

Halbjahresbericht
zum 31. Dezember 2023.

Deka-EuropaBond

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. Dezember 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-EuropaBond für den Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis zum 31. Dezember 2023.

Die Teuerungsraten entfernten sich im zweiten Halbjahr 2023 deutlich von ihren Höchstständen und sorgten damit für eine gewisse Entlastung an den Finanzmärkten. Dennoch hat sich in Deutschland und im Euroraum die Konjunktur merklich abgekühlt, was eine Schrumpfung des deutschen Bruttoinlandsprodukts sowie einen leichten Rückgang des Wirtschaftswachstums im gesamten Euroraum im vierten Quartal 2023 wahrscheinlich werden lässt. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin die Wirtschaftslage in den USA. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren (Ukraine-Krieg, Nahost-Konflikt) sorgten im Berichtszeitraum teilweise für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik konzentrierte sich weiterhin insbesondere auf die Inflations-Bekämpfung, wobei sich die Tonlage zuletzt etwas abmilderte. Während die US-Notenbank Fed seit Mitte Juli 2023 bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt war, erhöhte die EZB zuletzt im September ihren Hauptrefinanzierungssatz auf 4,50 Prozent. An den Rentenmärkten entfernten sich die Verzinsungen in den letzten Wochen aufgrund des nahenden Endes des Zinserhöhungs-Zyklus merklich von ihren zuvor erreichten mehrjährigen Höchstständen. Zehnjährige Euroland-Staatsanleihen rentierten zum Jahresende bei 2,0 Prozent, laufzeitkongruente US-Treasuries notierten Ende Dezember bei 3,9 Prozent.

Auf der Aktienseite erholten sich die meisten Börsen im vierten Quartal 2023 von ihren zwischenzeitlichen Rückschlägen und legten, getrieben von rückläufigen Inflationszahlen, sinkenden Renditen und Spekulationen auf baldige Leitzinssenkungen, deutlich zu. Lediglich China litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise. Am Devisenmarkt notierte der Euro nach volatiltem Verlauf Ende Dezember bei 1,10 US-Dollar, bei den Rohstoffen lag der Rohölpreis bei rund 77 US-Dollar pro Barrel (Brent Future). Die Feinunze Gold kletterte im Dezember über der Marke von 2.000 US-Dollar und erreichte kurzzeitig ein neues Allzeit-Hoch.

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Abschnitt Anlagepolitik. Gerne nehmen wir die Gelegenheit zum Anlass, um Ihnen für das uns entgegengebrachte Vertrauen zu danken.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

| | |
|---|----|
| Anlagepolitik | 5 |
| Anteilklassen im Überblick | 6 |
| Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023 | 7 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 | 8 |
| Anhang | 18 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 20 |

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.

Deka-EuropaBond

Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Hierzu sollen die Zins-, Kurs- und Währungschancen der europäischen Rentenmärkte einschließlich Zentral- und Osteuropas genutzt werden.

Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen legt der Fonds überwiegend in verzinsliche Wertpapiere von Ausstellern aus ganz Europa an. Hierzu zählen Aussteller aus dem Euroraum, aus den übrigen Ländern Westeuropas wie auch aus Zentral- und Osteuropa. Zusätzlich können in gewissem Umfang Anlagen in globalen Währungen getätigt werden. Die Anlagen erfolgen überwiegend in Staats- und Unternehmensanleihen sowie in besicherten verzinslichen Wertpapieren, z. B. Pfandbriefen. Der Fonds erwirbt Anleihen in Lokalwährung oder in Hartwährung (vornehmlich Euro).

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental orientierte Investmentansatz kombiniert gezielt "Top-Down" sowie "Bottom-Up"-Elemente. Die Basis stellt die Analyse makroökonomischer sowie (geo)politischer Parameter dar, ergänzt durch qualitative sowie quantitative fundamentale Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände, z.B. Bonitätsanalyse der Emittenten, relativer Vergleich der Wertpapiere mit anderen korrespondierenden Ausstellern. Um den Erfolg des Wertpapierauswahlprozesses zu bewerten wird der Index ICE BofA European Index III in EUR (in den Besonderen Anlagebedingungen als ICE BofAML Q184 "European Index III" in EUR bezeichnet)¹⁾ verwendet. Die initiale und kontinuierliche Wertpapierauswahl erfolgt im Rahmen des beschriebenen Investmentansatzes unabhängig von diesem Referenzwert und damit verbundenen quantitativen oder qualitativen Einschränkungen

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Wichtige Kennzahlen

Deka-EuropaBond

| Performance* | 6 Monate |
|-----------------|----------|
| Anteilklasse CF | 4,5% |
| Anteilklasse TF | 4,2% |
| Anteilklasse AV | 4,5% |

ISIN

| | |
|-----------------|--------------|
| Anteilklasse CF | DE000DK091G0 |
| Anteilklasse TF | DE0009771980 |
| Anteilklasse AV | DE000DK2J878 |

* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

1) 1 Referenzindex: 100% ICE BofAML Q184 „European Index III“ in EUR. Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Index-Marke stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds Deka-EuropaBond können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung*, der Vertriebsvergütung**, der erfolgsabhängigen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von drei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung, der erfolgsabhängigen Vergütung und der Mindestanlagesumme sowie der Vertriebsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung CF, TF und AV. Anteile, die bis zum 30. September 2007 unter der Bezeichnung „Deka-EuropaBond TF“ begeben wurden, werden seit dem 1. Oktober 2007 der Anteilklasse TF zugeordnet.

Die Anteilklasse AV ist für den Einsatz in zertifizierten Altersvorsorge-Sondervermögen der Deka-Gruppe sowie in solchen allokierten Investmentvermögen (Zielfonds) vorgesehen. Die Mindestanlagesumme bei der Anlage in Anteile der Anteilklasse AV beträgt EUR 5.000. Es steht der Gesellschaft frei, einen niedrigeren Zeichnungsbetrag zu akzeptieren.

Die Verwaltungsgesellschaft kann für die Verwaltung des Fondsvermögens, das den Anteilklassen CF und TF zuzuordnen ist, je ausgegebenem Anteil eine erfolgsabhängige Vergütung in Höhe von bis zu 25 Prozent des Anteiles der Wertentwicklung des Fonds, der über der als Vergleichsmaßstab herangezogenen Wertentwicklung des ICE BofAML® Q184 "European Index III" in EUR liegt, erhalten. Für die Anteilklasse AV wird keine erfolgsbezogene Vergütung erhoben.

Weitere Details zu den Merkmalen der jeweiligen Anteilklasse entnehmen Sie bitte der untenstehenden Tabelle. Näheres ist im Verkaufsprospekt geregelt.

Der Erwerb von Vermögensgegenständen ist nur einheitlich für das ganze Sondervermögen und nicht für eine einzelne Anteilklasse oder eine Gruppe von Anteilklassen zulässig. Die Bildung neuer Anteilklassen ist zulässig, sie liegt im Ermessen der Gesellschaft. Es ist weder notwendig, dass Anteile einer Anteilklasse im Umlauf sind, noch dass Anteile einer neu gebildeten Anteilklasse umgehend auszugeben sind. Bei erstmaliger Ausgabe von Anteilen einer Anteilklasse ist deren Wert auf der Grundlage des für den gesamten Fonds nach § 168 Absatz 1 Satz 1 KAGB ermittelten Wertes zu berechnen.

Anteilklassen im Überblick

| | Verwaltungsvergütung* | Ausgabeaufschlag | Mindestanlagesumme | Ertragsverwendung |
|-------------------|-----------------------|------------------|--------------------|-------------------|
| Anteilklasse CF | 0,75% p.a. | 3,00% | keine | Ausschüttung |
| Anteilklasse TF** | 1,23% p.a. | keiner | keine | Ausschüttung |
| Anteilklasse AV | 0,76% p.a. | keiner | EUR 5.000 | Ausschüttung |

* Der Verwaltungsvergütungssatz wird auf das durchschnittliche Fondsvermögen berechnet, das sich aus den Tageswerten zusammensetzt.

** Die Vertriebsvergütung wird durch die Verwaltungsvergütung abgedeckt und wird dem Sondervermögen nicht gesondert belastet.

Deka-EuropaBond

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

| | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens *) |
|---|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | |
| 1. Anleihen | 281.587.583,18 | 92,00 |
| Belgien | 4.661.815,50 | 1,53 |
| Bulgarien | 2.252.250,00 | 0,74 |
| Dänemark | 24.871.503,25 | 8,13 |
| Deutschland | 34.908.361,91 | 11,41 |
| Färöer Inseln | 457.420,44 | 0,15 |
| Finnland | 2.242.767,88 | 0,73 |
| Frankreich | 5.636.432,50 | 1,84 |
| Griechenland | 1.075.609,38 | 0,35 |
| Großbritannien | 21.654.309,34 | 7,09 |
| Irland | 6.103.652,50 | 1,98 |
| Israel | 1.407.594,25 | 0,46 |
| Italien | 20.940.066,25 | 6,85 |
| Japan | 780.208,00 | 0,25 |
| Kasachstan | 1.152.320,80 | 0,38 |
| Lettland | 1.474.875,00 | 0,48 |
| Niederlande | 12.405.517,98 | 4,05 |
| Norwegen | 14.806.565,89 | 4,84 |
| Österreich | 3.312.898,17 | 1,07 |
| Polen | 13.468.946,08 | 4,40 |
| Portugal | 6.928.803,50 | 2,27 |
| Rumänien | 1.284.375,00 | 0,42 |
| Schweden | 19.890.276,94 | 6,50 |
| Schweiz | 2.249.852,26 | 0,74 |
| Slowakei | 2.166.622,50 | 0,71 |
| Slowenien | 2.143.346,89 | 0,70 |
| Sonstige | 10.439.088,19 | 3,41 |
| Spanien | 11.687.258,75 | 3,82 |
| Tschechische Republik | 28.683.894,78 | 9,36 |
| Türkei | 6.200.843,53 | 2,02 |
| Ukraine | 1.507.399,65 | 0,50 |
| Ungarn | 14.792.706,07 | 4,82 |
| 2. Derivate | 4.362.389,84 | 1,43 |
| 3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | 18.735.406,37 | 6,13 |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | 11.726.781,34 | 3,84 |
| II. Verbindlichkeiten | -10.411.561,74 | -3,40 |
| III. Fondsvermögen | 306.000.598,99 | 100,00 |

Gliederung nach Anlageart - Währung

| | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens *) |
|---|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | |
| 1. Anleihen | 281.587.583,18 | 92,00 |
| CHF | 6.277.873,88 | 2,06 |
| CZK | 22.278.463,40 | 7,27 |
| DKK | 23.373.130,69 | 7,64 |
| EGP | 905.198,62 | 0,30 |
| EUR | 133.229.977,15 | 43,52 |
| GBP | 21.945.077,22 | 7,18 |
| HUF | 19.098.036,34 | 6,23 |
| ITL | 918.188,06 | 0,30 |
| KZT | 2.359.287,68 | 0,77 |
| NOK | 13.397.097,14 | 4,38 |
| PLN | 4.892.229,08 | 1,60 |
| SEK | 19.899.849,91 | 6,50 |
| TRY | 7.783.547,85 | 2,54 |
| USD | 5.229.626,16 | 1,71 |
| 2. Derivate | 4.362.389,84 | 1,43 |
| 3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | 18.735.406,37 | 6,13 |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | 11.726.781,34 | 3,84 |
| II. Verbindlichkeiten | -10.411.561,74 | -3,40 |
| III. Fondsvermögen | 306.000.598,99 | 100,00 |

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

Deka-EuropaBond

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023.

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.12.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|-------------------------------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------------|-------------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | 273.346.731,44 | 89,31 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | 273.346.731,44 | 89,31 |
| EUR | | | | | | | | 128.819.158,52 | 42,08 |
| XS2387713238 | 0,4000 % ABN AMRO Bank N.V. MT Cov. Bds 21/41 | EUR | | 3.000.000 | 0 | 0 | % 63,924 | 1.917.720,00 | 0,63 |
| FR0013516176 | 0,2500 % AXA Bank Europe SCF MT Obl. Fonc. 20/40 | EUR | | 1.500.000 | 0 | 0 | % 63,403 | 951.037,50 | 0,31 |
| XS2486282358 | 3,0000 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 22/29 | EUR | | 1.100.000 | 1.100.000 | 0 | % 97,806 | 1.075.866,00 | 0,35 |
| XS2065555562 | 2,3750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 19/29 | EUR | | 2.000.000 | 0 | 0 | % 98,510 | 1.970.200,00 | 0,64 |
| XS2724428193 | 5,5000 % Bank Polska Kasa Op. S.A. FLR Non-Pref. MTN 23/27 | EUR | | 1.350.000 | 1.350.000 | 0 | % 102,050 | 1.377.675,00 | 0,45 |
| XS1620630571 | 3,0000 % Barclays Bank PLC FLR MTN 17/25 | EUR | | 2.000.000 | 2.000.000 | 0 | % 97,600 | 1.952.000,00 | 0,64 |
| XS2230264603 | 1,8750 % BAWAG Group AG FLR MTN 20/30 | EUR | | 1.000.000 | 1.000.000 | 0 | % 89,600 | 896.000,00 | 0,29 |
| XS2721113160 | 4,3750 % Bayerische Landesbank MT IHS 23/28 ¹⁾ | EUR | | 2.600.000 | 2.600.000 | 0 | % 102,666 | 2.669.303,00 | 0,87 |
| IT0005571952 | 3,7500 % BPER Banca S.p.A. Mrtg. Cov .MTN 23/28 | EUR | | 1.775.000 | 1.775.000 | 0 | % 102,661 | 1.822.232,75 | 0,60 |
| XS2716887844 | 4,8750 % Bulgarien MTN 23/36 | EUR | | 2.100.000 | 2.100.000 | 0 | % 107,250 | 2.252.250,00 | 0,74 |
| IT0005568123 | 4,7500 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 23/30 | EUR | | 2.300.000 | 2.300.000 | 0 | % 106,171 | 2.441.933,00 | 0,80 |
| FR001400M8W6 | 5,7500 % Coface S.A. Notes 23/33 | EUR | | 800.000 | 800.000 | 0 | % 103,879 | 831.028,00 | 0,27 |
| XS2723549361 | 3,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 23/30 | EUR | | 1.700.000 | 1.700.000 | 0 | % 103,544 | 1.760.239,50 | 0,58 |
| FR001400M4O2 | 4,3750 % Crédit Agricole S.A. Non-Preferred MTN 23/33 | EUR | | 1.000.000 | 1.000.000 | 0 | % 105,231 | 1.052.310,00 | 0,34 |
| DK0004133725 | 4,3750 % Danmarks Skibskredit A/S Mortg. Cov. MTN 23/26 | EUR | | 1.100.000 | 1.100.000 | 0 | % 102,293 | 1.125.223,00 | 0,37 |
| XS1637926137 | 4,6790 % Dt. Pfandbriefbank AG Nachr. FLR MTN R.35281 17/27 | EUR | | 1.900.000 | 1.900.000 | 0 | % 73,250 | 1.391.750,00 | 0,45 |
| XS2699159278 | 4,1250 % EDP Servicios Financ.Espana SA MTN 23/29 | EUR | | 1.925.000 | 1.925.000 | 0 | % 104,177 | 2.005.407,25 | 0,66 |
| XS2698045130 | 4,5000 % Electrolux, AB MTN 23/28 | EUR | | 1.500.000 | 1.500.000 | 0 | % 102,338 | 1.535.062,50 | 0,50 |
| XS2722717472 | 3,8500 % EnBW International Finance BV MTN 23/30 | EUR | | 2.725.000 | 2.725.000 | 0 | % 103,330 | 2.815.728,88 | 0,92 |
| XS2722717555 | 4,3000 % EnBW International Finance BV MTN 23/34 | EUR | | 1.250.000 | 1.250.000 | 0 | % 106,008 | 1.325.093,75 | 0,43 |
| XS2716891440 | 6,6510 % EPH Financing International as MTN 23/28 | EUR | | 2.875.000 | 2.875.000 | 0 | % 102,373 | 2.943.209,38 | 0,96 |
| XS2697983869 | 4,0000 % ESB Finance DAC MTN 23/28 | EUR | | 1.750.000 | 1.750.000 | 0 | % 103,811 | 1.816.692,50 | 0,59 |
| XS2579482006 | 3,7500 % ESB Finance DAC MTN 23/43 | EUR | | 625.000 | 0 | 0 | % 99,525 | 622.031,25 | 0,20 |
| EU000A3K7MW2 | 1,6250 % Europaeische Union MTN 22/29 | EUR | | 1.350.000 | 0 | 0 | % 95,535 | 1.289.722,50 | 0,42 |
| EU000A3K4DM9 | 2,6250 % Europaeische Union MTN 22/48 | EUR | | 500.000 | 500.000 | 0 | % 92,948 | 464.737,50 | 0,15 |
| EU000A3LNF05 | 3,1250 % Europaeische Union MTN 23/30 | EUR | | 1.025.000 | 1.025.000 | 0 | % 104,362 | 1.069.710,50 | 0,35 |
| EU000A3K4D41 | 3,2500 % Europaeische Union MTN 23/34 | EUR | | 1.750.000 | 0 | 0 | % 105,003 | 1.837.552,50 | 0,60 |
| EU000A1Z9953 | 3,0000 % Europaeischer Stabiltaets.(ESM) MTN 23/33 | EUR | | 1.150.000 | 0 | 0 | % 103,530 | 1.190.595,00 | 0,39 |
| BE0002964451 | 3,8750 % Fluvius System Operator CVBA MTN 23/31 | EUR | | 1.700.000 | 1.700.000 | 0 | % 103,714 | 1.763.129,50 | 0,58 |
| XS2719137965 | 6,0000 % Hungarian Export-Import Bk PLC Bonds 23/29 | EUR | | 1.300.000 | 1.300.000 | 0 | % 106,455 | 1.383.915,00 | 0,45 |
| IT0005555112 | 3,8750 % ICCREA Banca - Ist.C.d.Cred.C. MT Cov. Bds 23/29 | EUR | | 2.625.000 | 2.625.000 | 0 | % 103,010 | 2.704.012,50 | 0,88 |
| IT0005554578 | 3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MT Hyp.-Pfe. 23/28 | EUR | | 2.400.000 | 0 | 0 | % 102,527 | 2.460.648,00 | 0,80 |
| XS2696903728 | 4,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 23/25 | EUR | | 1.500.000 | 1.500.000 | 0 | % 101,874 | 1.528.110,00 | 0,50 |
| BE0000357666 | 3,0000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 23/33 | EUR | | 2.800.000 | 9.270.000 | 8.220.000 | % 103,525 | 2.898.686,00 | 0,95 |
| ES0000012L78 | 3,5500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33 | EUR | | 2.425.000 | 0 | 0 | % 106,142 | 2.573.943,50 | 0,84 |
| ES0000012L60 | 3,9000 % Koenigreich Spanien Bonos 23/39 | EUR | | 3.000.000 | 3.000.000 | 0 | % 106,334 | 3.190.020,00 | 1,04 |
| ES0000012G00 | 1,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/50 | EUR | | 2.000.000 | 0 | 2.000.000 | % 56,621 | 1.132.420,00 | 0,37 |
| ES0000012K95 | 3,4500 % Koenigreich Spanien Obligaciones 22/43 | EUR | | 2.800.000 | 0 | 0 | % 99,481 | 2.785.468,00 | 0,91 |
| XS2226280084 | 0,1250 % KommuneKredit MTN 20/40 | EUR | | 1.300.000 | 0 | 0 | % 63,890 | 830.570,00 | 0,27 |
| DE000A30V9M4 | 2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33 ¹⁾ | EUR | | 3.500.000 | 0 | 0 | % 102,639 | 3.592.365,00 | 1,17 |
| DE000NRW0NW3 | 2,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1551 23/32 ¹⁾ | EUR | | 2.675.000 | 0 | 0 | % 102,315 | 2.736.926,25 | 0,89 |
| DE000NRW0NX1 | 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1552 23/53 | EUR | | 2.125.000 | 0 | 0 | % 96,747 | 2.055.863,13 | 0,67 |
| DE000NRW0N67 | 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1561 23/33 | EUR | | 1.000.000 | 0 | 1.175.000 | % 102,587 | 1.025.870,00 | 0,34 |
| XS2489772991 | 4,5000 % Lb.Hessen-Thuringen GZ FLR MTN S.H354 22/32 | EUR | | 2.000.000 | 0 | 0 | % 95,707 | 1.914.140,00 | 0,63 |

Deka-EuropaBond

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.12.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|--------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|----------------------|-------------------------|
| XS2582098930 | 5,3750 % Lb.Hessen-Thuringen GZ Nach. MTN IHS S.H363 23/33 | | EUR | 2.000.000 | 0 | 0 | % 93,884 | 1.877.670,00 | 0,61 |
| DE000MHB64E1 | 0,3750 % Muenchener Hypothekenbank MTN IHS S.1927 21/29 | | EUR | 1.000.000 | 0 | 2.500.000 | % 85,106 | 851.060,00 | 0,28 |
| DE000MHB66N7 | 7,1250 % Muenchener Hypothekenbank Sub.MTI S.2038 23/28 | | EUR | 1.000.000 | 1.000.000 | 0 | % 103,860 | 1.038.595,00 | 0,34 |
| XS2716710756 | 3,8750 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 23/33 | | EUR | 675.000 | 675.000 | 0 | % 105,533 | 712.344,38 | 0,23 |
| XS2713801780 | 6,0000 % NIBC Bank N.V. MTN 23/28 | | EUR | 1.400.000 | 1.400.000 | 0 | % 106,289 | 1.488.039,00 | 0,49 |
| DE000NWB0AR8 | 1,6250 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.0AR 22/32 | | EUR | 2.650.000 | 0 | 0 | % 92,630 | 2.454.695,00 | 0,80 |
| XS2577033553 | 7,1250 % Raiffeisenbank a.s. FLR Non-Pref. MTN 23/26 | | EUR | 1.600.000 | 0 | 0 | % 101,316 | 1.621.056,00 | 0,53 |
| XS2613629372 | 3,3750 % Raiffeisenl.Niederöest.-Wien AG MT Hyp.-Pfe. 23/28 | | EUR | 1.000.000 | 0 | 0 | % 102,190 | 1.021.900,00 | 0,33 |
| PTRAAJOM0008 | 3,7200 % Região Autónoma Acores Notes 23/28 | | EUR | 3.000.000 | 0 | 0 | % 102,801 | 3.084.015,00 | 1,01 |
| FR0013515806 | 0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40 | | EUR | 1.500.000 | 0 | 1.000.000 | % 69,455 | 1.041.817,50 | 0,34 |
| IE000GVLBXU6 | 3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43 ¹⁾ | | EUR | 1.625.000 | 0 | 0 | % 104,291 | 1.694.728,75 | 0,55 |
| IT0005321325 | 2,9500 % Republik Italien B.T.P. 18/38 | | EUR | 1.400.000 | 0 | 0 | % 89,174 | 1.248.429,00 | 0,41 |
| IT0005496770 | 3,2500 % Republik Italien B.T.P. 22/38 | | EUR | 3.200.000 | 0 | 0 | % 92,349 | 2.955.168,00 | 0,97 |
| IT0005530032 | 4,4500 % Republik Italien B.T.P. 22/43 | | EUR | 2.850.000 | 0 | 0 | % 104,799 | 2.986.771,50 | 0,98 |
| IT0005534141 | 4,5000 % Republik Italien B.T.P. 22/53 | | EUR | 1.400.000 | 0 | 0 | % 103,673 | 1.451.415,00 | 0,47 |
| XS2722876609 | 3,8750 % Republik Lettland MTN 23/29 | | EUR | 1.425.000 | 1.425.000 | 0 | % 103,500 | 1.474.875,00 | 0,48 |
| AT000A33SK7 | 3,1500 % Republik Oesterreich MTN 23/53 | | EUR | 1.000.000 | 0 | 1.700.000 | % 104,709 | 1.047.090,00 | 0,34 |
| XS1346201889 | 2,3750 % Republik Polen MTN 16/36 ¹⁾ | | EUR | 3.800.000 | 3.800.000 | 0 | % 87,952 | 3.342.176,00 | 1,09 |
| XS2726911931 | 3,6250 % Republik Polen MTN 23/30 | | EUR | 2.700.000 | 2.700.000 | 0 | % 103,000 | 2.781.000,00 | 0,91 |
| PTOTEPOE0032 | 1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42 ¹⁾ | | EUR | 4.250.000 | 0 | 0 | % 72,005 | 3.060.212,50 | 1,00 |
| XS2689949399 | 5,5000 % Republik Rumänien MTN 23/28 Reg.S ¹⁾ | | EUR | 1.250.000 | 2.525.000 | 1.275.000 | % 102,750 | 1.284.375,00 | 0,42 |
| XS2726335099 | 3,5860 % Roche Finance Europe B.V. MTN 23/36 | | EUR | 1.350.000 | 1.350.000 | 0 | % 106,084 | 1.432.134,00 | 0,47 |
| XS2725959683 | 4,0000 % Snam S.p.A. MTN 23/29 | | EUR | 1.300.000 | 1.300.000 | 0 | % 103,181 | 1.341.346,50 | 0,44 |
| XS2010033343 | 0,0000 % Ukraine Notes 20/32 Reg.S | | EUR | 3.500.000 | 0 | 0 | % 20,589 | 720.615,00 | 0,24 |
| XS2637445276 | 3,7500 % UniCredit Bk Czech R.+Slovas Mort. Cov. Bds 23/28 | | EUR | 1.800.000 | 0 | 0 | % 102,287 | 1.841.166,00 | 0,60 |
| XS2708134023 | 7,8620 % Var Energi ASA FLR Securities 23/83 | | EUR | 1.325.000 | 1.325.000 | 0 | % 106,375 | 1.409.468,75 | 0,46 |
| XS2438615606 | 0,2500 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 22/25 | | EUR | 2.500.000 | 2.500.000 | 0 | % 96,479 | 2.411.975,00 | 0,79 |
| SK4000023685 | 3,8750 % Vseobecna MT Mortg.Cov.Bds 23/28 | | EUR | 2100.000 | 2.100.000 | 0 | % 103,173 | 2.166.622,50 | 0,71 |
| CHF | | | | | | | | 6.277.873,88 | 2,06 |
| CH0595205516 | 0,2000 % Muenchener Hypothekenbank MTN S.1920 21/31 | | CHF | 4.200.000 | 0 | 0 | % 89,260 | 4.028.021,62 | 1,32 |
| CH0419040925 | 1,0500 % Stadt Lausanne Anl. 19/44 | | CHF | 2.200.000 | 0 | 0 | % 95,180 | 2.249.852,26 | 0,74 |
| CZK | | | | | | | | 22.278.463,40 | 7,27 |
| CZ0001003859 | 2,5000 % Tschechien Anl. 13/28 | | CZK | 80.000.000 | 0 | 0 | % 95,040 | 3.078.530,22 | 1,01 |
| CZ0001004477 | 0,9500 % Tschechien Anl. S.94 15/30 | | CZK | 70.000.000 | 0 | 0 | % 84,640 | 2.398.947,26 | 0,78 |
| CZ0001007025 | 5,7500 % Tschechien Bonds 23/29 | | CZK | 130.000.000 | 130.000.000 | 0 | % 109,450 | 5.761.109,42 | 1,88 |
| CZ0001005375 | 2,7500 % Tschechien Bonds S.105 18/29 | | CZK | 50.000.000 | 0 | 0 | % 95,122 | 1.925.741,47 | 0,63 |
| CZ0001006076 | 0,0500 % Tschechien Bonds S.130 20/29 | | CZK | 60.000.000 | 0 | 0 | % 80,801 | 1.962.976,01 | 0,64 |
| CZ0001006233 | 1,7500 % Tschechien Bonds S.138 21/32 | | CZK | 35.000.000 | 0 | 0 | % 86,045 | 1.219.384,55 | 0,40 |
| CZ0001006688 | 5,0000 % Tschechien Bonds S.150 22/30 | | CZK | 20.000.000 | 0 | 0 | % 107,500 | 870.533,45 | 0,28 |
| CZ0001006894 | 4,9000 % Tschechien Bonds S.151 23/34 | | CZK | 75.000.000 | 0 | 0 | % 109,300 | 3.319.161,86 | 1,08 |
| CZ0001005243 | 2,0000 % Tschechien Bonds S.15Y 17/33 | | CZK | 50.000.000 | 80.000.000 | 140.000.000 | % 86,050 | 1.742.079,16 | 0,57 |
| DKK | | | | | | | | 23.373.130,69 | 7,64 |
| DK0030525837 | 3,6250 % Faeroer Anl. 23/26 | | DKK | 3.350.000 | 0 | 0 | % 101,774 | 457.420,44 | 0,15 |
| DK0009924102 | 0,0000 % Koenigreich Daenemark Anl. 20/31 | | DKK | 35.000.000 | 0 | 0 | % 84,839 | 3.983.823,25 | 1,30 |
| DK0009924532 | 2,2500 % Koenigreich Daenemark Anl. 22/33 | | DKK | 70.000.000 | 0 | 25.000.000 | % 100,095 | 9.400.356,87 | 3,08 |
| DK0009924615 | 2,2500 % Koenigreich Daenemark Anl. 23/33 | | DKK | 19.800.000 | 19.800.000 | 0 | % 100,243 | 2.662.902,89 | 0,87 |
| DK0009922320 | 4,5000 % Königreich Dänemark Anl. 07/39 | | DKK | 40.000.000 | 0 | 0 | % 127,990 | 6.868.627,24 | 2,24 |
| EGP | | | | | | | | 905.198,62 | 0,30 |
| XS2308323232 | 8,0000 % European Investment Bank MTN 21/24 | | EGP | 45.000.000 | 0 | 0 | % 69,284 | 905.198,62 | 0,30 |
| GBP | | | | | | | | 21.945.077,22 | 7,18 |
| GB0032452392 | 4,2500 % Großbritannien Treasury Stock 03/36 | | GBP | 2.000.000 | 0 | 0 | % 104,730 | 2.412.549,96 | 0,79 |
| GB00B00NY175 | 4,7500 % Großbritannien Treasury Stock 04/38 | | GBP | 3.200.000 | 0 | 0 | % 108,845 | 4.011.748,31 | 1,31 |
| GB00BN65R313 | 3,5000 % Großbritannien Treasury Stock 14/45 | | GBP | 6.350.000 | 0 | 0 | % 90,469 | 6.616.847,59 | 2,16 |
| GB00BMBL1F74 | 0,6250 % Großbritannien Treasury Stock 20/50 ¹⁾ | | GBP | 2.850.000 | 0 | 150.000 | % 43,686 | 1.434.060,02 | 0,47 |
| GB00BMBL1D50 | 0,5000 % Großbritannien Treasury Stock 20/61 | | GBP | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | % 33,340 | 384.002,72 | 0,13 |
| GB00BNNGP775 | 0,8750 % Großbritannien Treasury Stock 21/46 | | GBP | 6.450.000 | 0 | 0 | % 52,933 | 3.932.433,97 | 1,29 |

Deka-EuropaBond

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.12.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) | |
|---|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------|-----------------|-------------------------|-------------|
| GB00BLH38158 | 1,2500 % Großbritannien Treasury Stock 21/51 | | GBP | 1.500.000 | 0 | 1.500.000 | % | 52,710 | 910.666,77 | 0,30 |
| XS2318615569 | 0,3750 % Municipality Finance PLC MTN Tr.3 21/25 | | GBP | 2.100.000 | 0 | 0 | % | 92,724 | 2.242.767,88 | 0,73 |
| HUF | | | | | | | | | 19.098.036,34 | 6,23 |
| HU0000362512 | 15,0000 % Erste Bank Hungary Zrt. FLR Notes 23/25 | | HUF | 350.000.000 | 0 | 0 | % | 104,229 | 954.178,44 | 0,31 |
| XS2237392027 | 2,2500 % Intl Investment Bank -IIB- MTN 20/23 | | HUF | 1.250.000.000 | 0 | 0 | % | 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| XS2524813545 | 11,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/24 | | HUF | 2.000.000.000 | 0 | 0 | % | 102,105 | 5.341.337,10 | 1,75 |
| HU0000357892 | 3,0000 % MFB Magyar Fejlesztési Bk Zrt. Notes 17/27 | | HUF | 1.600.000.000 | 0 | 0 | % | 86,472 | 3.618.811,47 | 1,18 |
| AT000B015334 | 7,5000 % Raiffeisen Bank Intl AG MTN S.188 22/26 | | HUF | 131.500.000 | 0 | 0 | % | 101,150 | 347.908,17 | 0,11 |
| HU0000402532 | 6,7500 % Ungarn Notes 11/28 | | HUF | 2.000.000.000 | 1.100.000.000 | 600.000.000 | % | 104,075 | 5.444.392,13 | 1,78 |
| HU0000405550 | 4,7500 % Ungarn Notes S.2032/A 22/32 | | HUF | 500.000.000 | 0 | 3.200.000.000 | % | 92,337 | 1.207.581,35 | 0,39 |
| HU0000403068 | 3,0000 % Ungarn Notes S.24/B 15/24 | | HUF | 850.000.000 | 0 | 0 | % | 98,226 | 2.183.827,68 | 0,71 |
| ITL | | | | | | | | | 918.188,06 | 0,30 |
| XS0071094667 | 0,0000 % Commerzbank AG Zero LI-Anl. Tr.46 96/26 | | ITL | 2.000.000.000 | 0 | 0 | % | 88,893 | 918.188,06 | 0,30 |
| KZT | | | | | | | | | 2.359.287,68 | 0,77 |
| XS2337670421 | 10,9500 % CJSC Dvlpmt Bk of Kazakhstan MTN 21/26 Reg.S | | KZT | 650.000.000 | 0 | 0 | % | 89,335 | 1.152.320,80 | 0,38 |
| XS2361431476 | 10,0000 % Eurasian Development Bank MTN 21/24 | | KZT | 650.000.000 | 0 | 0 | % | 93,572 | 1.206.966,88 | 0,39 |
| NOK | | | | | | | | | 13.397.097,14 | 4,38 |
| NO0012837642 | 3,0000 % Koenigreich Norwegen Anl. 23/33 | | NOK | 75.000.000 | 20.000.000 | 0 | % | 97,898 | 6.520.017,67 | 2,13 |
| NO0010705536 | 3,0000 % Königreich Norwegen Anl. 14/24 | | NOK | 60.000.000 | 0 | 0 | % | 99,704 | 5.312.210,85 | 1,74 |
| NO0013068114 | 4,4500 % Stadt Oslo Bonds 23/31 | | NOK | 17.000.000 | 17.000.000 | 0 | % | 103,661 | 1.564.868,62 | 0,51 |
| PLN | | | | | | | | | 4.892.229,08 | 1,60 |
| PL0000115291 | 6,0000 % Republik Polen Bonds S.DS1033 22/33 | | PLN | 20.000.000 | 20.000.000 | 0 | % | 106,269 | 4.892.229,08 | 1,60 |
| SEK | | | | | | | | | 19.899.849,91 | 6,50 |
| SE0017830730 | 1,7500 % Koenigreich Schweden Loan Nr.1065 22/33 | | SEK | 15.000.000 | 0 | 0 | % | 97,607 | 1.323.765,95 | 0,43 |
| SE0005676608 | 2,5000 % Königreich Schweden Loan Nr.1058 14/25 | | SEK | 160.000.000 | 0 | 0 | % | 99,490 | 14.392.571,53 | 4,71 |
| SE0002829192 | 3,5000 % Königreich Schweden Obl. Nr.1053 09/39 | | SEK | 25.000.000 | 0 | 0 | % | 116,746 | 2.638.876,96 | 0,86 |
| XS1813504070 | 2,0400 % Nederlandse Waterschapsbank NV MTN 18/40 | | SEK | 20.000.000 | 0 | 0 | % | 85,419 | 1.544.635,47 | 0,50 |
| TRY | | | | | | | | | 3.953.514,74 | 1,29 |
| XS2580209018 | 32,5000 % Corporación Andina de Fomento MTN 23/26 | | TRY | 39.170.000 | 0 | 0 | % | 98,270 | 1.176.780,09 | 0,38 |
| XS1881537127 | 0,0000 % European Bank Rec. Dev. Zero MTN 18/25 | | TRY | 35.000.000 | 0 | 0 | % | 66,028 | 706.507,82 | 0,23 |
| XS1717013335 | 0,0000 % International Finance Corp. Zero MTN 17/27 | | TRY | 21.760.000 | 0 | 0 | % | 40,103 | 266.782,01 | 0,09 |
| XS1830283591 | 0,0000 % Nordic Investment Bank Zero MTN 18/28 | | TRY | 30.000.000 | 0 | 0 | % | 35,385 | 324.534,77 | 0,11 |
| TRT131130T14 | 11,7000 % Republik Tuerkei Bonds 20/30 | | TRY | 75.000.000 | 75.000.000 | 0 | % | 64,500 | 1.478.910,05 | 0,48 |
| USD | | | | | | | | | 5.229.626,16 | 1,71 |
| XS2722281081 | 6,2500 % Israel MTN 23/27 | | USD | 1.500.000 | 3.000.000 | 1.500.000 | % | 103,796 | 1.407.594,25 | 0,46 |
| XS2730249997 | 10,5000 % Istanbul Metropolitan Municip. Notes 23/28 Reg.S | | USD | 925.000 | 925.000 | 0 | % | 106,652 | 891.900,37 | 0,29 |
| XS2404309754 | 6,8750 % National Power Co. Ukrenergo Notes 21/28 Reg.S | | USD | 1.000.000 | 0 | 0 | % | 27,250 | 246.361,09 | 0,08 |
| XS2635185437 | 5,0000 % Republik Slowenien Notes 23/33 Reg.S | | USD | 2.325.000 | 2.325.000 | 0 | % | 101,968 | 2.143.346,89 | 0,70 |
| XS2010030836 | 7,2530 % Ukraine Notes 20/35 Reg.S | | USD | 2.500.000 | 0 | 0 | % | 23,910 | 540.423,56 | 0,18 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | | | 3.626.242,63 | 1,18 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | 3.626.242,63 | 1,18 |
| EUR | | | | | | | | | 3.626.242,63 | 1,18 |
| XS2722190795 | 4,0000 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 23/43 | | EUR | 550.000 | 550.000 | 0 | % | 109,201 | 600.602,75 | 0,20 |
| XS2728486536 | 6,7500 % Piraeus Bank SA FLR MTN 23/29 ¹⁾ | | EUR | 1.025.000 | 1.025.000 | 0 | % | 104,938 | 1.075.609,38 | 0,35 |
| XS2679898184 | 4,8750 % REWE International Finance BV Notes 23/30 | | EUR | 1.100.000 | 1.100.000 | 0 | % | 106,348 | 1.169.822,50 | 0,38 |
| XS2547591474 | 3,6020 % Sumitomo Mitsui Banking Corp. Mortg.Cov. MTN 23/26 | | EUR | 775.000 | 0 | 0 | % | 100,672 | 780.208,00 | 0,25 |
| Neuemissionen | | | | | | | | | 3.830.033,11 | 1,25 |
| Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen | | | | | | | | | 3.830.033,11 | 1,25 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | 3.830.033,11 | 1,25 |
| TRY | | | | | | | | | 3.830.033,11 | 1,25 |
| TRT130733T17 | 17,8000 % Republik Tuerkei Bonds 23/33 | | TRY | 160.000.000 | 160.000.000 | 0 | % | 78,300 | 3.830.033,11 | 1,25 |

Deka-EuropaBond

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.12.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|--|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|---------------------------------------|----------|---------------------------|-------------------------|
| Nichtnotierte Wertpapiere | | | | | | | | 784.576,00 | 0,26 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | 784.576,00 | 0,26 |
| EUR | | | | | | | | 784.576,00 | 0,26 |
| PTSAOAO0000 | 2,7110 % Sata Air Acores - S.A.T.A. SA Bonds 18/28 | | EUR | 800.000 | 0 | 0 | % 98,072 | 784.576,00 | 0,26 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | EUR 281.587.583,18 | 92,00 |
| Derivate | | | | | | | | | |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | | | |
| Zins-Derivate | | | | | | | | | |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Zinsterminkontrakte | | | | | | | | -919.261,10 | -0,30 |
| | EURO Bund Future (FGBL) März 24 | | XEUR EUR | -12.000.000 | | | | -124.100,00 | -0,04 |
| | EURO Buxl Future (FGBX) März 24 | | XEUR EUR | -1.500.000 | | | | -103.500,00 | -0,03 |
| | EURO-BTP Future (FBTP) März 24 | | XEUR EUR | -10.000.000 | | | | -272.200,00 | -0,09 |
| | Long Gilt Future (FLG) März 24 | | IFEU GBP | 7.000.000 | | | | 533.741,84 | 0,17 |
| | Long Term EURO OAT Future (FOAT) März 24 | | XEUR EUR | -22.000.000 | | | | -750.200,00 | -0,25 |
| | SGX Mini Jap. Government Bond Future (SJB) März 24 | | XSES JPY | -1.850.000.000 | | | | -164.325,38 | -0,05 |
| | Two-Year US Treasury Note Future (TU) März 24 | | XCBT USD | 90.000.000 | | | | 788.242,47 | 0,26 |
| | Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB) März 24 | | XCBT USD | -4.100.000 | | | | -450.597,82 | -0,15 |
| | Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) März 24 | | XCBT USD | -8.000.000 | | | | -376.322,21 | -0,12 |
| Summe Zins-Derivate | | | | | | | | EUR -919.261,10 | -0,30 |
| Devisen-Derivate | | | | | | | | | |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte (Kauf) | | | | | | | | 3.113.825,43 | 1,01 |
| Offene Positionen | | | | | | | | | |
| | AUD/EUR 31.723.906,80 | | OTC | | | | | 247.216,44 | 0,07 |
| | CAD/EUR 41.718.112,00 | | OTC | | | | | 24.158,53 | 0,00 |
| | CHF/EUR 3.546.000,00 | | OTC | | | | | 124.337,34 | 0,04 |
| | CHF/JPY 6.000.000,00 | | OTC | | | | | 151.640,25 | 0,05 |
| | CNH/USD 54.028.070,40 | | OTC | | | | | 6.207,97 | 0,00 |
| | CZK/EUR 59.388.000,00 | | OTC | | | | | -176,29 | 0,00 |
| | DKK/EUR 53.312.980,00 | | OTC | | | | | 218,22 | 0,00 |
| | EGP/USD 184.800.000,00 | | OTC | | | | | -402.633,80 | -0,13 |
| | GBP/EUR 28.889.000,00 | | OTC | | | | | 73.627,81 | 0,03 |
| | HUF/EUR 575.901.300,00 | | OTC | | | | | -1.009,54 | 0,00 |
| | JPY/EUR 1.044.582.464,00 | | OTC | | | | | 40.668,72 | 0,01 |
| | JPY/USD 1.557.816.012,00 | | OTC | | | | | 228.671,11 | 0,08 |
| | MXN/USD 581.734.108,35 | | OTC | | | | | 891.330,25 | 0,29 |
| | NOK/EUR 330.798.868,00 | | OTC | | | | | 866.452,44 | 0,29 |
| | PLN/EUR 115.000.000,00 | | OTC | | | | | 243.824,35 | 0,08 |
| | SEK/EUR 43.575.000,00 | | OTC | | | | | 132.801,20 | 0,04 |
| | TWD/USD 1.307.492.192,00 | | OTC | | | | | 693.950,57 | 0,23 |
| | USD/EUR 57.150.053,10 | | OTC | | | | | -207.460,14 | -0,07 |
| Devisenterminkontrakte (Verkauf) | | | | | | | | -1.936.005,14 | -0,62 |
| Offene Positionen | | | | | | | | | |
| | AUD/EUR 31.470.910,56 | | OTC | | | | | -205.332,35 | -0,07 |
| | AUD/NZD 5.200.000,00 | | OTC | | | | | 9.979,96 | 0,00 |
| | CAD/EUR 38.122.560,32 | | OTC | | | | | -18.143,60 | -0,01 |
| | CHF/JPY 6.000.000,00 | | OTC | | | | | -58.985,21 | -0,02 |
| | CNH/USD 34.193.385,60 | | OTC | | | | | -12.844,26 | 0,00 |
| | CZK/EUR 435.349.316,50 | | OTC | | | | | 178.964,95 | 0,05 |
| | EGP/USD 196.955.000,00 | | OTC | | | | | 103.072,46 | 0,03 |
| | GBP/EUR 59.200,00 | | OTC | | | | | -72,07 | 0,00 |
| | HUF/EUR 4.595.435.000,00 | | OTC | | | | | -34,17 | 0,00 |
| | JPY/EUR 1.508.431.456,00 | | OTC | | | | | 87.365,69 | 0,03 |
| | JPY/USD 1.567.769.796,00 | | OTC | | | | | -292.276,35 | -0,10 |
| | KZT/USD 1.271.127.600,00 | | OTC | | | | | -62.692,02 | -0,02 |
| | MXN/EUR 124.215.000,00 | | OTC | | | | | -45.515,33 | -0,01 |
| | MXN/USD 599.925.064,61 | | OTC | | | | | -696.419,82 | -0,22 |
| | NOK/EUR 326.422.348,00 | | OTC | | | | | -992.821,50 | -0,32 |
| | NOK/SEK 29.000.000,00 | | OTC | | | | | 11.922,62 | 0,00 |
| | RON/EUR 1.455.000,00 | | OTC | | | | | -594,72 | 0,00 |
| | TRY/EUR 189.540.000,00 | | OTC | | | | | 63.566,44 | 0,02 |
| | TWD/USD 958.830.882,00 | | OTC | | | | | -328.924,12 | -0,10 |
| | USD/EUR 31.812.444,13 | | OTC | | | | | 323.778,26 | 0,12 |
| Optionsrechte | | | | | | | | 3.450.387,18 | 1,12 |
| Optionsrechte auf Devisen (Kauf) | | | | | | | | 5.635.117,60 | 1,84 |
| | CALL AUD/NZD 1,08500 30.01.2024 | | OTC AUD | 20.000.000 | | | % 0,298 | 36.795,93 | 0,01 |
| | CALL EUR/USD 1,10000 04.01.2024 | | OTC EUR | 26.000.000 | | | % 0,717 | 186.524,00 | 0,06 |
| | CALL NOK/SEK 0,98000 17.01.2024 | | OTC NOK | 145.000.000 | | | % 1,045 | 134.566,61 | 0,04 |
| | CALL USD/CAD 1,34750 19.01.2024 | | OTC USD | 25.000.000 | | | % 0,084 | 18.931,83 | 0,01 |
| | CALL USD/CNY 7,00000 09.07.2026 | | OTC USD | 20.000.000 | | | % 3,224 | 582.985,26 | 0,19 |
| | CALL USD/HKD 7,70000 23.09.2025 | | OTC USD | 15.000.000 | | | % 0,978 | 132.628,15 | 0,04 |
| | CALL USD/HKD 7,82000 22.04.2024 | | OTC USD | 11.400.000 | | | % 0,091 | 9.393,02 | 0,00 |
| | CALL USD/TRY 45,00000 13.06.2025 | | OTC USD | 7.000.000 | | | % 11,139 | 704.955,25 | 0,23 |
| | CALL USD/TWD 27,00000 30.06.2028 | | OTC USD | 18.962.963 | | | % 5,065 | 868.308,61 | 0,28 |
| | CALL USD/TWD 30,00000 28.03.2024 | | OTC USD | 28.000.000 | | | % 1,772 | 448.668,29 | 0,15 |
| | PUT EUR/JPY 155,00000 09.01.2024 | | OTC EUR | 16.000.000 | | | % 0,204 | 32.576,00 | 0,01 |

Deka-EuropaBond

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.12.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|---|---------------------|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|--------------------------|-------------------------|
| PUT EUR/RON 5,15000 18.01.2024 | | OTC | EUR | 6.500.000 | | | % 3,422 | 222.404,00 | 0,07 |
| PUT EUR/TRY 41,00000 20.06.2028 | | OTC | EUR | 20.000.000 | | | % 0,898 | 179.640,00 | 0,06 |
| PUT CHF/JPY 164,00000 08.02.2024 | | OTC | CHF | 10.000.000 | | | % 0,478 | 51.326,41 | 0,02 |
| PUT GBP/JPY 173,00000 24.01.2024 | | OTC | GBP | 13.200.000 | | | % 0,195 | 29.571,19 | 0,01 |
| PUT USD/MXN 22,00000 20.06.2028 | | OTC | USD | 16.000.000 | | | % 11,759 | 1.700.909,50 | 0,56 |
| PUT USD/TRY 36,00000 13.06.2025 | | OTC | USD | 7.000.000 | | | % 2,010 | 127.172,05 | 0,04 |
| PUT USD/TRY 21,00000 16.01.2024 | | OTC | USD | 5.000.000 | | | % 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| PUT USD/TRY 34,00000 19.12.2024 | | OTC | USD | 5.000.000 | | | % 1,845 | 83.414,70 | 0,03 |
| PUT USD/TWD 28,80000 28.03.2024 | | OTC | USD | 28.000.000 | | | % 0,333 | 84.346,80 | 0,03 |
| Optionsrechte auf Devisen (Verkauf) | | | | | | | | -2.184.730,42 | -0,72 |
| CALL CHF/JPY 170,00000 08.02.2024 | | OTC | CHF | -10.000.000 | | | % 1,049 | -112.720,40 | -0,04 |
| CALL EUR/JPY 161,00000 09.01.2024 | | OTC | EUR | -16.000.000 | | | % 0,014 | -2.183,68 | 0,00 |
| CALL USD/CNY 7,50000 09.07.2026 | | OTC | USD | -20.000.000 | | | % 1,389 | -251.098,45 | -0,08 |
| CALL USD/HKD 7,75000 23.09.2025 | | OTC | USD | -15.000.000 | | | % 0,603 | -81.814,48 | -0,03 |
| CALL USD/TRY 39,00000 13.06.2025 | | OTC | USD | -7.000.000 | | | % 16,506 | -1.044.595,43 | -0,34 |
| CALL USD/TRY 42,50000 19.12.2024 | | OTC | USD | -5.000.000 | | | % 7,261 | -328.229,82 | -0,11 |
| CALL USD/TWD 32,00000 30.06.2028 | | OTC | USD | -16.000.000 | | | % 1,858 | -268.807,52 | -0,09 |
| PUT GBP/JPY 165,00000 24.01.2024 | | OTC | GBP | -13.200.000 | | | % 0,021 | -3.264,53 | 0,00 |
| PUT NOK/SEK 0,95500 17.01.2024 | | OTC | NOK | -145.000.000 | | | % 0,060 | -7.669,31 | 0,00 |
| PUT USD/TWD 28,80000 28.03.2024 | | OTC | USD | -28.000.000 | | | % 0,333 | -84.346,80 | -0,03 |
| Summe Devisen-Derivate | | | | | | | | EUR 4.628.207,47 | 1,51 |
| Swaps | | | | | | | | | |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Zinsswaps (Erhalten/Zahlen) | | | | | | | | 2.370.150,86 | 0,78 |
| IRS 0,195% CHF/SARON +0,0741% CHF / JPM_LDN 15.04.2027 | | OTC | CHF | 12.000.000 | | | | -433.955,02 | -0,14 |
| IRS 0,331% EUR / EURIBORM06 EUR / MERRILL_LDN 15.08.2025 | | OTC | EUR | 40.000.000 | | | | -2.227.792,00 | -0,73 |
| IRS 1,872% CHF / SARON CHF / DBK_FRA 02.10.2033 | | OTC | CHF | 4.500.000 | | | | 324.801,12 | 0,11 |
| IRS 3,73% CZK / PRIBORM03 CZK / JPMORGAN_FRA 08.02.2024 | | OTC | CZK | 1.200.000.000 | | | | 954.955,60 | 0,31 |
| IRS 4,735% CZK / PRIBORM06 CZK / DBK_FRA 04.05.2028 | | OTC | CZK | 330.000.000 | | | | 860.825,06 | 0,28 |
| IRS 4,175% PLN / WIBORM06 PLN / DBK_FRA 12.09.2028 | | OTC | PLN | 126.000.000 | | | | -458.533,97 | -0,15 |
| IRS 4,47% GBP / SONIA GBP / BNP_PAR 25.09.2028 | | OTC | GBP | 13.000.000 | | | | 631.566,93 | 0,21 |
| IRS 5,0685% GBP / SONIA GBP / BNP_PAR 25.09.2025 | | OTC | GBP | 21.000.000 | | | | 338.332,42 | 0,11 |
| IRS EURIBORM06 EUR / 0,473% EUR / GOLDINT_LDN 15.02.2025 | | OTC | EUR | 56.000.000 | | | | 2.379.950,72 | 0,78 |
| Credit Default Swaps (CDS) | | | | | | | | -1.614.592,42 | -0,53 |
| Protection Buyer | | | | | | | | -1.614.592,42 | -0,53 |
| CDS 549300000QCVSQPGD58 / BNP_PAR 20.06.2027 | | OTC | USD | 7.500.000 | | | | -171.013,70 | -0,06 |
| CDS CDX.NA.HY. S41 V2 5Y / BNP_PAR 20.12.2028 | | OTC | USD | 8.000.000 | | | | -430.096,52 | -0,14 |
| CDS ECTRVYYCEFF89VWYS6K36 / CITIGLMD_FRA 20.06.2027 | | OTC | USD | 10.000.000 | | | | -221.777,60 | -0,07 |
| CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S40 V1 5Y / CITIGLMD_FRA 20.12.2028 | | OTC | EUR | 10.000.000 | | | | -791.704,60 | -0,26 |
| Inflation Swaps (IFS) | | | | | | | | | |
| Protection Seller | | | | | | | | -102.114,97 | -0,03 |
| IFS Euro HICP Ex-Tobacco EUR / 2,167% EUR / CITIGLMD_FRA 15.12.2028 | | OTC | STK | 13.400.000 | | | | -102.114,97 | -0,03 |
| Summe Swaps | | | | | | | | EUR 653.443,47 | 0,22 |
| Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | | | | | | | | | |
| Bankguthaben | | | | | | | | | |
| EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | EUR | 14.380.873,21 | | | % 100,000 | 14.380.873,21 | 4,71 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | CZK | 1,00 | | | % 100,000 | 0,04 | 0,00 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | HUF | 0,39 | | | % 100,000 | 0,00 | 0,00 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | SEK | 0,04 | | | % 100,000 | 0,00 | 0,00 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | ILS | 0,02 | | | % 100,000 | 0,00 | 0,00 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | JPY | 47.386.852,00 | | | % 100,000 | 302.733,35 | 0,10 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | TRY | 6.117,10 | | | % 100,000 | 187,01 | 0,00 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | UAH | 47.643.750,00 | | | % 100,000 | 1.132.340,83 | 0,37 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | USD | 310.666,91 | | | % 100,000 | 280.866,93 | 0,09 |
| Summe Bankguthaben | | | | | | | | EUR 16.097.001,37 | 5,27 |
| Geldmarktpapiere | | | | | | | | | |
| HUF | | | | | | | | 2.638.405,00 | 0,86 |
| HU0000362256 16,0000 % Hungarian Export-Import Bk PLC Bonds 23/24 | | | HUF | 1.000.000.000,00 | 0 | 0 | % 100,872 | 2.638.405,00 | 0,86 |
| Summe Geldmarktpapiere | | | | | | | | EUR 2.638.405,00 | 0,86 |
| Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | | | | | | | | EUR 18.735.406,37 | 6,13 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | |
| Zinsansprüche | | | | | | | | 4.379.255,52 | 1,43 |
| Einschüsse (Initial Margins) | | | | | | | | 3.047.932,36 | 1,00 |
| Forderungen aus Wertpapier-Darlehen | | | | | | | | 901,06 | 0,00 |
| Forderungen aus Anteilscheingeschäften | | | | | | | | 58.692,40 | 0,02 |

Deka-EuropaBond

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.12.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------|-----------------------|-------------------------|
| | Forderungen aus Cash Collateral | | EUR | 4.240.000,00 | | | | 4.240.000,00 | 1,39 |
| | Summe Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | EUR | 11.726.781,34 | 3,84 |
| | Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme | | | | | | | | |
| | Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | |
| | DekaBank Deutsche Girozentrale | | GBP | -233.300,00 | | | % 100,000 | -268.713,79 | -0,09 |
| | DekaBank Deutsche Girozentrale | | MXN | -0,01 | | | % 100,000 | 0,00 | -0,09 |
| | Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme | | | | | | EUR | -268.713,79 | -0,09 |
| | Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| | Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen | | EUR | -297,36 | | | | -297,36 | 0,00 |
| | Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften | | EUR | -105.748,00 | | | | -105.748,00 | -0,03 |
| | Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten | | EUR | -316.802,59 | | | | -316.802,59 | -0,10 |
| | Verbindlichkeiten aus Cash Collateral | | EUR | -9.720.000,00 | | | | -9.720.000,00 | -3,18 |
| | Summe Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | EUR | -10.142.847,95 | -3,31 |
| | Fondsvermögen | | | | | | EUR | 306.000.598,99 | 100,00 |
| | Umlaufende Anteile Klasse CF | | | | | | STK | 267.705,000 | |
| | Umlaufende Anteile Klasse TF | | | | | | STK | 8.182.794,000 | |
| | Umlaufende Anteile Klasse AV | | | | | | STK | 100,000 | |
| | Anteilwert Klasse CF | | | | | | EUR | 94,52 | |
| | Anteilwert Klasse TF | | | | | | EUR | 34,30 | |
| | Anteilwert Klasse AV | | | | | | EUR | 78,21 | |

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

¹⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Nominal in Währung | Wertpapier-Darlehen in EUR | | gesamt |
|--|-------------------------------|----------------------------|----------------------|----------------------|
| | | befristet | unbefristet | |
| Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert) | | | | |
| Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: | | | | |
| 4,3750 % Bayerische Landesbank MT IHS 23/28 | EUR 2.600.000 | | 2.669.303,00 | |
| 0,6250 % Großbritannien Treasury Stock 20/50 | GBP 1.200.000 | | 603.814,75 | |
| 2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33 | EUR 2.700.000 | | 2.771.253,00 | |
| 2,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1551 23/32 | EUR 1.769.000 | | 1.809.952,35 | |
| 6,7500 % Piraeus Bank SA FLR MTN 23/29 | EUR 300.000 | | 314.812,50 | |
| 3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43 | EUR 1.625.000 | | 1.694.728,75 | |
| 2,3750 % Republik Polen MTN 16/36 | EUR 1.159.000 | | 1.019.363,68 | |
| 1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42 | EUR 3.000.000 | | 2.160.150,00 | |
| 5,5000 % Republik Rumänien MTN 23/28 Reg.S | EUR 1.250.000 | | 1.284.375,00 | |
| Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen: | EUR | | 14.327.753,03 | 14.327.753,03 |

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.12.2023

| | | | |
|-------------------------------|-------|-------------|----------------|
| Italien, Lira | (ITL) | 1.936,27000 | = 1 Euro (EUR) |
| Vereinigtes Königreich, Pfund | (GBP) | 0,86821 | = 1 Euro (EUR) |
| Dänemark, Kronen | (DKK) | 7,45360 | = 1 Euro (EUR) |
| Norwegen, Kronen | (NOK) | 11,26130 | = 1 Euro (EUR) |
| Schweden, Kronen | (SEK) | 11,06015 | = 1 Euro (EUR) |
| Schweiz, Franken | (CHF) | 0,93071 | = 1 Euro (EUR) |
| Türkei, Lira (Neu) | (TRY) | 32,70990 | = 1 Euro (EUR) |
| Polen, Zloty | (PLN) | 4,34440 | = 1 Euro (EUR) |
| Tschechische Republik, Kronen | (CZK) | 24,69750 | = 1 Euro (EUR) |
| Ungarn, Forint | (HUF) | 382,32000 | = 1 Euro (EUR) |
| Rumänien, Leu | (RON) | 4,97420 | = 1 Euro (EUR) |
| Ukraine, Hryvnia | (UAH) | 42,07545 | = 1 Euro (EUR) |
| Kasachstan, Tenge | (KZT) | 503,92000 | = 1 Euro (EUR) |
| Ägypten, Pfund | (EGP) | 34,44280 | = 1 Euro (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar | (USD) | 1,10610 | = 1 Euro (EUR) |
| Kanada, Dollar | (CAD) | 1,46423 | = 1 Euro (EUR) |
| Mexiko, Peso | (MXN) | 18,72975 | = 1 Euro (EUR) |
| Israel, Scheckel | (ILS) | 4,01100 | = 1 Euro (EUR) |
| Japan, Yen | (JPY) | 156,53000 | = 1 Euro (EUR) |
| Taiwan, Neue Dollar | (TWD) | 33,83005 | = 1 Euro (EUR) |
| Australien, Dollar | (AUD) | 1,62138 | = 1 Euro (EUR) |
| Neuseeland, Dollar | (NZD) | 1,74595 | = 1 Euro (EUR) |
| Offshore Renminbi | (CNH) | 7,87050 | = 1 Euro (EUR) |

Marktschlüssel Terminbörsen

| | |
|------|---|
| IFEU | London - ICE Futures Europe |
| XEUR | Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich) |
| XSES | Singapur - Singapore Exchange (SGX) |
| XCBT | Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT) |

OTC Over-the-Counter

Deka-EuropaBond

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 bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|-------------------------------------|---|---|----------------|-------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| EUR | | | | |
| XS2631869232 | 4,3750 % 2i Rete Gas S.p.A. MTN 23/33 | EUR | 0 | 1.875.000 |
| XS2590758665 | 3,9500 % AT & T Inc. Notes 23/31 | EUR | 2.000.000 | 2.000.000 |
| FR001400F323 | 5,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 23/33 | EUR | 0 | 800.000 |
| FR001400A3G4 | 2,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Non-Pref. MTN 22/29 | EUR | 0 | 1.500.000 |
| XS2675225531 | 4,2500 % British Telecommunications PLC MTN 23/33 | EUR | 2.250.000 | 2.250.000 |
| XS1839682116 | 3,5000 % Bulgarian Energy Holdings EAD Bonds 18/25 | EUR | 2.200.000 | 2.200.000 |
| XS2536817484 | 4,6250 % Bulgarien MTN 22/34 | EUR | 0 | 2.000.000 |
| XS2630417124 | 6,1250 % Caixabank S.A. FLR MTN 23/34 | EUR | 0 | 3.100.000 |
| DE000CZ439B6 | 5,2500 % Commerzbank AG FLR MTN S.1018 23/29 | EUR | 600.000 | 600.000 |
| EU000A2SCAK5 | 3,3750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 23/38 | EUR | 3.000.000 | 3.000.000 |
| EU000A3K4DT4 | 2,5000 % Europaeische Union MTN 22/52 | EUR | 325.000 | 2.375.000 |
| EU000A3K4DY4 | 3,0000 % Europaeische Union MTN 22/53 | EUR | 0 | 3.025.000 |
| EU000A3K4EL9 | 4,0000 % Europaeische Union MTN 23/44 | EUR | 900.000 | 900.000 |
| XS2724457457 | 5,1250 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 23/29 | EUR | 1.400.000 | 1.400.000 |
| GR0128017747 | 4,3750 % Griechenland Notes 23/38 | EUR | 3.200.000 | 3.200.000 |
| LU2591860569 | 3,0000 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 23/33 | EUR | 0 | 1.750.000 |
| LU2591861021 | 3,2500 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 23/43 | EUR | 0 | 2.250.000 |
| XS2673969650 | 5,2500 % Intl. Distributions Svcs. PLC Notes 23/28 | EUR | 2.050.000 | 2.050.000 |
| BE0002935162 | 4,3750 % KBC Groep N.V. FLR MTN 23/30 | EUR | 0 | 900.000 |
| BE0000356650 | 2,7500 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 22/39 | EUR | 0 | 1.750.000 |
| BE0000359688 | 3,4500 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 23/43 | EUR | 0 | 2.700.000 |
| ES0000012K20 | 0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32 | EUR | 3.600.000 | 3.600.000 |
| ES0000012K46 | 1,9000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/52 | EUR | 0 | 2.675.000 |
| ES0000012L52 | 3,1500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33 | EUR | 0 | 1.000.000 |
| XS2586942448 | 2,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33 | EUR | 0 | 800.000 |
| DE000LB2CPE5 | 4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. FLR Nach. IHS AT1 19/Und. | EUR | 1.800.000 | 1.800.000 |
| XS2597999452 | 4,7500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA FLR Pref. MTN 23/28 | EUR | 0 | 1.300.000 |
| FR001400H7V7 | 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33 | EUR | 3.500.000 | 5.875.000 |
| FR001400FTH3 | 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/54 | EUR | 0 | 1.525.000 |
| FR001400L834 | 3,5000 % Rep. Frankreich OAT 23/33 | EUR | 3.750.000 | 3.750.000 |
| FI4000557525 | 2,8750 % Republik Finnland Bonds 23/29 | EUR | 3.000.000 | 3.000.000 |
| FI4000550249 | 3,0000 % Republik Finnland Bonds 23/33 | EUR | 0 | 3.000.000 |
| FI4000546528 | 2,7500 % Republik Finnland Bonds 23/38 | EUR | 0 | 1.000.000 |
| IT0005433195 | 0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/37 | EUR | 0 | 3.000.000 |
| IT000542359 | 4,0000 % Republik Italien B.T.P. 23/31 | EUR | 0 | 2.800.000 |
| XS2648672660 | 3,8750 % Republik Lettland MTN 23/33 | EUR | 1.425.000 | 1.425.000 |
| XS2582522681 | 6,9600 % Republik Nordmazedonien Bonds 23/27 Reg.S | EUR | 0 | 950.000 |
| AT000A2Y8G4 | 1,8500 % Republik Oesterreich MTN 22/49 | EUR | 850.000 | 850.000 |
| PTOTEYOE0031 | 1,6500 % Republik Portugal Obr. 22/32 | EUR | 0 | 3.500.000 |
| XS2538440780 | 5,0000 % Republik Rumaenien MTN 22/26 Reg.S | EUR | 0 | 1.350.000 |
| XS2689948078 | 6,3750 % Republik Rumaenien MTN 23/33 Reg.S | EUR | 2.425.000 | 2.425.000 |
| XS2610236445 | 4,1250 % Republik Zypern MTN 23/33 | EUR | 0 | 2.100.000 |
| XS2584685387 | 4,1250 % RWE AG MTN 23/35 | EUR | 2.500.000 | 2.500.000 |
| SK4000019857 | 1,0000 % Slowakei Anl. 21/51 | EUR | 0 | 1.700.000 |
| SK4000023230 | 3,6250 % Slowakei Anl. 23/33 | EUR | 0 | 2.700.000 |
| SK4000022539 | 3,7500 % Slowakei Anl. 23/35 | EUR | 0 | 2.500.000 |
| SK4000022547 | 4,0000 % Slowakei Anl. 23/43 | EUR | 0 | 1.000.000 |
| XS2579319513 | 3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA MTN 23/27 | EUR | 0 | 1.525.000 |
| SK4000022505 | 5,9520 % Tatra Banka AS FLR MTN 23/26 | EUR | 0 | 900.000 |
| XS2696803696 | 4,0000 % Telenor ASA MTN 23/30 | EUR | 1.225.000 | 1.225.000 |
| XS2696803852 | 4,2500 % Telenor ASA MTN 23/35 | EUR | 1.125.000 | 1.125.000 |
| XS2629026845 | 3,6250 % The Export-Import Bk of Korea MTN 23/30 Reg.S | EUR | 0 | 3.200.000 |
| XS2623871196 | 3,3750 % The Korea Development Bank MTN 23/28 | EUR | 0 | 3.200.000 |
| XS2655865546 | 3,8500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 23/30 | EUR | 1.925.000 | 1.925.000 |
| XS2680932907 | 5,3750 % Ungarn Bonds 23/33 | EUR | 1.775.000 | 1.775.000 |
| XS2617457127 | 4,6250 % Volkswagen Bank GmbH MTN 23/31 | EUR | 3.000.000 | 3.000.000 |
| GBP | | | | |
| XS0097283096 | 5,7500 % British Telecommunications PLC Bonds 99/28 | GBP | 0 | 2.000.000 |
| GB00BPCJD997 | 3,7500 % Großbritannien Zero Treasury Bills 23/53 | GBP | 0 | 1.173.000 |
| HUF | | | | |
| XS2547999552 | 0,0000 % Asian Development Bank Zero MTN 22/32 | HUF | 0 | 1.000.000.000 |
| XS2243670150 | 2,5200 % Black Sea Trade & Developmt Bk MTN 20/23 | HUF | 0 | 1.500.000.000 |
| NOK | | | | |
| NO0011146367 | 2,2200 % Stadt Oslo Anl. 21/31 | NOK | 0 | 40.000.000 |
| NO0012733429 | 4,4500 % Stadt Oslo Bonds 22/32 | NOK | 0 | 24.000.000 |
| PLN | | | | |
| XS2546395166 | 0,0000 % Asian Development Bank Zero MTN 22/37 | PLN | 0 | 17.000.000 |
| USD | | | | |
| US05946KAN19 | 7,8830 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. FLR Notes 23/34 | USD | 2.200.000 | 2.200.000 |
| XS2571923007 | 7,1250 % Republik Rumaenien MTN 23/33 Reg.S | USD | 0 | 2.000.000 |
| USY7329CAA37 | 5,0450 % ROP Sukuk Trust Notes 23/29 Reg.S | USD | 950.000 | 950.000 |

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere
 Verzinsliche Wertpapiere

EUR

Deka-EuropaBond

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|--|---|---|----------------|-------------------|
| XS2723577149 | 4,5000 % Carrier Global Corp. Notes 23/32 Reg.S | EUR | 525.000 | 525.000 |
| XS2673437484 | 4,3890 % East Japan Railway Co. MTN 23/43 | EUR | 1.750.000 | 1.750.000 |
| XS2551903425 | 4,1250 % Honeywell International Inc. Notes 22/34 | EUR | 2.600.000 | 2.600.000 |
| XS1197270819 | 1,6250 % Mondelez International Inc. Notes 15/27 | EUR | 2.500.000 | 2.500.000 |
| XS2619991883 | 6,5000 % Republik San Marino Obbl. 23/27 | EUR | 0 | 2.150.000 |
| XS2676395317 | 4,5000 % Sartorius Finance B.V. Notes 23/32 | EUR | 1.100.000 | 1.100.000 |
| XS2676395408 | 4,8750 % Sartorius Finance B.V. Notes 23/35 | EUR | 700.000 | 700.000 |
| XS2601459162 | 4,2500 % Siemens Energy Finance B.V. Notes 23/29 | EUR | 0 | 2.500.000 |
| PLN | | | | |
| XS2549711898 | 0,0000 % Asian Development Bank Zero MTN 22/42 | PLN | 0 | 17.000.000 |
| PL0000114393 | 3,7500 % Republik Polen Bonds S.PS0527 21/27 | PLN | 0 | 15.000.000 |
| RON | | | | |
| RO52CQA3C829 | 8,2500 % Republik Rumänien Bonds 22/32 | RON | 0 | 10.000.000 |
| Neuemissionen | | | | |
| Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen | | | | |
| USD | | | | |
| PAL63444B5A9 | 6,3750 % Republik Panama Bonds 23/33 | USD | 2.000.000 | 2.000.000 |
| Geldmarktpapiere | | | | |
| PLN | | | | |
| XS2525878703 | 8,8000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/23 | PLN | 0 | 10.000.000 |

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000 |
|---|------------------------------|-------------------|
| Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.) | | |
| Terminkontrakte | | |
| Zinsterminkontrakte | | |
| Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), Long Gilt Future (FLG), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY)) | EUR | 269.064 |
| Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO-BTP Future (FBTP), Long Term EURO OAT Future (FOAT), SGX Mini Jap. Government Bond Future (SJB), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY)) | EUR | 251.967 |
| Optionsrechte | | |
| Optionsrechte auf Swaps (Swaptions) | | |
| Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S39 V1 5Y) | EUR | 239 |
| Optionsrechte auf Zins-Derivate | | |
| Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte | | |
| Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL)) | EUR | 108.375 |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL)) | EUR | 110.015 |
| Währungsderivate | | |
| Optionsrechte auf Devisen-Derivate | | |
| Optionsrechte auf Devisen | | |
| Gekaufte Kaufoptionen (Call): | | |
| AUD/JPY | EUR | 1.013.337 |
| AUD/USD | EUR | 19.977 |
| EUR/GBP | EUR | 21.875 |
| EUR/PLN | EUR | 128.030 |
| EUR/USD | EUR | 39.370 |
| NOK/SEK | EUR | 14.466 |
| USD/CHF | EUR | 18.686 |
| USD/HUF | EUR | 9.572.915 |
| USD/ILS | EUR | 40.715 |
| USD/INR | EUR | 5.490.388 |
| USD/KRW | EUR | 39.027.982 |
| USD/MXN | EUR | 854.508 |
| USD/PHP | EUR | 1.707.082 |
| USD/SEK | EUR | 150.774 |
| USD/ZAR | EUR | 859.715 |
| Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): | | |
| AUD/JPY | EUR | 951.922 |
| AUD/USD | EUR | 17.695 |
| EUR/AUD | EUR | 19.860 |
| EUR/CAD | EUR | 65.390 |
| EUR/NOK | EUR | 236.000 |
| EUR/PLN | EUR | 40.950 |
| EUR/USD | EUR | 69.775 |
| GBP/SEK | EUR | 394.089 |
| GBP/USD | EUR | 80.636 |
| MXN/JPY | EUR | 84.466 |
| USD/CAD | EUR | 31.188 |
| USD/CNY | EUR | 151.378 |

Deka-EuropaBond

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000 |
|--|---------------------------------|---------------------|
| USD/IDR | EUR | 642.502.930 |
| USD/ILS | EUR | 44.929 |
| USD/JPY | EUR | 16.037.878 |
| USD/MXN | EUR | 533.515 |
| USD/THB | EUR | 502.224 |
| USD/TRY | EUR | 491.389 |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call): | | |
| AUD/JPY | EUR | 992.865 |
| AUD/USD | EUR | 19.976 |
| EUR/USD | EUR | 16.275 |
| USD/CHF | EUR | 28.348 |
| USD/ILS | EUR | 42.830 |
| USD/INR | EUR | 5.490.388 |
| USD/KRW | EUR | 23.546.635 |
| USD/MXN | EUR | 603.508 |
| USD/PHP | EUR | 1.706.756 |
| USD/SEK | EUR | 155.082 |
| USD/ZAR | EUR | 863.417 |
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): | | |
| AUD/USD | EUR | 8.603 |
| EUR/NOK | EUR | 229.000 |
| GBP/USD | EUR | 22.137 |
| MXN/JPY | EUR | 81.217 |
| USD/IDR | EUR | 642.424.198 |
| USD/JPY | EUR | 11.906.894 |
| USD/MXN | EUR | 357.210 |
| USD/TRY | EUR | 468.427 |
| Devisentermingeschäfte | | |
| Devisenterminkontrakte (Verkauf) | | |
| Verkauf von Devisen auf Termin: | | |
| AUD/EUR | EUR | 1.085 |
| AUD/NZD | EUR | 9.130 |
| AUD/USD | EUR | 46.111 |
| CAD/EUR | EUR | 13.405 |
| CAD/USD | EUR | 42.308 |
| CHF/EUR | EUR | 22.260 |
| CNH/EUR | EUR | 61 |
| CNH/USD | EUR | 53.149 |
| CZK/EUR | EUR | 70.506 |
| DKK/EUR | EUR | 29.760 |
| GBP/EUR | EUR | 162.234 |
| GBP/SEK | EUR | 51.869 |
| GBP/USD | EUR | 72.195 |
| HUF/EUR | EUR | 75.663 |
| HUF/USD | EUR | 24.704 |
| IDR/USD | EUR | 8.194 |
| JPY/EUR | EUR | 1.859 |
| JPY/USD | EUR | 19.187 |
| KRW/USD | EUR | 39.729 |
| KZT/USD | EUR | 20.255 |
| MXN/EUR | EUR | 7.330 |
| MXN/USD | EUR | 53.332 |
| NOK/EUR | EUR | 20.346 |
| NOK/SEK | EUR | 32.107 |
| NZD/EUR | EUR | 4.579 |
| PLN/EUR | EUR | 162.280 |
| RON/EUR | EUR | 10.684 |
| SEK/EUR | EUR | 27.011 |
| SEK/NOK | EUR | 27.965 |
| SEK/USD | EUR | 8.713 |
| THB/USD | EUR | 3.891 |
| TRY/EUR | EUR | 213 |
| TRY/USD | EUR | 3.513 |
| TWD/USD | EUR | 176.501 |
| USD/EUR | EUR | 199.117 |
| ZAR/EUR | EUR | 100 |
| ZAR/USD | EUR | 18.623 |
| Devisenterminkontrakte (Kauf) | | |
| Kauf von Devisen auf Termin: | | |
| AUD/EUR | EUR | 1.039 |
| AUD/NZD | EUR | 18.313 |
| AUD/USD | EUR | 38.081 |
| CAD/EUR | EUR | 13.236 |
| CAD/USD | EUR | 42.619 |
| CHF/EUR | EUR | 18.581 |
| CNH/EUR | EUR | 704 |
| CNH/USD | EUR | 53.298 |
| CZK/EUR | EUR | 76.423 |
| DKK/EUR | EUR | 23.303 |
| GBP/EUR | EUR | 129.441 |
| GBP/SEK | EUR | 51.756 |
| GBP/USD | EUR | 72.414 |

Deka-EuropaBond

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000 |
|--|---------------------------------|---------------------|
| HUF/EUR | EUR | 87.936 |
| HUF/USD | EUR | 30.493 |
| IDR/USD | EUR | 8.194 |
| JPY/EUR | EUR | 2.014 |
| JPY/USD | EUR | 19.223 |
| KRW/USD | EUR | 32.422 |
| KZT/USD | EUR | 20.255 |
| MXN/EUR | EUR | 15.296 |
| MXN/USD | EUR | 46.807 |
| NOK/EUR | EUR | 20.032 |
| NOK/SEK | EUR | 25.064 |
| NZD/EUR | EUR | 4.585 |
| PLN/EUR | EUR | 140.203 |
| RON/EUR | EUR | 13.178 |
| SEK/EUR | EUR | 17.847 |
| SEK/NOK | EUR | 13.982 |
| SEK/USD | EUR | 8.786 |
| THB/USD | EUR | 3.890 |
| TRY/EUR | EUR | 4.403 |
| TRY/USD | EUR | 3.804 |
| TWD/USD | EUR | 176.501 |
| USD/EUR | EUR | 201.959 |
| ZAR/EUR | EUR | 136 |
| ZAR/USD | EUR | 15.681 |
| Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen) | | |
| Zinsswaps | EUR | 9.093 |
| (Erhalten/Zahlen) | | |
| (Basiswert(e): IRS WIBORM06 PLN / 4.589% PLN) | | |
| Credit Default Swaps (CDS) | | |
| Protection Buyer: | EUR | 10.000 |
| (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S40 V1 5Y) | | |
| Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes): | | |
| befristet | EUR | 6.313 |
| (Basiswert(e): 1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42, 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33) | | |
| unbefristet | EUR | 89.516 |
| (Basiswert(e): 0,3750 % Muenchener Hypothekenbank MTN IHS S.1927 21/29, 0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40, 1,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/50, 1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42, 2,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33, 2,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1551 23/32, 2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33, 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1552 23/53, 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1561 23/33, 3,0000 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 23/33, 3,0000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 23/33, 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33, 3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43, 3,1250 % Europaeische Union MTN 23/30, 3,2500 % Europaeische Union MTN 23/34, 3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MT Hyp.-Pfe. 23/28, 3,6250 % Slowakei Anl. 23/33, 3,6250 % The Export-Import Bk of Korea MTN 23/30 Reg.S, 3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA MTN 23/27, 3,8500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 23/30, 3,8750 % Fluvius System Operator CVBA MTN 23/31, 3,8750 % ICCREA Banca - Ist.C.d.Cred.C. MT Cov. Bds 23/29, 4,0000 % Telenor ASA MTN 23/30, 4,2500 % Siemens Energy Finance B.V. Notes 23/29, 4,2500 % Telenor ASA MTN 23/35, 4,3750 % Bayerische Landesbank MT IHS 23/28, 4,5000 % ElectroLux, AB MTN 23/28, 4,5000 % Lb.Hessen-Thueringen GZ FLR MTN S.H354 22/32, 4,5000 % Sartorius Finance B.V. Notes 23/32, 4,6250 % Volkswagen Bank GmbH MTN 23/31, 4,8750 % Sartorius Finance B.V. Notes 23/35, 5,2500 % Commerzbank AG FLR MTN S.1018 23/29, 5,2500 % Intl. Distributions Svcs. PLC Notes 23/28, 5,5000 % Republik Rumaenien MTN 23/28 Reg.S, 6,3750 % Republik Rumaenien MTN 23/33 Reg.S, 6,7500 % Piraeus Bank SA FLR MTN 23/29, 7,1250 % Republik Rumaenien MTN 23/33 Reg.S) | | |

Deka-EuropaBond

Anhang.

| | | |
|------------------------------|-----|-----------|
| Umlaufende Anteile Klasse CF | STK | 267.705 |
| Umlaufende Anteile Klasse TF | STK | 8.182.794 |
| Umlaufende Anteile Klasse AV | STK | 100 |
| Anteilwert Klasse CF | EUR | 94,52 |
| Anteilwert Klasse TF | EUR | 34,30 |
| Anteilwert Klasse AV | EUR | 78,21 |

Angaben zu Bewertungsverfahren

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgt durch die Verwaltungsgesellschaft auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch (§ 168) und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und -Bewertungsverordnung (KARBV).

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzolumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Für die Bewertung von Renten, rentenähnlichen Genussscheinen und Zertifikaten, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind, wird grundsätzlich der letzte verfügbare handelbare Kurs zugrunde gelegt. Renten, rentenähnliche Genussscheine und Zertifikate, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mit marktnahen Kursstellungen (in der Regel Brokerquotes, alternativ mit sonstigen Preisquellen) bewertet, welche auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden. Die Bewertung von Schuldscheindarlehen erfolgt in der Regel mit Modellbewertungen, die von externen Dienstleistern bezogen und auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden.

Investmentanteile

Investmentanteile werden zum letzten von der Investmentgesellschaft festgestellten Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Börsenkurs bewertet.

Derivate

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Futures und Optionen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mit Verkehrswerten bewertet, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Black-Scholes-Merton) ermittelt werden. Die Bewertung von Swaps erfolgt anhand von Fair Values, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Discounted-Cash-Flow-Verfahren) ermittelt werden. Devisentermingeschäfte werden nach der Forward Point Methode bewertet.

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Fonds geführt werden, wird in diese Währung zu den jeweiligen Devisenkursen (i.d.R. Reuters-Fixing) umgerechnet.

Angaben zu erfolgsbezogenen Vergütungen:

Anteilklasse CF

Dem Sondervermögen im Berichtszeitraum berechnete erfolgsbezogene Vergütungen: EUR 0,00

Dies entspricht bezogen auf den durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens: 0,00%

Anteilklasse TF

Dem Sondervermögen im Berichtszeitraum berechnete erfolgsbezogene Vergütungen: EUR 0,00

Dies entspricht bezogen auf den durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens: 0,00%

Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

(Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR

14.327.753,03

in % des Fondsvermögens

4,68

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

14.327.753,03

Sitzstaat

Deutschland

Art(en) von Abwicklung/Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem), per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte) oder trilateral (Agency-Geschäfte). Total Return Swaps werden als bilaterales OTC-Geschäft abgeschlossen.

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)

unbefristet

absolute Beträge in EUR

14.327.753,03

Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Deka-EuropaBond

Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR
18.075.970,85

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds
Kostenanteil des Fonds
Ertragsanteil der KVG

| absolute Beträge in EUR | in % der Bruttoerträge des Fonds |
|-------------------------|----------------------------------|
| 5.377,78 | 100,00 |
| 1.774,67 | 33,00 |
| 1.774,67 | 33,00 |

Der oben ausgewiesene Kostenanteil des Fonds bzw. Ertragsanteil der KVG beinhaltet sowohl den Aufwandsersatz der Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) als auch zusätzliche Kosten Dritter. Damit werden der Infrastrukturaufwand der Kapitalverwaltungsgesellschaft und die Kosten des externen Wertpapierdarlehen-Serviceproviders für die Anbahnung, Durchführung und Abwicklung inklusive der Sicherheitenstellung abgegolten.

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

5,09% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Wertpapier-Darlehen

Société Générale S.A.
ASML Holding N.V.
Medtronic Global Holdings SCA
Vodafone Group PLC
LfA Förderbank Bayern
Bausparkasse Schwäbisch Hall AG - Bausparkasse der Volksbanken und Raiffeisenbanken

| absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR |
|---|
| 4.718.109,37 |
| 3.636.869,50 |
| 3.092.513,74 |
| 2.472.234,10 |
| 2.363.312,20 |
| 1.792.931,95 |

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer
J.P.Morgan AG Frankfurt
Clearstream Banking Frankfurt

| |
|---|
| 2 |
| 5.564.747,84 EUR (absolut/verwahrter Betrag) |
| 12.511.223,02 EUR (absolut/verwahrter Betrag) |

Eine Zuordnung der Kontrahenten zu den erhaltenen Sicherheiten ist auf Geschäftsartenebenen durch die Globalbesicherung im Einzelnen bei Total Return Swaps nicht möglich. Der ausgewiesene Wert enthält daher ausdrücklich keine Total Return Swaps, diese sind innerhalb der Globalbesicherung jedoch ausreichend besichert.

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

| | |
|-------------------------------|-------|
| gesonderte Konten/Depots | 0,00% |
| Sammelkonten/Depots | 0,00% |
| andere Konten/Depots | 0,00% |
| Verwahrart bestimmt Empfänger | 0,00% |

Da eine Zuordnung begebener Sicherheiten bei Total Return Swaps auf Geschäftsartenebene durch die Globalbesicherung im Einzelnen nicht möglich ist, erfolgt der %-Ausweis für die Verwahrarten ohne deren Berücksichtigung.

Die Summenangabe der Sicherheiten nach Instrumentenart, Restlaufzeit, Sicherheitenaussteller und Verwahrer kann rundungsbedingt von der Summe der angegebenen Einzelwerte abweichen.

Frankfurt am Main, den 2. Januar 2024
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

17. Mai 1995; die Gesellschaft übernahm das Investmentgeschäft der am 17. August 1956 gegründeten Deka Deutsche Kapitalanlagegesellschaft mbH.

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,1 Mio.

Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Dr. Matthias Danne
Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main und der WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf

Stellvertretende Vorsitzende

Birgit Dietl-Benzin
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Thomas Schneider
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A., Luxemburg;
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Dezember 2023

Die vorstehenden Angaben werden in den Jahres- und ggf. Halbjahresberichten jeweils aktualisiert.



Deka Investment GmbH

Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
www.deka.de

