporation	STK	192.100,00	192.100,00
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co. Ltd.	STK	201.000,00	201.000,00
JP3569200003	Tokyu Fudosan Holdings Corp.	STK	507.800,00	507.800,00
<b>Kanada</b>				
CA0084741085	Agnico Eagle Mines Ltd.	STK	34.000,00	34.000,00

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
<b>Norwegen</b>				
NO0011082075	Höegh Autoliners ASA	STK	507.722,00	507.722,00
NO0010571680	Wallenius Wilhelmsen ASA	STK	346.179,00	346.179,00
<b>Österreich</b>				
AT0000741053	EVN AG	STK	0,00	116.900,00
<b>Schweden</b>				
SE0007075056	Eolus Vind AB	STK	0,00	186.800,00
<b>Schweiz</b>				
CH0012005267	Novartis AG	STK	38.710,00	71.080,00
CH0024608827	Partners Group Holding AG	STK	0,00	3.100,00
<b>Singapur</b>				
SG1L01001701	DBS Group Holdings Ltd.	STK	69.300,00	69.300,00
<b>Südafrika</b>				
US38059T1060	Gold Fields Ltd. ADR	STK	692.537,00	1.463.637,00
US4132163001	Harmony Gold Mining Co. Ltd. ADR	STK	703.600,00	703.600,00
<b>Südkorea</b>				
KR7105560007	KB Financial Group Inc.	STK	32.800,00	32.800,00
US48241A1051	KB Financial Group Inc. ADR	STK	92.400,00	92.400,00
KR7138040001	Meritz Financial Group Inc.	STK	22.000,00	22.000,00
KR7005930003	Samsung Electronics Co. Ltd.	STK	29.000,00	58.500,00
<b>Taiwan</b>				
TW0002368008	Gold Circuit Electronics Ltd.	STK	235.000,00	313.000,00
TW0002382009	Quanta Computer Inc.	STK	204.000,00	287.000,00
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
US00724F1012	Adobe Inc.	STK	0,00	4.100,00
US00206R1023	AT & T Inc.	STK	0,00	100.000,00
US1273871087	Cadence Design Systems Inc.	STK	1.000,00	16.300,00
US19260Q1076	Coinbase Global Inc.	STK	14.900,00	14.900,00
US3119001044	Fastenal Co.	STK	27.600,00	27.600,00
US35671D8570	Freeport-McMoRan Inc.	STK	38.700,00	38.700,00
US3703341046	General Mills Inc.	STK	390.500,00	482.300,00
US4581401001	Intel Corporation	STK	0,00	25.800,00
US5128071082	Lam Research Corporation	STK	1.300,00	1.300,00
US30303M1027	Meta Platforms Inc.	STK	20.730,00	28.930,00
US74624M1027	Pure Storage Inc.	STK	37.900,00	37.900,00
US81762P1021	ServiceNow Inc.	STK	0,00	1.700,00
US5184391044	The Estée Lauder Companies Inc.	STK	14.450,00	14.450,00
US2546871060	The Walt Disney Co.	STK	35.576,00	35.576,00
US90353T1007	Uber Technologies Inc.	STK	38.228,00	89.062,00
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc.	STK	3.300,00	3.300,00
US91913Y1001	Valero Energy Corporation	STK	12.200,00	12.200,00
US92343V1044	Verizon Communications Inc.	STK	0,00	90.000,00
US3848021040	W.W. Grainger Inc.	STK	1.567,00	1.567,00

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	WHG/ Anteile	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
<b>VERZINSLICHE WERTPAPIERE</b>				
<b>EUR</b>				
XS2559580548	4,250% Fresenius SE & Co. KGaA EMTN Reg.S. v.22(2026)	EUR	1.000.000,00	4.400.000,00
<b>MXN</b>				
XS2191236715	4,250% European Investment Bank (EIB) EMTN v.20(2024)	MXN	43.500.000,00	43.500.000,00
XS0300626479	7,500% Inter-American Development Bank v.07(2024)	MXN	104.600.000,00	104.600.000,00
XS2393511071	6,250% International Bank for Reconstruction and Development EMTN Green Bond v.21(2026)	MXN	111.000.000,00	111.000.000,00
<b>NOK</b>				
NO0010732555	1,750% Norwegen Reg.S. v.15(2025)	NOK	180.000.000,00	180.000.000,00
<b>USD</b>				
US912828V988	2,250% Vereinigte Staaten von Amerika v.17(2027)	USD	550.000,00	550.000,00
US91282CEK36	2,500% Vereinigte Staaten von Amerika v.22(2024)	USD	100.000,00	100.000,00
<b>AN ORGANISIERTEN MÄRKTEN ZUGELASSENE ODER IN DIESE EINBEZOGENE WERTPAPIERE</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Indien</b>				
US7594701077	Reliance Industries Ltd. GDR	STK	4.810,00	4.810,00
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
DE000A3E5KG2	5,000% TUI AG/TUI AG Reg.S. CV v.21(2028)	EUR	2.800.000,00	6.100.000,00
<b>USD</b>				
US037833EV87	4,300% Apple Inc. v.23(2033)	USD	500.000,00	500.000,00
US084664DA63	2,875% Berkshire Hathaway Finance Corporation v.22(2032)	USD	600.000,00	600.000,00
US594918BC73	3,500% Microsoft Corporation v.15(2035)	USD	600.000,00	600.000,00
<b>NICHT NOTIERTE WERTPAPIERE</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Österreich</b>				
AT0000A36HK3	Strabag SE BZR 22.04.24	STK	6.200,00	6.200,00
<b>INVESTMENTANTEILE</b>				
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>				
IE00BPVLQD13	Xtrackers MSCI Japan ESG Screened UCITS ETF (0,00 %)	ANT	203.974,00	203.974,00

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

## DERIVATE

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

Derivate	WHG	Volumen in 1.000
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>AKTIENINDEX-TERMINKONTRAKTE</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte</b>		
Basiswert(e) CBOE Volatility Index	USD	112.955
Basiswert(e) DAX Index	EUR	37.659
Basiswert(e) FTSE MIB Index	EUR	12.444
Basiswert(e) Hang Seng Index	HKD	210.194
Basiswert(e) Nasdaq 100 Index	USD	10.928
Basiswert(e) Nikkei 225 Stock Average Index	USD	88.702
Basiswert(e) Russell 2000 Index	USD	55.003
Basiswert(e) S&P 500 Index	USD	10.804
Basiswert(e) Stoxx 600 Banks Index	EUR	18.963
<b>Verkaufte Kontrakte</b>		
Basiswert(e) DAX Index	EUR	308.485
Basiswert(e) Euro Stoxx 50 Price Index	EUR	10.201
Basiswert(e) Hang Seng Index	HKD	53.456
Basiswert(e) Nasdaq 100 Index	USD	365.236
Basiswert(e) Nikkei 225 Stock Average Index	USD	114.267
Basiswert(e) S&P 500 Index	USD	71.793
<b>ZINS-TERMINKONTRAKTE</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte</b>		
Basiswert(e) US T-Bond 30Yr 6% Synth. Anleihe	USD	106.178
<b>DEVISENTERMINKONTRAKTE (VERKAUF)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin</b>		
HKD	EUR	11.418
<b>DEVISENTERMINKONTRAKTE (KAUF)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin</b>		
HKD	EUR	24.735
USD	EUR	162.934

# ANHANG

## ANGABEN GEM. § 7 NR. 9 KARBV

### SONSTIGE ANGABEN

Fonds Anteilklasse	Umlaufende Anteile Stück	Anteilwert EUR
FMM-Fonds P	801.187,220	694,07
FMM-Fonds XP	826.914,818	105,46

### 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 oder 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 nachfolgend unter „Besondere Bewertungsregeln“ nicht anders angegeben.

#### Nicht an einer Börse zugelassene oder an einem organisierten Markt 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 nachfolgend unter „Besondere Bewertungsregeln“ nicht anders angegeben.

### BESONDERE BEWERTUNGSREGELN EINZELNER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

#### NICHTNOTIERTE SCHULDVERSCHREIBUNGEN UND SCHULDSCHEINDARLEHEN

Für die Bewertung von Schuldverschreibungen, die nicht zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind (z. B. nicht notierte Anleihen, Commercial Papers und Einlagenzerti-

fikate), 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.

#### GELDMARKTINSTRUMENTE

Bei den in den OGAW-Sondervermögen befindlichen Geldmarktinstrumenten werden Zinsen und zinsähnliche Erträge sowie Aufwendungen (z. B. Verwaltungsvergütung, Verwahrstellenvergütung, Prüfungskosten, Kosten der Veröffentlichung etc.) bis einschließlich des Tages vor dem Valutatag berücksichtigt. Geldmarktinstrumente werden zu den jeweiligen Marktsätzen bewertet.

#### 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.

Swaps werden zu ihrem Verkehrswert angesetzt, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der Gesamtumstände angemessen ist.

#### BANKGUTHABEN, FESTGELDER UND 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 gewährleistet. Stehen diese Werte nicht zur Verfügung, werden Anteile an Investmentvermögen zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen 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.

**INFORMATIONEN FÜR SCHWEIZER ANLEGER**

**ALLGEMEINES**

Der Verkaufsprospekt einschließlich Anlagebedingungen, die Basisinformationsblätter, 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](https://www.djefinanz.ch/CH_de/home). In der Schweiz können diese bei „www.fundinfo.com“ kostenlos bezogen werden.

**VALORENNUMMER**

Fondsname	Valorenummer
FMM-Fonds P	332250
FMM-Fonds XP	133145677

**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), retro-

spektiv in einem Prozentsatz des Netto-Teilfondsvermögens aus und ist grundsätzlich nach folgender Formel zu berechnen:

$$TER\% = \frac{\text{Total Betriebsaufwand in RE}^1}{\text{Durchschnittliches Netto-Teilfondsvermögen in RE}^1} \times 100$$

Nach Richtlinie der Asset Management Association Switzerland (AMAS) vom 16. Mai 2008 (Stand: 21. August 2022) wurde für den Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024 folgende TER in Prozent ermittelt:

Fondsname	Schweizer TER ohne Performance Fee
FMM-Fonds P	1,61
FMM-Fonds XP	0,71

Eine Performance Fee ist im Berichtszeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024 nicht angefallen.

**HINWEISE FÜR DIE ANLEGER**

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

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

**PROSPEKTÄNDERUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM**

Publikationen zu Prospektänderungen im Berichtszeitraum werden auf [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com) zum Abruf zur Verfügung gestellt.

1 | RE = Einheiten in der Rechnungswährung der kollektiven Kapitalanlage

## **ZUSÄTZLICHE ANHANGSANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 ÜBER WERTPAPIER- FINANZIERUNGSGESCHÄFTE**

---

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 Gesamttrendite-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.

Luxemburg, 22. Juli 2024

DJE Investment S.A.  
Der Verwaltungsrat

## 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  
Grillparzerstraße 15  
60320 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.  
22 A, Schaffmill  
6778 Grevenmacher  
Luxemburg

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