



DWS Investment S.A.

DWS Vorsorge

Halbjahresbericht 2011

- DWS Vorsorge Dachfonds
- DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

Fonds Luxemburger Rechts

Zusätzliche Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Verkaufsprospekt, Verwaltungsreglement, „Wesentliche Anlegerinformationen“, Halbjahres- und Jahresberichte, Ausgabe- und Rücknahmepreise sind kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft sowie den Zahl- und Informationsstellen erhältlich.

Rücknahme- und Umtauschanträge können bei den deutschen Zahlstellen eingereicht werden. Sämtliche Zahlungen (Rücknahmeerlöse, etwaige Ausschüttungen und sonstige Zahlungen) werden durch die deutschen Zahlstellen an die Anleger ausgezahlt.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile werden im Internet unter www.dws.de veröffentlicht. Etwaige Mitteilungen an die Anteilinhaber werden im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlicht.

Vertriebs-, Zahl- und Informationsstellen für Deutschland sind:

Deutsche Bank AG
Taunusanlage 12
D-60325 Frankfurt am Main
und deren Filialen

Deutsche Bank Privat- und Geschäftskunden AG
Theodor-Heuss-Allee 72
D-60486 Frankfurt am Main
und deren Filialen

Widerrufsrecht gemäß § 126 InvG:

Erfolgt der Kauf von Investmentanteilen durch mündliche Verhandlungen außerhalb der ständigen Geschäftsräume desjenigen, der die Anteile verkauft oder den Verkauf vermittelt hat, so kann der Käufer seine Erklärung über den Kauf binnen einer Frist von zwei Wochen der ausländischen Investmentgesellschaft gegenüber schriftlich widerrufen (Widerrufsrecht); dies gilt auch dann, wenn derjenige, der die Anteile verkauft oder den Verkauf vermittelt, keine ständigen Geschäftsräume hat. Handelt es sich um ein Fernabsatzgeschäft i. S. d. § 312b des Bürgerlichen Gesetzbuchs, so ist bei einem Erwerb von Finanzdienstleistungen, deren Preis auf dem Finanzmarkt Schwankungen unterliegt (§ 312d Abs. 4 Nr. 6 BGB), ein Widerruf ausgeschlossen. Zur Wahrung der Frist genügt die rechtzeitige Absendung der Widerrufserklärung. Der Widerruf ist gegenüber der DWS Investment S.A., 2, Boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxemburg, schriftlich unter Angabe der Person des Erklärenden einschließlich dessen Unterschrift zu erklären, wobei eine Begründung nicht erforderlich ist. Die Widerrufsfrist beginnt erst zu laufen, wenn die Durchschrift des Antrags auf Vertragsabschluss dem Käufer ausgehändigt oder ihm eine Kaufabrechnung übersandt worden ist und darin eine Belehrung über das Widerrufsrecht wie die vorliegende enthalten ist. Ist der Fristbeginn streitig, trifft die Beweislast den Verkäufer. Das Recht zum Widerruf besteht nicht, wenn der Verkäufer nachweist, dass entweder der Käufer die Anteile im Rahmen seines Gewerbebetriebes erworben hat oder er den Käufer zu den Verhandlungen, die zum Verkauf der Anteile geführt haben, auf Grund vorhergehender Bestellung gemäß § 55 Abs. 1 der Gewerbeordnung aufgesucht hat. Ist der Widerruf erfolgt und hat der Käufer bereits Zahlungen geleistet, so ist die ausländische Investmentgesellschaft verpflichtet, dem Käufer, gegebenenfalls Zug um Zug gegen Rückübertragung der erworbenen Anteile, die bezahlten Kosten und einen Betrag ausuzahlen, der dem Wert der bezahlten Anteile am Tage nach dem Eingang der Widerrufserklärung entspricht. Auf das Recht zum Widerruf kann nicht verzichtet werden.

Inhalt

Halbjahresbericht 2011
vom 1.1.2011 bis 30.6.2011

Hinweise 2



Halbjahresbericht DWS Vorsorge

DWS Vorsorge Dachfonds	4
DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y	5
DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y	6
DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y	7
DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y	8
DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y	9
DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration	10



Vermögensaufstellungen zum Halbjahresbericht 12

Hinweise

Die in diesem Bericht genannten Fonds sind Teilfonds eines Umbrella-fonds nach Luxemburger Recht.

Wertentwicklung

Der Erfolg einer Investmentfondsanlage wird an der Wertentwicklung der Anteile gemessen. Als Basis für die Werteberechnung werden die Anteilwerte (=Rücknahmepreise) herangezogen, unter Hinzurechnung zwischenzeitlicher Ausschüttungen, die z. B. im Rahmen der Investmentkonten bei der DWS kostenfrei reinvestiert werden. Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognosen für die Zukunft.

Darüber hinaus sind in den Berichten auch die entsprechenden Vergleichsindizes – soweit vorhanden – dargestellt. Alle Grafik- und Zahlenangaben geben den **Stand vom 30. Juni 2011** wieder.

Verkaufsprospekte

Der Kauf von Fondsanteilen erfolgt auf Grundlage des zzt. gültigen vereinfachten bzw. vollständigen Verkaufsprospekts*, ergänzt durch den jeweiligen letzten geprüften Jahresbericht und zusätzlich durch den jeweiligen Halbjahresbericht, falls ein solcher jüngeren Datums als der letzte Jahresbericht vorliegt.

Ausgabe- und Rücknahmepreise

Die jeweils gültigen Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie alle sonstigen Informationen für die Anteilinhaber können jederzeit am Sitz der Verwaltungsgesellschaft sowie bei den Zahlstellen erfragt werden. Darüber hinaus werden die Ausgabe- und Rücknahmepreise in jedem Vertriebsland in geeigneten Medien (z. B. Internet, elektronische Informationssysteme, Zeitungen, etc.) veröffentlicht.

* (ab dem 1.7.2011 wird der „Vereinfachte Verkaufsprospekt“ durch das Dokument „Wesentliche Anlegerinformationen“ (auch sog. „Key Investor Information Document“) ersetzt)

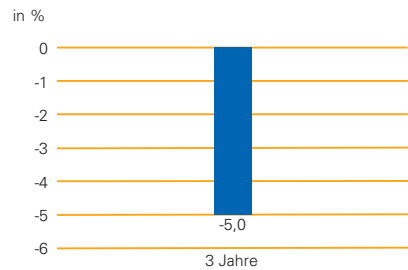
Die Teilfonds DWS Vorsorge Dachfonds Plus, DWS Vorsorge Dachfonds Balance und DWS Vorsorge Dachfonds Balance Plus wurden bislang noch nicht aufgelegt. Weitere Informationen zu den Teilfonds sind den Angaben im vollständigen Verkaufsprospekt zu entnehmen.

2011

Halbjahresbericht

DWS Vorsorge Dachfonds

DWS VORSORGE DACHFONDS Wertentwicklung im Überblick



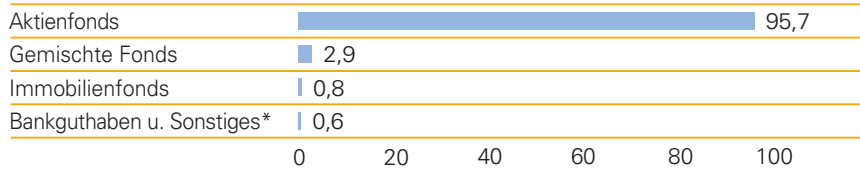
DWS Vorsorge Dachfonds

Angaben auf Euro-Basis

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

Stand: 30.6.2011

DWS VORSORGE DACHFONDS Anlageschwerpunkte

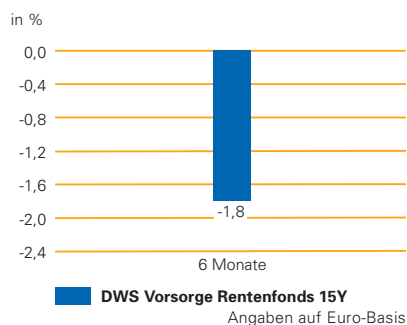


Jeweils Anteil in % des Fondsvermögens

WKN: DWS 001
ISIN: LU0272367581
Stand: 30.6.2011
* inkl. Derivate

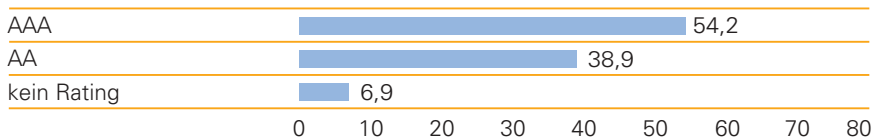
DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

DWS VORSORGE RENTENFONDS 15Y Wertentwicklung im Überblick



Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages.
Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.
Stand: 30.6.2011

DWS VORSORGE RENTENFONDS 15Y Rating-Struktur der Anleihen im Portefeuille*



Jeweils Anteil in % des Anleihevermögens (inkl. anteiliger Stückzinsen)

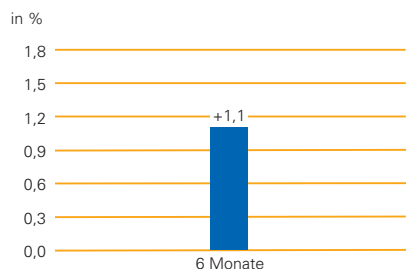
* Mittelwerte überwiegend auf Basis der Ratings von Standard & Poor's, Moody's und Fitch

AAA	Extrem starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	BB bis B	Die Bonität ist entsprechend des höheren Geschäfts- und Finanzrisikos ausreichend. Zins und Tilgung werden in der Regel ohne Beeinträchtigung gezahlt. Das Non-Investment Grade Rating entspricht dem Geschäftsmodell des Unternehmens.
AA	Sehr starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	CCC und schlechter	Das Rating entspricht nicht dem langfristigen Geschäftsmodell des Unternehmens. Zins und Tilgung sind mittel- bis langfristig potentiell beeinträchtigt.
A	Starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung		
BBB	Angemessene Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung. Ungünstige konjunkturelle oder branchenspezifische Verhältnisse könnten zu einer Beeinträchtigung der Rating-Güte führen		

WKN: DWS 002
ISIN: LU0272368126
Stand: 30.6.2011

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

DWS VORSORGE RENTENFONDS 10Y Wertentwicklung im Überblick

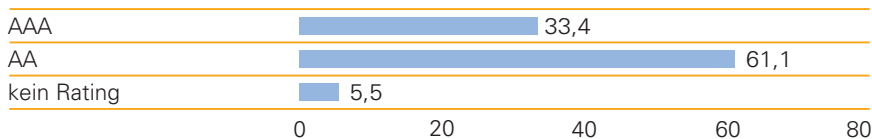


DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y
Angaben auf Euro-Basis

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

Stand: 30.6.2011

DWS VORSORGE RENTENFONDS 10Y Rating-Struktur der Anleihen im Portefeuille*



**Jeweils Anteil in % des Anleihevermögens
(inkl. anteiliger Stückzinsen)**

AAA Extrem starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung
AA Sehr starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung
A Starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung
BBB Angemessene Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung.
Ungünstige konjunkturelle oder branchenspezifische
Verhältnisse könnten zu einer Beeinträchtigung der Rating-
Güte führen

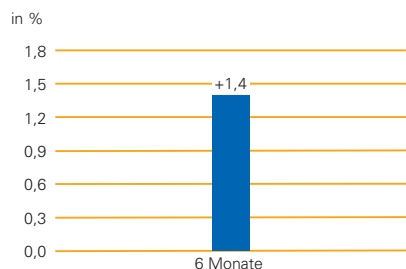
BB bis B Die Bonität ist entsprechend des höheren Geschäfts- und Finanzrisikos ausreichend. Zins und Tilgung werden in der Regel ohne Beeinträchtigung gezahlt. Das Non-Investment Grade Rating entspricht dem Geschäftsmodell des Unternehmens.
CCC und schlechter Das Rating entspricht nicht dem langfristigen Geschäftsmodell des Unternehmens. Zins und Tilgung sind mittel- bis langfristig potentiell beeinträchtigt.

* Mittelwerte überwiegend auf Basis der Ratings von Standard & Poor's, Moody's und Fitch

WKN: DWS 003
ISIN: LU0272368639
Stand: 30.6.2011

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

DWS VORSORGE RENTENFONDS 7Y Wertentwicklung im Überblick



DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

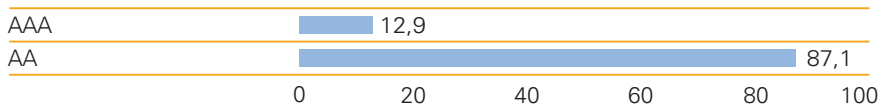
Angaben auf Euro-Basis

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

Stand: 30.6.2011

DWS VORSORGE RENTENFONDS 7Y

Rating-Struktur der Anleihen im Portefeuille*



**Jeweils Anteil in % des Anleihevermögens
(inkl. anteiliger Stückzinsen)**

AAA Extrem starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung
AA Sehr starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung
A Starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung
BBB Angemessene Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung.
Ungünstige konjunkturelle oder branchenspezifische
Verhältnisse könnten zu einer Beeinträchtigung der Rating-
Güte führen

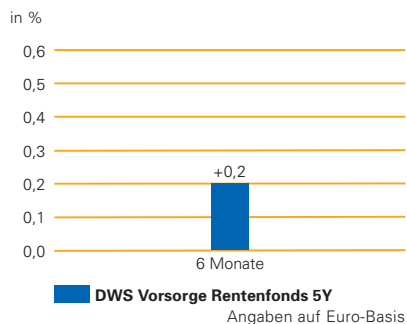
BB bis B Die Bonität ist entsprechend des höheren Geschäfts-
und Finanzrisikos ausreichend. Zins und Tilgung
werden in der Regel ohne Beeinträchtigung gezahlt.
Das Non-Investment Grade Rating entspricht dem
Geschäftsmodell des Unternehmens.
CCC und schlechter Das Rating entspricht nicht dem langfristigen Geschäfts-
modell des Unternehmens. Zins und Tilgung sind mittel-
bis langfristig potentiell beeinträchtigt.

* Mittelwerte überwiegend auf Basis der Ratings
von Standard & Poor's, Moody's und Fitch

WKN: DWS 004
ISIN: LU0272368712
Stand: 30.6.2011

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

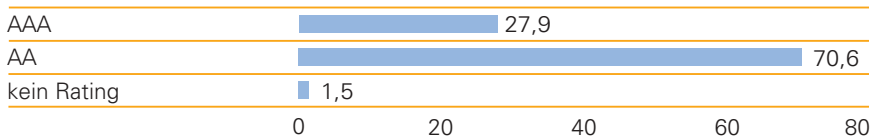
DWS VORSORGE RENTENFONDS 5Y Wertentwicklung im Überblick



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

Stand: 30.6.2011

DWS VORSORGE RENTENFONDS 5Y Rating-Struktur der Anleihen im Portefeuille*



Jeweils Anteil in % des Anleihevermögens (inkl. anteiliger Stückzinsen)

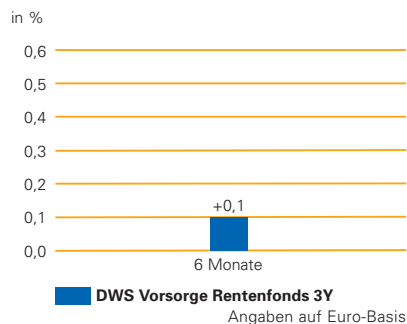
* Mittelwerte überwiegend auf Basis der Ratings von Standard & Poor's, Moody's und Fitch

AAA	Extrem starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	BB	Die Bonität ist entsprechend des höheren Geschäfts- und Finanzrisikos ausreichend. Zins und Tilgung werden in der Regel ohne Beeinträchtigung gezahlt. Das Non-Investment Grade Rating entspricht dem Geschäftsmodell des Unternehmens.
AA	Sehr starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	bis	
A	Starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	B	
BBB	Angemessene Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung. Ungünstige konjunkturelle oder branchenspezifische Verhältnisse könnten zu einer Beeinträchtigung der Rating-Güte führen	CCC	Das Rating entspricht nicht dem langfristigen Geschäftsmodell des Unternehmens. Zins und Tilgung sind mittel-
		und schlechter	bis langfristig potentiell beeinträchtigt.

WKN: DWS 005
ISIN: LU0272369017
Stand: 30.6.2011

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

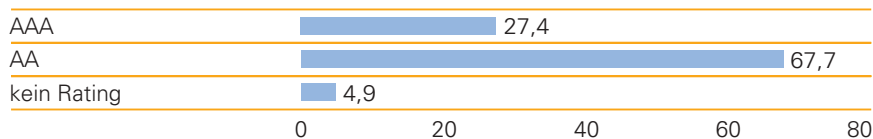
DWS VORSORGE RENTENFONDS 3Y Wertentwicklung im Überblick



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

Stand: 30.6.2011

DWS VORSORGE RENTENFONDS 3Y Rating-Struktur der Anleihen im Portefeuille*



■ Jeweils Anteil in % des Anleihevermögens
(inkl. anteiliger Stückzinsen)

* Mittelwerte überwiegend auf Basis der Ratings von Standard & Poor's, Moody's und Fitch

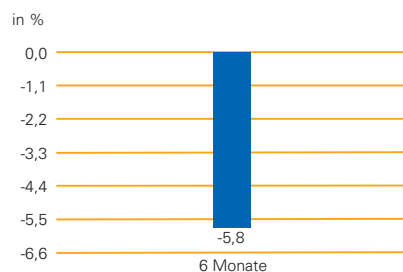
AAA	Extrem starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	BB	Die Bonität ist entsprechend des höheren Geschäfts- und Finanzrisikos ausreichend. Zins und Tilgung werden in der Regel ohne Beeinträchtigung gezahlt.
AA	Sehr starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	B	Das Non-Investment Grade Rating entspricht dem Geschäftsmodell des Unternehmens.
A	Starke Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung	CCC	Das Rating entspricht nicht dem langfristigen Geschäftsmodell des Unternehmens. Zins und Tilgung sind mittel- bis langfristig potentiell beeinträchtigt.
BBB	Angemessene Fähigkeit zur Zahlung von Zinsen und Tilgung. Ungünstige konjunkturelle oder branchenspezifische Verhältnisse könnten zu einer Beeinträchtigung der Rating-Güte führen	und schlechter	

WKN: DWS 0R3
ISIN: LU0359921623
Stand: 30.6.2011

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

DWS VORSORGE RENTENFONDS XL DURATION

Wertentwicklung im Überblick



DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration
Angaben auf Euro-Basis

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

Stand: 30.6.2011



**Vermögensaufstellungen
zum Halbjahresbericht**

DWS Vorsorge Dachfonds

Vermögensaufstellung zum 30.06.2011

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
Investmentanteile						1 399 469 607,66	99,37	
Gruppeneigene Investmentanteile						974 165 441,39	69,17	
db x-trackers - Russell 2000 ETF 1C (LU0322248658) (0,450%)	Stück	973 985	1 011 815	37 830	EUR	73,4400	71 529 458,40	5,08
db x-trackers FTSE EPRA/NAREIT Dev. EU RE. 1C (LU0489337690) (0,400%)	Stück	1 473 552	1 528 861	55 309	EUR	13,9902	20 615 287,19	1,46
db x-trackers S&P 500 ETF 1C USD (LU0490618542) (0,200%)	Stück	1 942 439	2 020 630	78 191	EUR	14,3600	27 893 424,04	1,98
DWS Akkumula (DE0008474024) (1,450%)	Stück	127 483	32 979	46 010	EUR	544,8500	69 459 112,55	4,93
DWS Deutschland (DE0008490962) (1,400%)	Stück	240 289	251 419	11 130	EUR	118,2000	28 402 159,80	2,02
DWS Global Agribusiness FC (EUR) (LU0264452722) (0,750%)	Stück	308 247	75 611	17 332	EUR	135,5600	41 785 963,32	2,97
DWS Global Growth (DE0005152441) (1,450%+)	Stück	458 365	106 428	120 084	EUR	60,8900	27 909 844,85	1,98
DWS Global Value (LU0133414606) (1,450%+)	Stück	1 023 981	249 607	42 635	EUR	135,3400	138 585 588,54	9,84
DWS Intinvest (DE0008474016) (1,450%)	Stück	606 582	212 371	497 706	EUR	114,8300	69 653 811,06	4,95
DWS Invest BRIC Plus FC (LU0210302369) (0,750%)	Stück	197 058	77 211	125 026	EUR	211,5400	41 685 649,32	2,96
DWS Invest Responsibility FC (LU0145644547) (0,750%+)	Stück	68 232	4 779	92 271	EUR	96,5500	6 587 799,60	0,47
DWS Osteuropa (LU0062756647) (1,700%)	Stück	37 846	38 856	1 010	EUR	716,6800	27 123 471,28	1,93
DWS Prospero Fund (LU0455866698) (1,350%)	Stück	66 374	67 400	1 026	EUR	98,9000	6 564 388,60	0,47
DWS Top 50 Asien (DE0009769760) (1,450%)	Stück	691 479	193 113	15 973	EUR	101,3800	70 102 141,02	4,98
DWS Top 50 Europa (DE0009769729) (1,400%)	Stück	522 140	152 894	220 253	EUR	92,9500	48 532 913,00	3,45
DWS Top 50 Welt (DE0009769794) (1,450%)	Stück	772 989	784 555	11 566	EUR	54,1800	41 880 544,02	2,97
DWS Top Dividende (DE0009848119) (1,450%)	Stück	1 732 433	377 070	93 519	EUR	79,6200	137 936 315,46	9,79
DWS Vermögensbildungsfonds I (DE0008476524) (1,450%)	Stück	490 132	124 430	152 514	EUR	85,1400	41 729 838,48	2,96
DWS Zukunftsressourcen (DE0005152466) (1,450%)	Stück	1 141 563	342 521	513 377	EUR	49,2200	56 187 730,86	3,99
Gruppenfremde Investmentanteile						413 412 006,27	29,36	
AXA Aedificandi - I (FR0010201897) (1,000%)	Stück	87 909	89 215	1 306	EUR	303,8400	26 710 270,56	1,90
AXA Rosenb. EATR - Glob. Equity AEUR (IE00B1VJ6602) (0,700%)	Stück	5 954 436	1 529 733	2 822 516	EUR	9,3861	55 888 931,74	3,97
BNP Paribas L1 SICAV - Equity Russia I (Cap.) (LU0269742671) (0,550%)	Stück	481 848	342 074	55 081	EUR	113,6800	54 776 480,64	3,89
Robeco Asia-Pacific Equities (EUR) D (LU0084617165) (1,500%)	Stück	250 051	72 478	76 630	EUR	84,5100	21 131 810,01	1,50
Robeco Capital GF- Robeco Property Equities D EUR (LU0187079180) (1,500%)	Stück	228 914	237 004	8 090	EUR	91,6900	20 989 124,66	1,49
Schroder ISF - Europ. Special Situations C (Acc.) (LU0246036288) (1,000%)	Stück	446 680	201 867	27 389	EUR	107,1800	47 875 162,40	3,40
Schroder ISF SICAV-Gl. Em.Mkt.Opp. C EUR (Acc.) (LU0279459969) (1,000%)	Stück	2 497 169	1 163 114	191 830	EUR	14,0000	34 960 366,00	2,48
Threadneedle - Europ. Smaller Companies Fd 1 (GB0002771383) (1,500%)	Stück	16 653 843	7 459 731	1 063 853	EUR	4,0857	68 042 606,35	4,83
Threadneedle - European Select Fund 1 (GB0002771169) (1,500%)	Stück	8 058 385	2 826 563	12 079 330	EUR	1,7107	13 785 479,22	0,98
Parvest SICAV - Parvest Equity Brazil (LU0265342161) (0,750%)	Stück	224	437	213	USD	176 401,2000	27 273 138,69	1,94
Robeco CGF SICAV - US Large Cap Equities I USD (LU0474363545) (0,650%)	Stück	173 910	181 375	7 465	USD	116,7600	14 015 358,43	1,00
Robeco US Premium Equities (LU0226954369) (0,700%)	Stück	306 157	317 896	11 739	USD	132,3300	27 963 277,57	1,99
Gruppeneigene Immobilien-Investmentanteile						11 892 160,00	0,84	
grundbesitz-global IC (DE000A0NCT95) (0,550%)	Stück	224 000	224 000		EUR	53,0900	11 892 160,00	0,84
Summe Wertpapiervermögen						1 399 469 607,66	99,37	
Derivate								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
Swaps						-753 656,39	-0,05	
Equity-Swaps								
Swap Gap Risk Vorsorge DF (DBK) 30.04.2013 (OTC FFM)	EUR	0,100				-483 967,00	-0,03	
Swap Gap Risk Vorsorge DF (MRL) 06.06.2013 (OTC FFM)	EUR	0,100				-16 531,59	0,00	
Swap Gap Risk Vorsorge DF (MRL) 30.04.2013 (OTC FFM)	EUR	0,100				-253 157,80	-0,02	

DWS Vorsorge Dachfonds

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Bankguthaben						10 437 728,99	0,74
Depotbank (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	8 574 677,15			% 100	8 574 677,15	0,61
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
US Dollar	USD	2 699 226,77			% 100	1 863 051,84	0,13
Sonstige Vermögensgegenstände						6 075,45	0,00
Zinsansprüche	EUR	6 022,75			% 100	6 022,75	0,00
Sonstige Ansprüche	EUR	52,70			% 100	52,70	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-820 929,89			% 100	-820 929,89	-0,06
Fondsvermögen						1 408 338 825,82	100,00
Anteilwert						92,78	
Umlaufende Anteile						15 179 744,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

OTC FFM = Over the Counter Frankfurt

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 30.06.2011

US Dollar USD 1,448820 = EUR 1

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögenswerte des Fondsvermögens sind auf der Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse / Marktsätze bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein. Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeabschläge gezahlt.

DWS Vorsorge Dachfonds

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Investmentanteile			
Gruppenfremde Investmentanteile			
Robeco CGF SICAV - US Large Cap Eq. DH EUR Cap. (LU0510167264) (1,250%)	Stück	22 337	402 580
Robeco US Premium Equities Cl.IH EUR (LU0320897043) (0,700%)	Stück	17 365	323 172
Schroder ISF US Small & Mid-Cap EQ C Acc. EUR (LU0248177502) (1,000%)	Stück	17 368	163 701
BNP Paribas L1 SICAV - Equity Brazil I (Cap.) (LU0377074496) (0,800%)	Stück	605	3 804
DWS (CH) - US Equities (CH0004459506) (1,500%+)	Stück	14 782	129 373

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

Terminkontrakte

Devisenterminkontrakte

Kauf von Devisen auf Termin

USD/EUR EUR 9 313

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

unbefristet Volumen in 1000
EUR 3 786

(Gattung: db x-trackers - Russell 2000 ETF 1C)

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2011

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						143 366 382,41	73,74
Verzinsliche Wertpapiere							
1,3490 % Baden-Württemberg 10/05.01.15 LSA S.91 (DE0001040657)	EUR	7 000	7 000		% 100,0750	7 005 250,00	3,60
1,2690 % Bremen 10/08.07.13 A.172 LSA (DE000A1ELQJ2)	EUR	10 000		5 000	% 99,9535	9 995 350,00	5,14
1,5240 % DekaBank DGZ 04/26.11.15 S.100 IHS MTN (XS0205173445)	EUR	1 000			% 99,2405	992 405,00	0,51
1,4240 % Dexia Kommunalbank 06/23.08.11 E.1459 ÖPF (DE000DXA0Q10)	EUR	500			% 99,9925	499 962,50	0,26
0,0000 % Germany 03/04.07.29 Coupons (DE0001143329)	EUR	475			% 49,7865	236 485,88	0,12
0,0000 % Germany 03/04.07.30 Coupons (DE0001143337)	EUR	475			% 47,4485	225 380,38	0,12
3,7500 % Germany 04/04.01.15 (DE0001135267) 3)	EUR	6 000			% 106,2000	6 372 000,00	3,28
4,2500 % Germany 04/04.07.14 (DE0001135259) 3)	EUR	7 000			% 107,1700	7 501 900,00	3,86
3,5000 % Germany 05/04.01.16 (DE0001135291) 3)	EUR	2 000		10 000	% 105,7100	2 114 200,00	1,09
3,2500 % Germany 05/04.07.15 (DE0001135283) 3)	EUR	8 000			% 104,6500	8 372 000,00	4,31
3,0000 % Germany 10/04.07.20 (DE0001135408) 3)	EUR	16 000	11 000	10 000	% 101,0000	16 160 000,00	8,31
6,2500 % Germany 94/04.01.24 (DE0001134922) 3)	EUR	13 000	10 000	7 000	% 130,4200	16 954 600,00	8,72
0,0000 % Germany 97/04.07.24 Coupons (DE0001143279)	EUR	975			% 63,3705	617 862,38	0,32
0,0000 % Germany 97/04.07.25 Coupons (DE0001143287)	EUR	475			% 60,2405	286 142,38	0,15
0,0000 % Germany 97/04.07.26 Coupons (DE0001143295)	EUR	475			% 57,2495	271 935,13	0,14
0,0000 % Germany 97/04.07.27 Coupons (DE0001143303)	EUR	475			% 54,4175	258 483,13	0,13
0,0000 % Germany 98/04.01.26 Coupons (DE0001142594)	EUR	10 000	10 000		% 58,7145	5 871 450,00	3,02
0,0000 % Germany 98/04.07.28 Coupons (DE0001143311)	EUR	475			% 52,0435	247 206,63	0,13
1,5200 % Hamburgische Landesbank, Guernsey 03/21.12.15 MTN (XS0162446354)	EUR	1 500			% 99,7020	1 495 530,00	0,77
1,2690 % Hessen 08/25.01.12 S.4 LSA (DE000A0EY6Y8)	EUR	500			% 99,9180	499 590,00	0,26
1,4750 % Landesbank Berlin 07/17.08.15 IHS S.333 (DE000LBBOYR5)	EUR	500			% 98,7480	493 740,00	0,25
0,0000 % LB Baden-Württemberg 00/01.12.25 S.201 MTN (XS0121024292)	EUR	3 400			% 53,3620	1 814 308,00	0,93
1,4940 % LB Hessen-Thüringen 04/10.08.11 S.H145 IHS MTN (XS019728883)	EUR	1 000			% 100,0050	1 000 050,00	0,51
1,5850 % L-Bank B-W-Förderbank 10/17.06.14 S.5275 IHS MTN (XS0495939455)	EUR	9 500			% 100,0840	9 507 980,00	4,89
1,2800 % LfA Förderbank Bayern 03/09.07.13 R.250 IHS (DE0002111804)	EUR	1 500			% 99,7240	1 495 860,00	0,77
1,5250 % Norddt. Landesbank 03/29.10.14 IHS S.566 (DE0001450989)	EUR	7 000			% 99,7835	6 984 845,00	3,59
1,2920 % Nordrhein-Westfalen 08/16.01.13 LSA R.836 (DE000NRW11Z0)	EUR	1 000			% 99,8800	998 800,00	0,51
1,4990 % Nordrhein-Westfalen 09/22.10.13 LSA R.973 (DE000NRW2YT2)	EUR	7 600			% 100,1910	7 614 516,00	3,92
1,5830 % Nordrhein-Westfalen 10/09.12.14 IHS S.1091-10 (DE000NRW0BL1)	EUR	15 000	25 000	10 000	% 99,9810	14 997 150,00	7,71
1,4050 % NRW.BANK 06/17.02.14 A.114 IHS (DE000NWB1145)	EUR	1 500			% 99,4500	1 491 750,00	0,77
1,4360 % Sachsen Anhalt 09/28.10.13 A.87 LSA MTN (DE000A0FAH26)	EUR	1 000			% 100,1350	1 001 350,00	0,52
1,4230 % Schleswig-Holstein 11/11.02.14 LSA S.1 (DE000SHFM055)	EUR	10 000	10 000		% 99,8830	9 988 300,00	5,14
Investmentanteile						17 225 311,20	8,86
Gruppeneigene Investmentanteile							
DWS Institutional Money plus (LU0099730524) (0,160%+)	Stück	1 240	2 290	1 050	EUR 13 891,3800	17 225 311,20	8,86
Summe Wertpapiervermögen						160 591 693,61	82,60

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						-3 049 678,20	-1,57
Zinsterminkontrakte							
Euro-Buxl 30Y Future 09/2011 (EURX)	EUR	143 500				-3 049 678,20	-1,57
Bankguthaben						30 836 934,59	15,86
Depotbank (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	30 836 934,59			% 100	30 836 934,59	15,86
Sonstige Vermögensgegenstände						6 177 325,41	3,18
Zinsansprüche	EUR	1 830 214,49			% 100	1 830 214,49	0,94
Einschüsse (Initial Margin)	EUR	4 339 730,00			% 100	4 339 730,00	2,23
Sonstige Ansprüche	EUR	7 380,92			% 100	7 380,92	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						-138 635,56	-0,07
Fondsvermögen						194 417 639,85	100,00
Anteilwert						137,40	
Umlaufende Anteile						1 414 935,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögenswerte des Fondsvermögens sind auf der Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse / Marktsätze bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein. Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeabschläge gezahlt.

Fußnoten

³⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 51 414 700,00.

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------------	--------------------------	-----------------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,0850 % Bayerische Landesbank 04/14.04.11 IHS (XS0190276435)	EUR		1 000
0,0000 % Landesbank Berlin 05/31.05.11 IHS S.329 (DE000LBB0YM6)	EUR		3 500

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: Euro-Buxl 30Y Future 03/2011, Euro-Buxl 30Y Future 06/2011)	EUR	188 226
--	-----	---------

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

unbefristet	EUR	55 364
-------------	-----	--------

(Gattung: 3,5000 % Germany 05/04.01.16, 3,0000 % Germany
10/04.07.20, 6,2500 % Germany 94/04.01.24, 1,5850 % L-Bank
B-W-Förderbank 10/17.06.14 S.5275 IHS MTN)

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2011

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						108 402 109,93	76,94
Verzinsliche Wertpapiere							
1,5530 % Bayerische Landesbank 04/02.12.15 IHS (XS0193266839)	EUR	4 000			% 99,1530	3 966 120,00	2,81
1,5510 % Bayerische Landesbank 04/12.11.15 IHS (XS0197911141)	EUR	3 000			% 99,3730	2 981 190,00	2,12
1,5760 % Bayerische Landesbank 04/15.09.14 IHS (XS0200845708)	EUR	1 000			% 99,4530	994 530,00	0,71
1,1630 % Berlin 08/08.01.13 A.233 LSA (DE000A0STPV4)	EUR	1 000			% 100,0050	1 000 050,00	0,71
1,7760 % Berlin 09/25.06.12 A.279 LSA (DE000A0Z1GR4)	EUR	1 700			% 100,2680	1 704 556,00	1,21
1,2790 % Brandenburg 08/25.01.12 MTN (DE000A0SLW11)	EUR	4 300			% 99,9900	4 299 570,00	3,05
1,2690 % Bremen 10/08.07.13 A.172 LSA (DE000A1ELQJ2)	EUR	13 000			% 99,9535	12 993 955,00	9,22
1,5760 % Erste Abwicklungsanstalt 03/18.11.13 MTN (DE0008079690)	EUR	1 000	1 000		% 99,9530	999 530,00	0,71
1,5050 % Erste Abwicklungsanstalt 05/04.09.12 IHS MTN (DE000VWB2X53)	EUR	200			% 99,6485	199 297,00	0,14
4,2500 % Germany 04/04.07.14 (DE0001135259) ³⁾	EUR	3 500			% 107,1700	3 750 950,00	2,66
3,0000 % Germany 10/04.07.20 (DE0001135408) ³⁾	EUR	10 000	5 000		% 101,0000	10 100 000,00	7,17
2,2500 % Germany 10/04.09.20 (DE0001135416) ³⁾	EUR	10 000			% 94,8500	9 485 000,00	6,73
0,0000 % Germany 97/04.07.21 Coupons (DE0001143246)	EUR	475			% 73,4800	349 030,00	0,25
0,0000 % Germany 97/04.07.22 Coupons (DE0001143253)	EUR	475			% 69,9705	332 359,88	0,24
0,0000 % Germany 97/04.07.23 Coupons (DE0001143261)	EUR	475			% 66,6190	316 440,25	0,22
1,9220 % HSH Nordbank 03/24.06.13 E.10014 IHS (DE0008121864)	EUR	100			% 100,2410	100 241,00	0,07
1,4750 % Landesbank Berlin 07/17.08.15 IHS S.333 (DE000LB0YR5)	EUR	1 000			% 98,7480	987 480,00	0,70
1,5460 % LB Baden-Württemberg 03/03.10.11 S.346 IHS MTN (XS0180854886)	EUR	1 000			% 99,9120	999 120,00	0,71
1,3380 % LB Baden-Württemberg 04/20.10.11 S.911 ÖPF (DE000LBW17C4)	EUR	510			% 99,9930	509 964,30	0,36
1,4940 % LB Hessen-Thüringen 04/10.08.11 S.H145 IHS MTN (XS0197728883)	EUR	500			% 100,0050	500 025,00	0,35
1,5410 % LB Hessen-Thüringen 05/15.06.15 S.H174 IHS MTN (DE000A0EPK33)	EUR	1 300			% 99,2325	1 290 022,50	0,92
1,3990 % LB Hessen-Thüringen 05/24.01.12 S.H157 IHS MTN (XS0209880292)	EUR	600			% 99,9790	599 874,00	0,43
1,5850 % L-Bank B-W-Förderbank 10/17.06.14 S.5275 IHS MTN (XS0495939455)	EUR	2 000			% 100,0840	2 001 680,00	1,42
1,4740 % Niedersachsen 10/23.08.13 LSA S.541 (DE000A1EWF06)	EUR	10 000			% 100,0395	10 003 950,00	7,10
1,5250 % Norddt. Landesbank 03/29.10.14 IHS S.566 (DE0001450989)	EUR	3 000			% 99,7835	2 993 505,00	2,12
1,5840 % Norddt. Landesbank 04/05.03.14 IHS MTN (DE000A0AQM05)	EUR	2 000	2 000		% 99,8150	1 996 300,00	1,42
1,6210 % Norddt. Landesbank 04/15.09.15 IHS S.626 (DE000NLB0WE3)	EUR	2 000			% 98,8010	1 976 020,00	1,40
1,2920 % Nordrhein-Westfalen 08/16.01.13 LSA R.836 (DE000NRW11Z0)	EUR	2 000			% 99,8800	1 997 600,00	1,42
1,4990 % Nordrhein-Westfalen 09/22.10.13 LSA R.973 (DE000NRW2YT2)	EUR	3 000			% 100,1910	3 005 730,00	2,13
1,5830 % Nordrhein-Westfalen 10/09.12.14 IHS S.1091-10 (DE000NRW0BL1)	EUR	9 000	9 000		% 99,9810	8 998 290,00	6,39
1,4175 % NRW.BANK 07/01.08.13 A.151 IHS (DE000NWB1517) ³⁾	EUR	10 000			% 99,7540	9 975 400,00	7,08
1,4360 % Sachsen Anhalt 09/28.10.13 A.87 LSA MTN (DE000A0FAH26)	EUR	1 000			% 100,1350	1 001 350,00	0,71
1,4230 % Schleswig-Holstein 11/11.02.14 LSA S.1 (DE000SHFM055)	EUR	6 000	6 000		% 99,8830	5 992 980,00	4,25
Investmentanteile						11 807 673,00	8,38
Gruppeneigene Investmentanteile						11 807 673,00	8,38
DWS Institutional Money plus (LU0099730524) (0,160%+)	Stück	850	1 000	500	EUR 13 891,3800	11 807 673,00	8,38
Summe Wertpapiervermögen						120 209 782,93	85,32

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						151 160,60	0,11
Zinsterminkontrakte							
Euro-Bund Future 09/2011 (EURX)	EUR	76 700				492 320,00	0,35
Euro-Buxl 30Y Future 09/2011 (EURX)	EUR	15 300				-341 159,40	-0,24
Bankguthaben						19 752 362,90	14,02
Depotbank (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	19 752 362,90			% 100	19 752 362,90	14,02
Sonstige Vermögensgegenstände						881 674,89	0,62
Zinsansprüche	EUR	877 096,78			% 100	877 096,78	0,62
Sonstige Ansprüche	EUR	4 578,11			% 100	4 578,11	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						-101 041,21	-0,07
Fondsvermögen						140 893 940,11	100,00
Anteilwert						137,44	
Umlaufende Anteile						1 025 161,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögenswerte des Fondsvermögens sind auf der Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse / Marktsätze bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein. Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeaufschläge gezahlt.

Fußnoten

³⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 31 796 350,00.

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------------	--------------------------	-----------------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,0850	% Bayerische Landesbank 04/14.04.11 IHS (XS0190276435)	EUR	1 000
1,1410	% HSH Nordbank 01/21.02.11 Ser.23 IHS (DE0002503034)	EUR	1 000
0,0000	% Norddt. Landesbank 05/28.02.11 IHS S.675 (DE000NLB00A3)	EUR	1 110

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: Euro-Bund Future 06/2011, Euro-Buxl 30Y Future 06/2011)	EUR	114 693
--	-----	---------

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

unbefristet	EUR	18 719
-------------	-----	--------

(Gattung: 2,2500 % Germany 10/04.09.20)

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2011

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						36 611 988,38	71,20
Verzinsliche Wertpapiere							
1,2390 % Baden-Württemberg 09/04.01.13 IHS S.90 (DE0001040640)	EUR	900			% 100,0105	900 094,50	1,75
1,5530 % Bayerische Landesbank 04/02.12.15 IHS (XS0193266839)	EUR	2 000			% 99,1530	1 983 060,00	3,86
1,7760 % Berlin 09/25.06.12 A.279 LSA (DE000A0Z1GR4)	EUR	800			% 100,2680	802 144,00	1,56
1,4970 % Brandenburg 10/16.12.13 LSA (DE000A1ELT60)	EUR	1 900	1 900		% 99,9340	1 898 746,00	3,69
1,2690 % Bremen 10/08.07.13 A.172 LSA (DE000A1ELQJ2)	EUR	6 000			% 99,9535	5 997 210,00	11,66
1,8520 % DekaBank DGZ 03/20.06.13 R.DX IHS (DE0003257192)	EUR	500			% 99,8620	499 310,00	0,97
0,0000 % Germany 97/04.07.18 Coupons (DE0001143212)	EUR	475			% 82,9410	393 969,75	0,77
0,0000 % Germany 97/04.07.19 Coupons (DE0001143220)	EUR	475			% 79,8415	379 247,13	0,74
0,0000 % Germany 97/04.07.20 Coupons (DE0001143238)	EUR	475			% 76,9300	365 417,50	0,71
1,9220 % HSH Nordbank 03/24.06.13 E.10014 IHS (DE0008121864)	EUR	500			% 100,2410	501 205,00	0,97
1,5550 % LB Hessen-Thüringen 03/01.12.15 S.H125 IHS MTN (XS0181049205)	EUR	200			% 99,3650	198 730,00	0,39
1,7960 % LB Hessen-Thüringen 03/30.10.13 E.515 IHS (DE0007691552)	EUR	500			% 100,0855	500 427,50	0,97
1,3990 % LB Hessen-Thüringen 05/24.01.12 S.H157 IHS MTN (XS0209880292)	EUR	300			% 99,9790	299 937,00	0,58
1,3770 % LfA Förderbank Bayern 10/15.07.13 IHS S.1087 (DE000LFA0877)	EUR	2 000	2 000		% 99,9990	1 999 980,00	3,89
1,4740 % Niedersachsen 10/23.08.13 LSA S.541 (DE000A1EWF06)	EUR	6 000			% 100,0395	6 002 370,00	11,67
1,5840 % Norddt. Landesbank 04/05.03.14 IHS MTN (DE000A0AQMQ5)	EUR	800	800		% 99,8150	798 520,00	1,55
1,4990 % Nordrhein-Westfalen 09/22.10.13 LSA R.973 (DE000NRW2YT2)	EUR	2 000			% 100,1910	2 003 820,00	3,90
1,4175 % NRW.BANK 07/01.08.13 A.151 IHS (DE000NWB1517)	EUR	5 000			% 99,7540	4 987 700,00	9,70
1,5250 % Sachsen-Anhalt 10/01.02.15 MTN LSA (XS0483585435)	EUR	3 100	3 100		% 100,1750	3 105 425,00	6,04
1,3740 % Schleswig-Holstein 10/08.11.13 LSA (DE000SHFM022)	EUR	3 000			% 99,8225	2 994 675,00	5,82
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						2 995 950,00	5,82
Verzinsliche Wertpapiere							
1,2640 % Berlin 10/24.04.13 LSA A.327 (DE000A1EWH59)	EUR	3 000	3 000		% 99,8650	2 995 950,00	5,82
Investmentanteile						3 875 695,02	7,54
Gruppeneigene Investmentanteile						3 875 695,02	7,54
DWS Institutional Money plus (LU0099730524) (0,160%+)	Stück	279	100		EUR 13 891,3800	3 875 695,02	7,54
Summe Wertpapiervermögen						43 483 633,40	84,56
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						182 000,00	0,35
Zinsterminkontrakte							
Euro-Bund Future 09/2011 (EURX)	EUR	27 500				182 000,00	0,35
Bankguthaben						7 209 237,03	14,02
Depotbank (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	7 209 237,03			% 100	7 209 237,03	14,02

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Sonstige Vermögensgegenstände						584 858,20	1,14
Zinsansprüche	EUR	89 308,20			% 100	89 308,20	0,17
Einschüsse (Initial Margin)	EUR	495 550,00			% 100	495 550,00	0,96
Sonstige Verbindlichkeiten						-36 474,09	-0,07
Fondsvermögen						51 423 254,54	100,00
Anteilwert						127,93	
Umlaufende Anteile						401 973,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögenswerte des Fondsvermögens sind auf der Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse / Marktsätze bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein. Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeabschläge gezahlt.

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------	--------------------	-----------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,0000 % Landesbank Berlin 05/31.05.11
IHS S.329 (DE00LBB0YM6) EUR 1 000

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:
(Basiswerte: Euro-Bund Future 03/2011, Euro-Bund Future 06/2011) EUR 36 265

Volumen in 1000

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2011

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						19 368 762,76	78,48
Verzinsliche Wertpapiere							
1,2390 % Baden-Württemberg 09/04.01.13 IHS S.90 (DE0001040640)	EUR	300			% 100,0105	300 031,50	1,22
1,5530 % Bayerische Landesbank 04/02.12.15 IHS (XS0193266839)	EUR	1 000			% 99,1530	991 530,00	4,02
1,5050 % Bayerische Landesbank 04/04.08.14 IHS (XS0197868978)	EUR	500			% 99,4985	497 492,50	2,02
1,2790 % Brandenburg 10/08.04.13 LSA (DE000A0Z2LX0)	EUR	500			% 99,9910	499 955,00	2,03
1,4970 % Brandenburg 10/16.12.13 LSA (DE000A1ELT60)	EUR	600	600		% 99,9340	599 604,00	2,43
1,2690 % Bremen 10/08.07.13 A.172 LSA (DE000A1ELQJ2)	EUR	3 000			% 99,9535	2 998 605,00	12,15
3,7500 % Germany 04/04.01.15 (DE0001135267) 3)	EUR	2 000			% 106,2000	2 124 000,00	8,61
0,0000 % Germany 97/04.07.15 Coupons (DE0001143188)	EUR	475			% 92,0425	437 201,88	1,77
0,0000 % Germany 97/04.07.16 Coupons (DE0001143196)	EUR	475			% 89,0640	423 054,00	1,71
0,0000 % Germany 97/04.07.17 Coupons (DE0001143204)	EUR	475			% 86,0705	408 834,88	1,66
1,2790 % Hessen 08/24.01.14 S.6 LSA (DE000A0EY6V2)	EUR	1 500	1 500		% 99,7290	1 495 935,00	6,06
1,9220 % HSH Nordbank 03/24.06.13 E.10014 IHS (DE0008121864)	EUR	500			% 100,2410	501 205,00	2,03
1,5410 % LB Hessen-Thüringen 05/15.06.15 S.H174 IHS MTN (DE000A0EPK33)	EUR	200			% 99,2325	198 465,00	0,80
1,3990 % LB Hessen-Thüringen 05/24.01.12 S.H157 IHS MTN (XS0209880292)	EUR	200			% 99,9790	199 958,00	0,81
1,5850 % L-Bank B-WV-Förderbank 10/17.06.14 S.5275 IHS MTN (XS0495939455)	EUR	500			% 100,0840	500 420,00	2,03
1,4740 % Niedersachsen 10/23.08.13 LSA S.541 (DE000A1EWF06)	EUR	2 500			% 100,0395	2 500 987,50	10,13
1,5490 % Norddt. Landesbank 04/09.05.14 IHS S.618 (DE000NLB0VG0)	EUR	500	500		% 99,6575	498 287,50	2,02
1,5640 % Nordrhein-Westfalen 09/13.09.13 LSA R.970 (DE000NRW2YQ8)	EUR	400			% 99,9930	399 972,00	1,62
1,4990 % Nordrhein-Westfalen 09/22.10.13 LSA R.973 (DE000NRW2YT2)	EUR	500			% 100,1910	500 955,00	2,03
1,4175 % NRW.BANK 07/01.08.13 A.151 IHS (DE000NWB1517)	EUR	3 000			% 99,7540	2 992 620,00	12,13
1,4230 % Schleswig-Holstein 11/11.02.14 LSA S.1 (DE000SHFM055)	EUR	300	300		% 99,8830	299 649,00	1,21
Investmentanteile						1 458 594,90	5,91
Gruppeneigene Investmentanteile							
DWS Institutional Money plus (LU0099730524) (0,160%+)	Stück	105			EUR 13 891,3800	1 458 594,90	5,91
Summe Wertpapiervermögen						20 827 357,66	84,39
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						105 810,00	0,43
Zinsterminkontrakte							
Euro-Bobl Future 09/2011 (EURX)	EUR	18 200				105 810,00	0,43
Bankguthaben						3 471 018,88	14,06
Depotbank (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	3 471 018,88			% 100	3 471 018,88	14,06
Sonstige Vermögensgegenstände						293 884,82	1,19
Zinsansprüche	EUR	72 361,06			% 100	72 361,06	0,29
Einschüsse (Initial Margin)	EUR	221 250,00			% 100	221 250,00	0,90
Sonstige Ansprüche	EUR	273,76			% 100	273,76	0,00

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-17 834,47			% 100	-17 834,47	-0,07
Fondsvermögen						24 680 236,89	100,00
Anteilwert						124,59	
Umlaufende Anteile						198 089,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögenswerte des Fondsvermögens sind auf der Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse / Marktsätze bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein. Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeabschläge gezahlt.

Fußnoten

³⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 2 124 000,00.

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Volumen in 1000

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: EUR 20.465
(Basiswerte: Euro-Bobl Future 06/2011)

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2011

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						14 282 288,96	79,10
Verzinsliche Wertpapiere							
1,2390 % Baden-Württemberg 09/04.01.13 IHS S.90 (DE0001040640)	EUR	100			100,0105	100 010,50	0,55
1,5530 % Bayerische Landesbank 04/02.12.15 IHS (XS0193266839)	EUR	1 000			99,1530	991 530,00	5,49
1,7760 % Berlin 09/25.06.12 A.279 LSA (DE000A0Z1GR4)	EUR	200			100,2680	200 536,00	1,11
1,2820 % Brandenburg 08/15.01.13 MTN (DE000A0SLGN7)	EUR	100			99,9230	99 923,00	0,55
1,4970 % Brandenburg 10/16.12.13 LSA (DE000A1ELT60)	EUR	1 000	1 000		99,9340	999 340,00	5,53
1,2690 % Bremen 10/08.07.13 A.172 LSA (DE000A1ELQJ2)	EUR	2 000			99,9535	1 999 070,00	11,07
1,5460 % DekaBank DGZ 03/12.08.13 Tr.23 IHS MTN (XS0174158757)	EUR	40			99,7265	39 890,60	0,22
1,5050 % Erste Abwicklungsanstalt 05/04.09.12 IHS MTN (DE000WLB2X53)	EUR	100			99,6485	99 648,50	0,55
4,2500 % Germany 03/04.01.14 (DE0001135242)	EUR	1 000			106,3000	1 063 000,00	5,89
0,0000 % Germany 97/04.07.11 Coupons (DE0001143147)	EUR	475			99,9940	474 971,50	2,63
0,0000 % Germany 97/04.07.12 Coupons (DE0001143154)	EUR	475			98,5510	468 117,25	2,59
0,0000 % Germany 97/04.07.13 Coupons (DE0001143162)	EUR	475			96,9105	460 324,88	2,55
0,0000 % Germany 97/04.07.14 Coupons (DE0001143170)	EUR	475			94,7295	449 965,13	2,49
1,5280 % HSH Nordbank 02/19.08.11 Ser.29 IHS (DE0007273997)	EUR	1 500	1 500		99,9480	1 499 220,00	8,30
1,7960 % Landesbank Berlin 03/26.06.13 IHS S.235 (DE0006218035)	EUR	140			100,3190	140 446,60	0,78
1,3990 % LB Hessen-Thüringen 05/24.01.12 S.H157 IHS MTN (XS0209880292)	EUR	100			99,9790	99 979,00	0,55
1,5100 % Niedersachsen 06/10.10.11 LSA S.208 (DE0001590883)	EUR	100			100,0305	100 030,50	0,55
1,4740 % Niedersachsen 10/23.08.13 LSA S.541 (DE000A1EWF06)	EUR	1 500			100,0395	1 500 592,50	8,31
1,4990 % Nordrhein-Westfalen 09/22.10.13 LSA R.973 (DE000NRW2YT2)	EUR	200			100,1910	200 382,00	1,11
1,4175 % NRW.BANK 07/01.08.13 A.151 IHS (DE000NWB1517)	EUR	2 000			99,7540	1 995 080,00	11,05
1,5250 % Sachsen-Anhalt 10/01.02.15 MTN LSA (XS0483585435)	EUR	600	600		100,1750	601 050,00	3,33
1,4230 % Schleswig-Holstein 11/11.02.14 LSA S.1 (DE000SHFM055)	EUR	700	700		99,8830	699 181,00	3,87
Investmentanteile						986 287,98	5,47
Gruppeneigene Investmentanteile						986 287,98	5,47
DWS Institutional Money plus (LU0099730524) (0,160%+)	Stück	71			EUR 13 891,3800	986 287,98	5,47
Summe Wertpapiervermögen						15 268 576,94	84,57
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						50 400,00	0,28
Zinsterminkontrakte							
Euro-Bobl Future 09/2011 (EURX)	EUR	8 000				50 400,00	0,28
Bankguthaben						2 703 636,69	14,97
Depotbank (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	2 703 636,69			% 100	2 703 636,69	14,97
Sonstige Vermögensgegenstände						45 121,22	0,25
Zinsansprüche	EUR	45 121,22			% 100	45 121,22	0,25

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-12 324,52			% 100	-12 324,52	-0,07
Fondsvermögen						18 055 410,33	100,00
Anteilwert						105,21	
Umlaufende Anteile						171 621,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögenswerte des Fondsvermögens sind auf der Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse / Marktsätze bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein. Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeaufschläge gezahlt.

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------	--------------------	-----------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,2500 % Germany 09/11.03.11 BSA (DE0001137255)	EUR		200
1,3640 % Nordrhein-Westfalen 09/21.04.11 LSA R.932 (DE000NRW2XL1)	EUR		100

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: Euro-Bobl Future 03/2011, Euro-Bobl Future 06/2011)	EUR	9 844
---	-----	-------

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

Vermögensaufstellung zum 30.06.2011

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						44 007 848,04	74,82
Verzinsliche Wertpapiere							
1,5760 % Bayerische Landesbank 04/15.09.14 IHS (XS0200845708)	EUR	2 000	2 000		% 99,4530	1 989 060,00	3,38
0,0000 % Germany 00/04.01.30 (DE0001142131)	EUR	11 000	11 000		% 49,4900	5 443 900,00	9,26
0,0000 % Germany 00/04.01.31 Coupons (DE0001142164)	EUR	7 000	7 000		% 47,0090	3 290 630,00	5,59
0,0000 % Germany 00/04.01.31 Coupons (DE0001142644)	EUR	2 000			% 46,1355	922 710,00	1,57
0,0000 % Germany 00/04.07.31 Coupons (DE0001143345)	EUR	475			% 45,2585	214 977,88	0,37
0,0000 % Germany 03/04.07.30 Coupons (DE0001143337)	EUR	1 000		10 000	% 47,4485	474 485,00	0,81
0,0000 % Germany 03/04.07.32 Coupons (DE0001143352)	EUR	2 475			% 43,4885	1 076 340,38	1,83
0,0000 % Germany 03/04.07.33 Coupons (DE0001143360)	EUR	2 475		8 000	% 41,8015	1 034 587,13	1,76
0,0000 % Germany 03/04.07.34 (DE0001142214)	EUR	12 000	7 000	5 000	% 40,8280	4 899 360,00	8,33
0,0000 % Germany 03/04.07.34 Coupons (DE0001143378)	EUR	2 475		9 000	% 40,2230	995 519,25	1,69
0,0000 % Germany 05/04.01.36 Coupons (DE0001142693)	EUR	1 000			% 38,0880	380 880,00	0,65
0,0000 % Germany 05/04.01.37 S.JA37 (DE0001142263)	EUR	17 000	14 000		% 37,7185	6 412 145,00	10,90
0,0000 % Germany 05/04.01.37 Coupons (DE0001142701)	EUR	1 000			% 36,7140	367 140,00	0,62
0,0000 % Germany 07/04.07.35 Coupons (DE0001143386)	EUR	3 475			% 38,7755	1 347 448,63	2,29
0,0000 % Germany 07/04.07.36 Coupons (DE0001143394)	EUR	1 475		8 000	% 37,4205	551 952,38	0,94
0,0000 % Germany 07/04.07.37 Coupons (DE0001143402)	EUR	1 475		8 000	% 36,2095	534 090,13	0,91
0,0000 % Germany 07/04.07.38 Coupons (DE0001143410)	EUR	4 475		12 000	% 34,9710	1 564 952,25	2,66
0,0000 % Germany 07/04.07.39 Coupons (DE0001143428)	EUR	1 475			% 33,7325	497 554,38	0,85
0,0000 % Germany 07/04.07.39 S.JU39 (DE0001108504)	EUR	17 000	17 000		% 34,4565	5 857 605,00	9,96
0,0000 % Germany 08/04.07.40 Coupons (DE0001143436)	EUR	475			% 32,3475	153 650,63	0,26
1,5830 % Nordrhein-Westfallen 10/09.12.14 IHS S.1091-10 (DE000NRW0BL1)	EUR	6 000	10 000	4 000	% 99,9810	5 998 860,00	10,20
Investmentanteile						5 139 810,60	8,74
Gruppeneigene Investmentanteile						5 139 810,60	8,74
DWS Institutional Money plus (LU0099730524) (0,160%+)	Stück	370	630	260	EUR 13 891,3800	5 139 810,60	8,74
Summe Wertpapiervermögen						49 147 658,64	83,56
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						-550 445,80	-0,94
Zinsterminkontrakte							
Euro-Buxl 30Y Future 09/2011 (EURX)	EUR	28 300				-550 445,80	-0,94
Bankguthaben						9 455 373,40	16,07
Depotbank (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	9 455 373,40			% 100	9 455 373,40	16,07
Sonstige Vermögensgegenstände						808 879,01	1,38
Zinsansprüche	EUR	13 209,01			% 100	13 209,01	0,02
Einschüsse (Initial Margin)	EUR	795 670,00			% 100	795 670,00	1,35

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-40 425,85			% 100	-40 425,85	-0,07
Fondsvermögen						58 821 039,40	100,00
Anteilwert						77,60	
Umlaufende Anteile						757 987,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögenswerte des Fondsvermögens sind auf der Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse / Marktsätze bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein. Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeabschläge gezahlt.

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
0,0000 % Germany 08/04.07.40 (DE0001108546) .	EUR	10 000	26 000
0,0000 % Germany 10/04.07.42 Ser.JU42 (DE0001108595)	EUR		13 000

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

	Volumen in 1000
Terminkontrakte	
Zinsterminkontrakte	
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: Euro-Buxl 30Y Future 06/2011)	EUR 32 796

DWS Vorsorge – 30.06.2011

Zusammensetzung des Fondsvermögens (in EUR)				
	DWS Vorsorge	DWS Vorsorge Dachfonds	DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y	DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y
Wertpapiervermögen	1 808 998 310,84	1 399 469 607,66	160 591 693,61	120 209 782,93
Zins-Derivate	- 3 110 753,40	–	- 3 049 678,20	151 160,60
Swaps	- 753 656,39	- 753 656,39	–	–
Bankguthaben	83 866 292,48	10 437 728,99	30 836 934,59	19 752 362,90
Sonstige Vermögensgegenstände	8 797 819,00	6 075,45	6 177 325,41	881 674,89
Sonstige Verbindlichkeiten	- 1 167 665,59	- 820 929,89	- 138 635,56	- 101 041,21
= Fondsvermögen	1 896 630 346,94	1 408 338 825,82	194 417 639,85	140 893 940,11

Zusammensetzung des Fondsvermögens (in EUR)				
	DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y	DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y	DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y	DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration
Wertpapiervermögen	43 483 633,40	20 827 357,66	15 268 576,94	49 147 658,64
Zins-Derivate	182 000,00	105 810,00	50 400,00	- 550 445,80
Swaps	–	–	–	–
Bankguthaben	7 209 237,03	3 471 018,88	2 703 636,69	9 455 373,40
Sonstige Vermögensgegenstände	584 858,20	293 884,82	45 121,22	808 879,01
Sonstige Verbindlichkeiten	- 36 474,09	- 17 834,47	- 12 324,52	- 40 425,85
= Fondsvermögen	51 423 254,54	24 680 236,89	18 055 410,33	58 821 039,40

Verwaltungsgesellschaft

DWS Investment S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg
Eigenkapital per 31.12.2010: 240,5 Mio. Euro

Verwaltungsrat

Wolfgang Matis (seit dem 1.2.2011)
Vorsitzender
Geschäftsführer der DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main
Geschäftsführer der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main

Ernst Wilhelm Contzen
Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der
Deutsche Bank Luxembourg S.A., Luxemburg

Heinz-Wilhelm Fesser
Luxemburg

Frank Kuhnke
London

Klaus-Michael Vogel
Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der
DWS Investment S.A., Luxemburg
Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der
Deutsche Bank Luxembourg S.A., Luxemburg

Dorothee Wetzel
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Jochen Wiesbach
Geschäftsführer der DWS Finanz-Service GmbH,
Frankfurt am Main

Klaus Kaldemorgen (bis zum 31.1.2011)
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Geschäftsführung

Klaus-Michael Vogel
Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der
DWS Investment S.A., Luxemburg
Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der
Deutsche Bank Luxembourg S.A., Luxemburg

Manfred Bauer
DWS Investment S.A., Luxemburg

Markus Kohlenbach (seit dem 1.3.2011)
DWS Investment S.A., Luxemburg

Doris Marx
DWS Investment S.A., Luxemburg

Ralf Rauch
DWS Investment S.A., Luxemburg

Abschlussprüfer

KPMG Audit S.à r.l.
9, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg

Depotbank

State Street Bank Luxembourg S.A.
49, Avenue J. F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Fondsmanager

DWS Investment GmbH
Mainzer Landstraße 178-190
D-60327 Frankfurt am Main

Vertriebs-, Zahl- und Informationsstelle

LUXEMBURG
Deutsche Bank Luxembourg S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg

DWS Investment S.A.

2, Boulevard Konrad Adenauer

L-1115 Luxemburg

Tel.: +352 4 21 01-1

Fax: +352 4 21 01-9 00