



DWS Fixed Maturity

Rapport semestriel 2023

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)
de droit luxembourgeois



Investors for a new now

Sommaire

Rapport semestriel 2023
pour la période du 1^{er} juillet 2023 au 31 décembre 2023

2 / Informations

4 / Rapport semestriel
DWS Fixed Maturity SICAV

4 / DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

Informations

Les fonds cités dans le présent rapport sont des compartiments d'une SICAV (Société d'Investissement à Capital Variable) de droit luxembourgeois.

Performance

Le succès d'un investissement dans un fonds de placement se mesure à l'aune de la performance de ses actions. Les valeurs liquidatives (prix de rachat) servent de base au calcul de la valeur, à laquelle s'ajoutent les distributions intermédiaires. Les indications sur la performance passée d'un fonds ne préjugent pas de sa performance future.

Dans la mesure où il existe, l'indice de référence est, en outre, reproduit dans le rapport. Toutes les données graphiques et chiffrées reflètent la [situation au 31 décembre 2023](#) (sauf indication contraire).

Prospectus de vente

L'achat d'actions de fonds est basé sur le prospectus de vente actuellement en vigueur ainsi que sur le document intitulé « Informations clés pour l'investisseur » et sur les statuts de la SICAV, accompagné du dernier rapport annuel révisé et du rapport semestriel correspondant si ce dernier est plus récent que le dernier rapport annuel.

Cours de souscription et de rachat

Les cours de souscription et de rachat applicables, de même que toutes les autres informations destinées aux actionnaires, peuvent faire à tout moment l'objet d'une demande au siège de la société de gestion ou auprès des agents payeurs. De plus, les cours de souscription et de rachat sont publiés dans des médias appropriés (par ex. Internet, systèmes d'information électroniques, journaux, etc.), dans chaque pays de distribution.

Rapport semestriel

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

Performance des classes d'actions (en euro)

Classe d'actions	ISIN	6 mois
Classe LD	LU2572114879	4,8 %

Performance calculée d'après la méthode de l'Association fédérale des sociétés d'investissement allemandes (BVI), c'est-à-dire sans prise en compte du droit d'entrée. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.
Situation au : 31 décembre 2023

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

État de l'actif au 31 décembre 2023

	Montant en EUR	Part en % de l'actif du fonds
I. Éléments d'actif		
1. Obligations (émetteurs) :		
Entreprises	84 999 004,55	46,82
Autres établissements financiers	55 359 372,80	30,50
Instituts	39 382 638,30	21,70
Total des obligations :	179 741 015,65	99,02
2. Avoirs bancaires	151 772,34	0,08
3. Autres éléments d'actif	1 749 157,47	0,96
II. Engagements		
1. Autres engagements	-123 741,19	-0,06
III. Actif du fonds	181 518 204,27	100,00

De faibles différences ont pu apparaître car les pourcentages sont arrondis lors du calcul.

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

État du portefeuille-titres au 31 décembre 2023

Dénomination des titres	Unité ou devise en milliers	Quantité	Achats / entrées pendant la période	Ventes / sorties sous revue	Cours	Valeur boursière en EUR	Part en % de l'actif du fonds
Valeurs mobilières cotées en bourse						179 741 015,65	99,02
Titres portant intérêt							
1,7500 % 2i Rete Gas 17/28 08 26 MTN (XS1571982468)	EUR	910			% 96,3400	876 694,00	0,48
0,0500 % Aareal Bank Ag 21/02 09 26 MTN (DE000AAR0298)	EUR	1600			% 89,4870	1 431 792,00	0,79
1,0000 % Abertis Infraestructuras 16/27 02 27 (ES0211845310)	EUR	1000			% 94,1490	941 490,00	0,52
0,6000 % ABN AMRO Bank 20/15 01 27 MTN (XS2102283061)	EUR	1500			% 92,3910	1 385 865,00	0,76
3,0000 % ACCOR 19/04 02 26 (FR0013399029)	EUR	1000			% 96,4470	964 470,00	0,53
1,0000 % ACEA 16/24 10 26 MTN (XS1508912646)	EUR	940			% 94,4230	887 576,20	0,49
5,2500 % Albion Fin. 1/Aggreko Holdings 21/15 10 26 Reg S (XS2399700959)	EUR	840			% 100,3070	842 578,80	0,46
3,8750 % Allwyn International 20/15 02 27 Reg S (XS2113253210)	EUR	940			% 96,4680	906 799,20	0,50
4,8750 % Almagro The Italian INN 21/30 10 26 Reg S (XS2403514479)	EUR	720			% 99,0150	712 908,00	0,39
2,1250 % Almirall 21/30 09 26 Reg S (XS2388162385)	EUR	1550			% 96,5230	1 496 106,50	0,82
5,8750 % Altice France18/01 02 27 Reg S (XS1859337419)	EUR	810			% 89,3040	723 362,40	0,40
0,4500 % American Tower 21/15 01 27 (XS2346206902)	EUR	2 080			% 91,5660	1 904 572,80	1,05
1,1250 % Amplifon 20/13 02 27 (XS2116503546)	EUR	800			% 92,4800	739 840,00	0,41
2,8750 % Aon Global 14/14 05 26 (XS1062493934)	EUR	1490			% 98,4940	1 467 560,60	0,81
2,0000 % APA Infrastructure 15/22 03 27 MTN (XS1205616698)	EUR	2 010			% 95,5410	1 920 374,10	1,06
4,6250 % APCOA Parking Holdings 21/15 01 27 Reg S (XS2366276595)	EUR	870			% 94,1960	819 505,20	0,45
4,8750 % ArcelorMittal 22/26 09 2026 MTN (XS2537060746)	EUR	1840			% 103,2650	1 900 076,00	1,05
2,1250 % Ardagh Pack Fin./Holdings USA 20/15 08 26 Reg S (XS2189356996)	EUR	970			% 89,4140	867 315,80	0,48
1,0000 % ASTM 21/25 11 26 MTN (XS2412267358)	EUR	2 110			% 93,3920	1 970 571,20	1,09
1,8000 % AT & T 18/05 09 26 (XS1907120528)	EUR	910			% 96,6140	879 187,40	0,48
1,7500 % Autostrade per L'Italia 16/01 02 27 MTN (XS1528093799)	EUR	2 300			% 94,8090	2 180 607,00	1,20
1,2500 % Avinor 17/09 02 27 MTN (XS1562601424)	EUR	650		650	% 94,9250	617 012,50	0,34
1,5000 % Ball 19/15 03 27 (XS2080318053)	EUR	870			% 93,8980	816 912,60	0,45
0,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 21/24 03 27 MTN (XS2322289385)	EUR	1500			% 93,1720	1 397 580,00	0,77
0,5000 % Banco Santander 21/24 03 27 MTN (XS2324321285)	EUR	2 200			% 93,3650	2 054 030,00	1,13
1,9490 % Bank of America 22/27 10 26 MTN (XS2462324232)	EUR	1400			% 97,1470	1 360 058,00	0,75
0,8750 % Bankinter 19/08 07 26 (ES0213679HN2)	EUR	2 100			% 94,1660	1 977 486,00	1,09
2,8850 % Barclays 22/31 01 2027 MTN (XS2487667276)	EUR	2 200			% 98,4090	2 164 998,00	1,19
4,0000 % Bayer 23/26 08 2026 MTN (XS2630111982)	EUR	1090			% 101,4870	1 106 208,30	0,61
1,1250 % Bco De Sabadell 20/11 03 27 (XS2228245838)	EUR	2 300			% 94,9770	2 184 471,00	1,20
1,9000 % Becton, Dickinson & Co. 16/15 12 26 (XS1531347661)	EUR	910			% 96,7380	880 315,80	0,48
2,1250 % BNP Paribas 19/23 01 27 MTN (FR0013398070)	EUR	2 300			% 97,2320	2 236 336,00	1,23
4,0000 % Booking Holdings 22/15 11 2026 (XS2555218291)	EUR	840			% 102,8520	863 956,80	0,48
1,5730 % BP Capital Markets 15/16 02 27 MTN (XS1190974011)	EUR	920			% 95,5830	879 363,60	0,48
0,5000 % BPCE 19/24 04 27 Reg S MTN (FR0013455540)	EUR	2 000			% 91,6520	1 833 040,00	1,01
0,3750 % CaixaBank 20/18 11 26 MTN (XS2258971071)	EUR	2 000			% 94,1990	1 883 980,00	1,04
4,7770 % Celanese US Holdings 22/19 07 2026 (XS2497520705)	EUR	1740			% 101,7860	1 771 076,40	0,98
0,7500 % Cellnex Finance Company 21/15 11 26 MTN (XS2300292617)	EUR	1100			% 92,7900	1 020 690,00	0,56
0,8750 % CEZ 19/02 12 26 MTN (XS2084418339)	EUR	2 270			% 92,6490	2 103 132,30	1,16
4,5000 % Cirsia Finance International 21/15 03 27 Reg S (XS2388186996)	EUR	770			% 96,5310	743 288,70	0,41
2,1250 % Citigroup 14/10 09 26 MTN (XS1107727007)	EUR	1900			% 96,3480	1 830 612,00	1,01
0,8750 % CK Hutchison Finance II 16/03 10 24 (XS1497312295)	EUR	1 010			% 97,4470	984 214,70	0,54

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

Dénomination des titres		Unité ou devise en milliers	Quantité	Achats / entrées pendant la période	Ventes / sorties sous revue	Cours	Valeur boursière en EUR	Part en % de l'actif du fonds	
0,0000	% Comcast 21/14 09 26 (XS2385397901)	EUR	970			%	92,3330	895 630,10	0,49
0,8750	% Commerzbank 20/22 01 27 MTN (DE000CZ45VM4)	EUR	2 000			%	93,0320	1 860 640,00	1,03
3,8750	% COTY 21/15 04 26 Reg S (XS2354326410) . . .	EUR	900			%	100,0780	900 702,00	0,50
4,0000	% Crédit Agricole 22/12 10 2026 MTN (FR001400D0Y0)	EUR	900			%	100,8910	908 019,00	0,50
2,8750	% Crown European Holdings 18/01 02 26 Reg S (XS1758723883)	EUR	820			%	98,3900	806 798,00	0,44
4,6250	% Cullinan Holdco 21/15 10 26 Reg S (XS2397354528)	EUR	940			%	78,2430	735 484,20	0,41
1,3750	% Danske Bank 22/17 02 27 MTN (XS2443438051)	EUR	2 350			%	95,3460	2 240 631,00	1,23
1,6250	% Deutsche Bank 20/20 01 27 MTN (DE000DL19U23)	EUR	2 000			%	94,0380	1 880 760,00	1,04
0,7500	% Deutsche Bank 21/17 02 27 MTN (DE000DL19VT2)	EUR	1 000			%	93,4500	934 500,00	0,51
3,0000	% Deutsche Lufthansa 20/29 05 26 MTN (XS2265369657)	EUR	1 500			%	97,6080	1 464 120,00	0,81
1,9000	% Discovery Communications 15/19 03 27 (XS1117298247)	EUR	2 130			%	95,2630	2 029 101,90	1,12
3,0000	% Dometic Group 19/05 08 26 MTN (XS1991114858)	EUR	740			%	98,6060	729 684,40	0,40
3,3750	% doValue 21/31 07 26 Reg S (XS2367103780) . .	EUR	910			%	90,4330	822 940,30	0,45
2,3750	% DP World 18/25 09 26 Reg S MTN (XS1883878966)	EUR	1 900			%	96,1730	1 827 287,00	1,01
0,8750	% DS Smith 19/12 09 26 MTN (XS205177873)	EUR	2 050			%	93,4470	1 915 663,50	1,06
2,0000	% Dufry One 19/15 02 27 (XS2079388828)	EUR	990			%	93,8370	928 986,30	0,51
3,0000	% EC Finance 21/15 10 26 Reg S (XS2389984175)	EUR	890	150		%	96,6820	860 469,80	0,47
0,3750	% EDP Finance 19/16 09 26 MTN (XS2053052895)	EUR	960			%	93,2890	895 574,40	0,49
2,6250	% eircom Finance 19/15 02 27 (XS2074522975) .	EUR	860			%	94,4310	812 106,60	0,45
3,8750	% Electricité de France 22/12 01 2027 MTN (FR001400D6M2)	EUR	1 700			%	102,0720	1 735 224,00	0,96
3,7500	% Elior Group 21/15 07 26 (XS2360381730)	EUR	920			%	92,8710	854 413,20	0,47
2,8750	% Elis 18/15 02 26 MTN (FR0013318102)	EUR	1 200	200		%	98,5920	1 183 104,00	0,65
2,8750	% ELO 20/29 01 26 MTN (FR0013510179)	EUR	900			%	97,4040	876 636,00	0,48
2,1250	% Energa Finance 17/07 03 27 MTN (XS1575640054)	EUR	2 200			%	95,2070	2 094 554,00	1,15
0,0000	% ENGIE 19/04 03 27 MTN (FR0013444775)	EUR	1 000			%	91,0010	910 010,00	0,50
1,5000	% ENI 16/17 01 27 MTN (XS1551068676)	EUR	920			%	95,6570	880 044,40	0,48
3,6250	% ENI 23/19 05 2027 MTN (XS2623957078) . . .	EUR	610			%	101,6810	620 254,10	0,34
1,6980	% EP Infrastructure 19/30 07 26 (XS2034622048)	EUR	2 500			%	89,8730	2 246 825,00	1,24
0,2500	% Equinix 21/15 03 27 (XS2304340263)	EUR	1 390			%	91,1150	1 266 498,50	0,70
0,7500	% Equinor 16/09 11 26 MTN (XS1515222385)	EUR	940			%	94,3030	886 448,20	0,49
1,6250	% FedEx 16/11 01 2027 (XS1319820541)	EUR	1 330			%	95,8160	1 274 352,80	0,70
1,7500	% Fluvius System Operator 14/04 12 26 MTN (BE0002481563)	EUR	1 300			%	96,8760	1 259 388,00	0,69
2,3860	% Ford Motor Credit 19/17 02 26 MTN (XS2013574384)	EUR	1 040			%	97,3520	1 012 460,80	0,56
7,2500	% Forvia 22/15 06 2026 (XS2553825949)	EUR	870			%	106,2570	924 435,90	0,51
3,6250	% Gruenenthal 21/15 11 26 Reg S (XS2337064856)	EUR	830			%	98,8415	820 384,45	0,45
0,5000	% HELLA 19/26 01 27 (XS2047479469)	EUR	1 570			%	91,2350	1 432 389,50	0,79
1,0000	% Hemso Fastighets 16/09 09 26 MTN (XS1488494987)	EUR	1 370			%	92,7890	1 271 209,30	0,70
3,2500	% HORNBAACH Baumarkt 19/25 10 26 (DE000A255DH9)	EUR	800			%	95,6180	764 944,00	0,42
3,7500	% IHO Verwaltungs 16/15 09 26 Reg S (XS1490159495)	EUR	950			%	98,9550	940 072,50	0,52
5,1250	% Iliad 21/15 10 26 Reg S (XS2397781357)	EUR	820			%	99,9470	819 565,40	0,45
1,5000	% Imerys 17/15 01 27 MTN (FR0013231768)	EUR	2 300			%	93,8160	2 157 768,00	1,19
2,8750	% INEOS Finance 19/01 05 26 Reg S (XS1843437549)	EUR	1 000			%	97,3540	973 540,00	0,54
1,2500	% ING Group 22/16 02 27 (XS2443920249)	EUR	2 000			%	95,1860	1 903 720,00	1,05
1,8000	% International Flavors & Fragrances 18/25 09 26 (XS1843459782)	EUR	1 240			%	95,1180	1 179 463,20	0,65
1,7500	% IQVIA 21/15 03 26 Reg S (XS2305742434)	EUR	1 050		500	%	96,4070	1 012 273,50	0,56
6,8750	% Jaguar Land Rover Automotive 19/15 11 26 Reg S (XS2010037682)	EUR	820			%	107,0890	878 129,80	0,48
3,6250	% James Hardie International Fin 18/01 10 26 Reg S (XS1888221261)	EUR	920			%	98,4550	905 786,00	0,50
1,0900	% JPMorgan Chase & Co. 19/11 03. 27 MTN (XS1960248919)	EUR	950			%	95,0900	903 355,00	0,50
0,0500	% Jyske Bank 21/02 09 26 MTN (XS2382849888)	EUR	2 160			%	93,9970	2 030 335,20	1,12

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

Dénomination des titres	Unité ou devise en milliers	Quantité	Achats / entrées pendant la période	Ventes / sorties sous revue	Cours	Valeur boursière en EUR	Part en % de l'actif du fonds
0,2500 % KBC Groep 21/01 03 27 MTN (BE0002832138)	EUR	1000			% 93,6000	936 000,00	0,52
2,2500 % Kinder Morgan 15/16 03 27 (XS1196817586) ..	EUR	2 010			% 96,1720	1 933 057,20	1,06
1,0000 % La Banque Postale 17/16 10 24 MTN (FR0013286838)	EUR	900			% 97,8490	880 641,00	0,49
0,6250 % La Poste 20/21 10 26 MTN (FR0013508686) ..	EUR	1000			% 93,7190	937 190,00	0,52
1,5000 % Logisor Financing 20/13 07 26 MTN (XS2200175839)	EUR	1010			% 93,7970	947 349,70	0,52
0,6250 % Logisor Financing 22/17 11 25 MTN (XS2431318711)	EUR	1000			% 93,3450	933 450,00	0,51
4,5000 % Loxam 22/15 02 27 Reg S (XS2401886788) ..	EUR	890	150		% 100,0540	890 480,60	0,49
0,8750 % LYB International Finance II 19/17 09 26 (XS2052310054)	EUR	2 350			% 93,7560	2 203 266,00	1,21
0,6250 % Macquarie Group 20/03 02 27 MTN (XS2105735935)	EUR	990			% 91,9330	910 136,70	0,50
1,3490 % Marsh & McLennan Cos. 19/21 09 26 (XS1963836892)	EUR	1330			% 95,8830	1 275 243,90	0,70
3,1250 % Matterhorn Telecom 19/15 09 26 Reg S (XS2052290439)	EUR	950			% 97,0980	922 431,00	0,51
3,0000 % Mercedes-Benz Fin. Canada 22/23 02 2027 MTN (DE000A3LBMV2)	EUR	400		480	% 100,2150	400 860,00	0,22
1,6310 % Mizuho Financial Group 22/08 04 2027 MTN (XS2465984107)	EUR	950			% 94,8070	900 666,50	0,50
0,0000 % Mondelez Int. Holding Nederland 20/22 09 26 Reg S (XS2235986929)	EUR	550		430	% 92,6070	509 338,50	0,28
1,6250 % Mondelez International 15/08 03 27 (XS1197270819)	EUR	930			% 95,7050	890 056,50	0,49
2,2500 % Mytilineos 21/30 10 26 (XS2337604479)	EUR	530			% 95,7850	507 660,50	0,28
1,3750 % Naturgy Finance 17/19 01 27 MTN (XS1551446880)	EUR	900			% 94,9230	854 307,00	0,47
1,3750 % NatWest Markets 22/02 03 27 MTN (XS2449911143)	EUR	1270			% 94,2100	1 196 467,00	0,66
3,6250 % Netflix 17/15 05 27 Reg S (XS1821883102)	EUR	880		800	% 101,3780	892 126,40	0,49
1,6250 % Nexi Spa 21/30 04 2026 (XS2332589972)	EUR	1460			% 94,9960	1 386 941,60	0,76
7,5000 % Nidda Healthcare Holding 22/21 08 2026 Reg S (XS2550063478)	EUR	790			% 103,1360	814 774,40	0,45
0,0000 % Orange 19/04 09 26 MTN (FR0013444676) ..	EUR	600		400	% 92,7770	556 662,00	0,31
4,6250 % PLT VII Finance 20/05 01 26 Reg S (XS2200172653)	EUR	700			% 99,6330	697 431,00	0,38
1,4000 % PPG Industries 15/13 03 27 (XS1202213291) ..	EUR	1630			% 94,3940	1 538 622,20	0,85
1,2070 % Prosus 22/19 01 26 Reg S (XS2430287529) ..	EUR	970			% 94,2790	914 506,30	0,50
0,3750 % Raiffeisen Bank International 19/25 09 26 MTN (XS2055627538)	EUR	2 300			% 91,5430	2 105 489,00	1,16
1,1250 % RCI Banque 20/15 01 27 MTN (FR0013476090)	EUR	1810			% 93,7410	1 696 712,10	0,93
4,2500 % SECURITAS 23/04 04 2027 MTN (XS2607381436)	EUR	2 060			% 102,0060	2 101 323,60	1,16
4,0000 % Siemens Energy 23/05 04 2026 (XS2601458602)	EUR	1400			% 98,8730	1 384 222,00	0,76
5,2500 % Sig 21/30 11 26 Reg S (XS2404291010)	EUR	970			% 90,5750	878 577,50	0,48
3,3750 % Snam 22/05 12 2026 MTN (XS2562879192) ..	EUR	1460			% 100,8880	1 472 964,80	0,81
0,7500 % Société Générale 20/25 01 27 MTN (FR0013479276)	EUR	2 200	200		% 92,0940	2 026 068,00	1,12
2,6250 % Spie 19/18 06 26 (FR0013426376)	EUR	1500			% 97,8700	1 468 050,00	0,81
0,6250 % Stellantis 21/30 03 27 MTN (XS2325733413) ..	EUR	970			% 92,2740	895 057,80	0,49
2,2500 % Styrolution Group 20/16 01 27 Reg S (XS2108560306)	EUR	880			% 92,5150	814 132,00	0,45
5,7500 % Summer BC Holdco B 19/31 10 26 Reg S (XS2067263850)	EUR	860			% 95,9730	825 367,80	0,45
3,6250 % Telecom Italia 16/25 05 26 MTN (XS1419869885)	EUR	1100			% 98,5360	1 083 896,00	0,60
0,5000 % The Dow Chemical 20/15 03 27 (XS2122485845)	EUR	1290			% 91,7300	1 183 317,00	0,65
0,5000 % Toronto-Dominion Bank 22/18 01 27 MTN (XS2432502008)	EUR	1000			% 92,7050	927 050,00	0,51
0,1250 % TRATON Finance Luxembourg 21/10 11 24 MTN (DE000A3KYMA6)	EUR	1700			% 96,6700	1 643 390,00	0,91
4,1250 % TRATON Finance Luxembourg 22/22 11 2025 MTN (DE000A3LBGG1)	EUR	1000			% 100,8760	1 008 760,00	0,56
0,2500 % UBS Group 21/03 11 26 (CH1142231682)	EUR	2 280			% 93,8700	2 140 236,00	1,18
3,2500 % Verisure Holding 21/15 02 27 Reg S (XS2289588837)	EUR	920			% 96,3020	885 978,40	0,49
1,3750 % Verizon Communications 17/27 10 26 (XS1708161291)	EUR	1420			% 95,7690	1 359 919,80	0,75
2,0000 % Vesteda Finance 18/10 07 26 MTN (XS1854166078)	EUR	1700			% 96,2210	1 635 757,00	0,90

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

Dénomination des titres	Unité ou devise en milliers	Quantité	Achats / entrées pendant la période sous revue	Ventes / sorties pendant la période sous revue	Cours	Valeur boursière en EUR	Part en % de l'actif du fonds
0,3750 % Vitterra Finance 21/24 09 25 MTN (XS2389688107)	EUR	950			% 94,4200	896 990,00	0,49
2,5000 % Volkswagen Bank 19/31 07 26 MTN (XS1944390597)	EUR	2 200			% 97,5340	2 145 748,00	1,18
2,2500 % Volkswagen Financial Services 18/16 10 26 MTN (XS1893631769)	EUR	890			% 97,7490	869 966,10	0,48
3,8750 % Webulid 22/28 07 26 (XS2437324333)	EUR	800	240		% 98,3940	787 152,00	0,43
1,3750 % Wells Fargo & Co. 16/26 10 26 MTN (XS1400169931)	EUR	1940			% 94,4930	1 833 164,20	1,01
2,5000 % Wendel 15/09 02 27 (FR0012516417)	EUR	900			% 96,7930	871 137,00	0,48
0,5000 % Werfen 21/28 10 2026 (XS2392462730)	EUR	1800			% 91,9690	1 655 442,00	0,91
2,2500 % WPP Finance 14/22 09 26 MTN (XS1121013666)	EUR	890			% 98,0460	872 609,40	0,48
5,7500 % ZF Finance 23/03 08 2026 MTN (XS2582404724)	EUR	1 400			% 103,4410	1 448 174,00	0,80
Total du portefeuille-titres						179 741 015,65	99,02
Avoirs bancaires						151 772,34	0,08
Dépositaire (à échéance quotidienne)							
Avoirs en euro	EUR	151 772,34			% 100	151 772,34	0,08
Autres éléments d'actif						1 749 157,47	0,96
Intérêts à recevoir	EUR	1 749 157,47			% 100	1 749 157,47	0,96
Total des éléments d'actif ¹⁾						181 641 945,46	100,07
Autres engagements						-123 741,19	-0,06
Engagements découlant des coûts	EUR	-101 551,16			% 100	-101 551,16	-0,05
Autres engagements divers	EUR	-22 190,03			% 100	-22 190,03	-0,01
Actif du fonds						181 518 204,27	100,00

Valeur liquidative et nombre d'actions en circulation	Unité ou devise	Valeur liquidative dans la devise correspondante
Valeur liquidative		
Classe LD	EUR	102,25
Nombre d'actions en circulation		
Classe LD	Unité	1 775 272,000

De faibles différences ont pu apparaître car les pourcentages sont arrondis lors du calcul.

Un état des transactions conclues au cours de la période sous revue, dès lors qu'elles n'apparaissent plus dans l'état du portefeuille-titres, est disponible gratuitement sur demande auprès de la société de gestion.

Explications sur l'évaluation

Le conseil d'administration de la SICAV, par le biais de la société de gestion, détermine les valeurs liquidatives et effectue l'évaluation des actifs du fonds. La fourniture de base des cours ainsi que la validation des cours s'effectuent selon les processus introduits par le conseil d'administration de la SICAV sur la base des principes définis par les prescriptions / dispositions légales, ou figurant dans le prospectus de la SICAV, concernant les méthodes d'évaluation.

En cas d'absence de cours de vente, sont utilisés pour déterminer le cours, des modèles d'évaluation (valeurs marchandes déduites) convenus entre la State Street Bank International GmbH, filiale du Luxembourg, en tant que Price Service Provider et la société de gestion et s'appuyant dans la mesure du possible sur les paramètres du marché. Cette méthode est soumise à un processus de contrôle permanent. Les informations sur les cours fournies par des tiers sont contrôlées quant à leur plausibilité par d'autres sources sur les prix, par des calculs modèles ou au moyen d'autres procédures adéquates.

Les placements indiqués dans le présent rapport ne sont pas évalués à des valeurs marchandes déduites.

Notes

1) Ne contient aucune position négative.

DWS Fixed Maturity SICAV – 31 décembre 2023

Composition de l'actif du fonds (en euro)

	DWS Fixed Maturity SICAV Consolidé	DWS Fixed Maturity Corporate Bonds 2024	DWS Fixed Maturity Corporate Bonds 2025
Portefeuille-titres	611 053 792,91	3 786 874,60	12 655 552,60
Dérivés sur indices boursiers	274 101,21	-	-
Dérivés sur taux d'intérêt	- 55 385,00	-	-
Dérivés sur devises	270 649,04	-	-
Swaps	4 326 561,67	14 287,00	411 810,04
Avoirs bancaires	4 981 020,18	103 048,36	110 862,02
Autres éléments d'actif	5 218 497,13	58 885,61	154 010,85
Total des éléments d'actif ¹⁾	626 842 883,00	3 963 095,57	13 332 235,51
Engagements découlant d'emprunts	- 549 639,75	-	-
Autres engagements	- 328 096,39	- 1 739,82	- 5 943,66
= Actif du fonds	625 191 501,00	3 961 355,75	13 326 291,85

Composition de l'actif du fonds (en euro)

	DWS Fixed Maturity FlexInvest Income 2025	DWS Fixed Maturity Multi Asset 2026	DWS Fixed Maturity Multi Asset 2026 II
Portefeuille-titres	6 320 349,38	19 402 593,53	8 793 156,68
Dérivés sur indices boursiers	-	-	-
Dérivés sur taux d'intérêt	-	-	-
Dérivés sur devises	-	-	-
Swaps	-	226 855,50	269 780,93
Avoirs bancaires	69 190,05	62 135,21	34 155,77
Autres éléments d'actif	56 813,50	119 925,88	37 804,59
Total des éléments d'actif ¹⁾	6 446 352,93	19 811 510,12	9 134 897,97
Engagements découlant d'emprunts	-	- 0,24	- 0,12
Autres engagements	- 3 558,87	- 7 795,38	- 3 431,27
= Actif du fonds	6 442 794,06	19 803 714,50	9 131 466,58

Composition de l'actif du fonds (en euro)

	DWS Fixed Maturity High Yield Bonds 2025	DWS Fixed Maturity Multi Asset 2027 II	DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026
Portefeuille-titres	12 772 482,60	30 419 613,99	179 741 015,65
Dérivés sur indices boursiers	-	-	-
Dérivés sur taux d'intérêt	-	-	-
Dérivés sur devises	1 361,76	-	-
Swaps	651 206,03	-	-
Avoirs bancaires	334 219,33	2 946,93	151 772,34
Autres éléments d'actif	238 351,64	577 389,15	1 749 157,47
Total des éléments d'actif ¹⁾	13 997 621,36	30 999 950,07	181 641 945,46
Engagements découlant d'emprunts	-	- 84 111,63	-
Autres engagements	- 5 632,89	- 14 346,55	- 123 741,19
= Actif du fonds	13 991 988,47	30 901 491,89	181 518 204,27

¹⁾ Ne contient aucune position négative.

DWS Fixed Maturity Global Bonds Dynamic Plus 2024 II	DWS Fixed Maturity Multi Asset 2024	DWS Fixed Maturity Global Bonds Dynamic Plus 2024	DWS Fixed Maturity Multi Asset 2025	DWS Fixed Maturity Multi Asset 2025 II
23 202 493,24	72 484 480,68	6 951 785,95	55 826 106,26	6 706 390,54
-	274 101,21	-	-	-
- 42 365,00	-	- 13 020,00	-	-
59 660,40	112 909,11	18 251,53	69 662,31	-
-	421 248,12	-	438 383,45	174 603,36
1 221 393,60	990 635,81	417 405,21	42 366,99	19 658,53
36 528,89	36 249,15	11 435,87	203 043,89	8 932,68
24 521 296,03	74 655 843,38	7 398 878,56	56 626 292,39	6 909 585,11
-	- 218 572,93	-	- 246 951,52	- 2,95
- 7 913,27	- 26 529,77	- 3 135,89	- 20 434,01	- 4 666,43
24 469 797,86	74 074 521,38	7 382 722,67	56 312 177,37	6 904 915,73

DWS Fixed Maturity Multi Asset 2027	DWS Fixed Maturity Multi Bonds EUR 2026	DWS Fixed Maturity High Yield Bonds 2024	DWS Fixed Maturity Multi Asset 2026 III	DWS Fixed Maturity ESG Multi Asset Defensive 2026
27 475 216,56	15 801 681,91	20 722 268,07	11 436 507,10	29 501 877,63
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	8 683,82	-	120,11
202 867,24	1 515 520,00	-	-	-
189 416,49	46 723,73	169 898,69	6 306,85	683 786,35
156 582,93	143 146,13	304 076,38	148 697,52	438 934,30
28 024 083,22	17 828 500,39	21 204 926,96	11 591 511,47	30 637 381,94
- 0,36	-	-	-	-
- 11 462,16	- 7 178,53	- 8 590,96	- 5 156,75	- 20 712,78
28 012 620,70	17 499 893,24	21 196 336,00	11 586 354,72	30 604 005,61

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2027
67 053 345,94
-
-
-
-
325 097,92
738 530,70
68 116 974,56
-
- 46 126,21
68 070 848,35

DWS Fixed Maturity Diversified Bonds 2026

Données en vertu du règlement européen (UE) 2015/2365 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement européen (UE) 648/2012 – Carte d'identification conformément aux dispositions de l'article A

Au cours de la période sous revue, aucune opération de financement sur titres conformément au règlement susmentionné n'a été effectuée.

Société d'investissement

DWS Fixed Maturity SICAV
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxembourg, Luxembourg
RC B 180 758

Conseil d'administration de la société d'investissement

Niklas Seifert
Président
DWS Investment S.A.,
Luxembourg

Stefan Kreuzkamp (depuis le 25 octobre 2023)
Trier

Sven Sendmeyer
DWS Investment GmbH,
Frankfurt / Main

Thilo Hubertus Wendenburg
Membre indépendant
Frankfurt / Main

Elena Wichmann
DWS Investment S.A.,
Luxembourg

Société de gestion, administration centrale, agent de transfert, agent de registre et distributeur principal

DWS Investment S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxembourg, Luxembourg
Fonds propres au 31 décembre 2022 :
365,1 millions d'euros
avant affectation du bénéfice

Conseil de surveillance de la société de gestion

Manfred Bauer
Président
DWS Investment GmbH,
Frankfurt / Main

Dr. Matthias Liermann
DWS Investment GmbH,
Frankfurt / Main

Holger Naumann
DWS Group GmbH & Co. KGaA,
Frankfurt / Main

Claire Peel (jusqu'au 31 juillet 2023)
Frankfurt / Main

Frank Rückbrodt
Deutsche Bank Luxembourg S.A.,
Luxembourg

Directoire de la société de gestion

Nathalie Bausch
Présidente
DWS Investment S.A.,
Luxembourg

Leif Bjurström
DWS Investment S.A.,
Luxembourg

Dr. Stefan Junglen
DWS Investment S.A.,
Luxembourg

Barbara Schots (jusqu'au 21 mars 2023)
DWS Investment S.A.,
Luxembourg

Michael Mohr (depuis le 21 mars 2023)
DWS Investment S.A.,
Luxembourg

Commissaire aux comptes

KPMG Audit S.à r.l.
39, Avenue John F. Kennedy
1855 Luxembourg, Luxembourg

Gérant de portefeuille

DWS Investment GmbH
Mainzer Landstraße 11-17
60329 Frankfurt / Main, Allemagne

Dépositaire

State Street Bank International GmbH
filiale du Luxembourg
49, Avenue John F. Kennedy
1855 Luxembourg, Luxembourg

Organisme distributeur, agent payeur et bureau d'information*

LUXEMBOURG
Deutsche Bank Luxembourg S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxembourg, Luxembourg

* Concernant les autres distributeurs et agents payeurs, se reporter au prospectus de vente.

Situation au : 1^{er} janvier 2024

DWS Fixed Maturity SICAV

2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxembourg, Luxembourg
RC B 180 758
Tél. : +352 4 21 01-1
Fax : +352 4 21 01-9 00