

Halbjahresbericht  
zum 30. September 2023.

## **Deka-Prämienstrategie Select**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. September 2023

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Dekapremienstrategie Select für den Zeitraum vom 1. April 2023 bis zum 30. September 2023.

Im Berichtszeitraum entfernten sich die Teuerungsraten sukzessive von ihren Höchstständen und sorgten damit für eine gewisse Entlastung an den Finanzmärkten. Demgegenüber hat sich in Deutschland und im Euroraum die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,50 Prozent an. An den Rentenmärkten zogen die Renditen angesichts vorsichtiger Töne von den Notenbanken zuletzt erneut merklich an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,8 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 4,6 Prozent.

Die globalen Aktienbörsen präsentierten auf Halbjahressicht ein uneinheitliches Bild. Insbesondere in den USA und Japan konnten die Indizes Zuwächse verbuchen. In Europa überwogen die Minuszeichen und in China sorgten verschiedene Belastungsfaktoren wie u.a. der Immobiliensektor für einen kräftigen Rückgang. Der Euro zeigte sich im Verhältnis zum US-Dollar volatil und lag Ende September bei 1,06 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte merklich aufwärts und beendete die Berichtsperiode bei 95,3 US-Dollar je Barrel (Brent Future).

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](http://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
Vermögensübersicht zum 30. September 2023	6
Vermögensaufstellung zum 30. September 2023	7
Anhang	9
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	11

**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-Prämienstrategie Select

## Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist es, Kapitalzuwachs durch eine positive Entwicklung der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte zu erwirtschaften. Dabei werden ökologische und soziale Faktoren berücksichtigt.

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

Um dies zu erreichen, strebt der Fonds eine Beteiligung an einer möglichen Aufwärtsbewegung des europäischen Aktienmarktes bei gleichzeitiger Vereinnahmung von Optionsprämien an. Als Basiswerte dient ein Portfolio aus Einzeltiteln des STOXX Europe 600<sup>1)</sup>, wobei Titel von Finanzunternehmen ausgeschlossen werden sollen. Daneben können Unternehmensanleihen und Anleihen von öffentlichen Emittenten eingesetzt werden. Im Rahmen der Strategie erfolgt eine Steuerung der Laufzeitstruktur. Zur Erreichung des Anlageziels kann insbesondere in außergewöhnlichen Marktphasen von dieser Systematik abgewichen werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Fonds investiert in Rentenpapiere und verkauft monatlich Optionen auf den Aktienmarkt mit entsprechender Laufzeit. Durch den Verkauf der Optionen kann ein kontinuierlicher Einkommensstrom erzeugt werden. Die Rentenpapierauswahl erfolgt anhand ihrer Bonität, der zum jeweiligen Fonds passenden Restlaufzeit, ihrer Liquidität, ihrer Kuponstruktur und der Bonität des Emittenten selbst. Das resultierende Rentenportfolio ist Ergebnis einer Optimierung anhand der vorgenannten Kriterien. Der Erwerb der Rentenpapiere erfolgt entweder direkt vom Emittenten oder auf dem Sekundärmarkt. Das Rentenportfolio wird regelmäßig überprüft und ggf. angepasst. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus.

### Wichtige Kennzahlen

#### Deka-Prämienstrategie Select

Performance*	6 Monate
Anteilklasse I	1,80%

---

ISIN	
Anteilklasse I	DE000DK0V6V5

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

Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten. Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen. Die Einstufung, welche Unternehmen in diesem Sinne kontroverse Geschäftspraktiken anwenden, erfolgt im Rahmen des Investmentprozesses. Unternehmen, die kontroverse Waffen herstellen, werden grundsätzlich aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Nicht investiert wird zudem in Staaten, die nach dem Freedom-House Index als "unfrei" ("not free") eingestuft werden und/oder nach dem Corruption-Perceptions-Index einen Score von weniger als 40 aufweisen. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens "BBB" oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

Detaillierte Angaben zur Nachhaltigkeitsstrategie und deren Merkmale können Sie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung im Anhang des Verkaufsprospekts, dem entsprechenden Anhang des Jahresberichts sowie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung auf der Webseite des Fonds entnehmen.

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.

1) 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.

# Deka-Prämienstrategie Select

## Vermögensübersicht zum 30. September 2023.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>27.128.863,25</b>	<b>91,46</b>
Deutschland	7.437.123,00	25,07
Frankreich	3.185.836,00	10,74
Irland	5.659.280,00	19,08
Italien	5.238.202,50	17,66
Sonstige	2.703.736,75	9,12
Spanien	2.904.685,00	9,79
<b>2. Derivate</b>	<b>-505.290,00</b>	<b>-1,70</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>2.215.265,68</b>	<b>7,47</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>837.477,70</b>	<b>2,82</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-15.655,80</b>	<b>-0,05</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>29.660.660,83</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>27.128.863,25</b>	<b>91,46</b>
EUR	27.128.863,25	91,46
<b>2. Derivate</b>	<b>-505.290,00</b>	<b>-1,70</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>2.215.265,68</b>	<b>7,47</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>837.477,70</b>	<b>2,82</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-15.655,80</b>	<b>-0,05</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>29.660.660,83</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-Prämienstrategie Select

## Vermögensaufstellung zum 30. September 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>27.128.863,25</b>	<b>91,46</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>27.128.863,25</b>	<b>91,46</b>
<b>EUR</b>								<b>27.128.863,25</b>	<b>91,46</b>
DE0001134922	6,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 94/24 <sup>1)</sup>		EUR	6.700.000	500.000	0	% 100,676	6.745.292,00	22,74
FR0010775486	5,3750 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl. Fonc. 09/24		EUR	1.075.000	575.000	0	% 100,966	1.085.384,50	3,66
FR0011182542	4,1250 % Crédit Mutuel HomeLoan SFH SA MT Obl.Fin.Hab.12/24		EUR	2.100.000	0	0	% 100,022	2.100.451,50	7,08
XS2579303780	3,0000 % DekaBank Dt.Girozent. MTN Oeff.-Pfe. RA160 23/25		EUR	700.000	0	0	% 98,833	691.831,00	2,33
XS0290050524	4,1250 % European Investment Bank MTN 07/24		EUR	2.699.000	0	1.000.000	% 100,176	2.703.736,75	9,12
ES00000121G2	4,8000 % Königreich Spanien Bonos 08/24		EUR	1.600.000	300.000	0	% 100,266	1.604.256,00	5,41
ES00000123X3	4,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23		EUR	1.300.000	0	0	% 100,033	1.300.429,00	4,38
IE00B4TV0D44	5,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 09/25		EUR	5.500.000	500.000	0	% 102,896	5.659.280,00	19,08
IT0004513641	5,0000 % Republik Italien B.T.P. 09/25		EUR	2.100.000	2.100.000	0	% 101,380	2.128.980,00	7,18
IT0000366655	9,0000 % Republik Italien B.T.P. 93/23		EUR	3.100.000	1.800.000	0	% 100,298	3.109.222,50	10,48
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 27.128.863,25</b>	<b>91,46</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>									
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>									
adidas AG (ADS) Put Dez. 23 140									
		XEUR	STK	-6.500			EUR 2,660	-17.290,00	-0,06
Air Liquide S.A. (AIR) Put Nov. 23 152									
		XEUR	STK	-4.700			EUR 1,565	-7.355,50	-0,02
ASM International N.V. (AVS) Put Nov. 23 340									
		XEUR	STK	-2.500			EUR 4,725	-11.812,50	-0,04
BE Semiconductor Inds N.V. (BSI) Put Dez. 23 72									
		XEUR	STK	-9.100			EUR 1,275	-11.602,50	-0,04
BMW AG ST (BMW) Put Okt. 23 98									
		XEUR	STK	-6.900			EUR 2,580	-17.802,00	-0,06
Daimler AG (MBG) Put Dez. 23 62									
		XEUR	STK	-18.400			EUR 1,400	-25.760,00	-0,09
Enel S.P.A. (ENL) Put Dez. 23 5,6									
		XEUR	STK	-112.000			EUR 0,130	-14.560,00	-0,05
Essilor Intl -Cie Génle (ESL) Put Nov. 23 154									
		XEUR	STK	-3.700			EUR 1,780	-6.586,00	-0,02
Flex Amadeus IT Gr. S.A. (A13A) Put Nov. 23 59									
		XEUR	STK	-13.000			EUR 2,637	-34.281,00	-0,12
Flex Danone S.A. (BSN) Put Feb. 24 50,5									
		XEUR	STK	-40.000			EUR 1,365	-54.600,00	-0,18
Flex Deutsche Post AG (DPW) Put Jan. 24 39									
		XEUR	STK	-50.000			EUR 1,952	-97.600,00	-0,33
FLEX E.ON SE (EOAN) Put Jan. 24 10									
		XEUR	STK	-150.000			EUR 0,170	-25.500,00	-0,09
Flex Engie S.A. (GZF) Put Okt. 23 12,5									
		XEUR	STK	-125.000			EUR 0,028	-3.500,00	-0,01
FLEX Konkinkl.Ahold Delh. (AHO) Put Okt. 23 28									
		XEUR	STK	-50.000			EUR 0,194	-9.700,00	-0,03
Flex Legrand S.A. (LRC) Put Nov. 23 80									
		XEUR	STK	-16.000			EUR 0,605	-9.680,00	-0,03
Flex Orange S.A. (FTE) Put Okt. 23 10									
		XEUR	STK	-100.000			EUR 0,031	-3.100,00	-0,01
Flex Saint-Gobain S.A. (GOB) Put Feb. 24 51									
		XEUR	STK	-30.000			EUR 1,376	-41.280,00	-0,14
Infineon Technologies AG (IFX) Put Dez. 23 31									
		XEUR	STK	-23.100			EUR 1,580	-36.498,00	-0,12
L'Oreal S.A. (LOR) Put Dez. 23 360									
		XEUR	STK	-3.000			EUR 4,665	-13.995,00	-0,05
Merck kGaA (MRK) Put März 24 140									
		XEUR	STK	-6.000			EUR 3,755	-22.530,00	-0,08
Schneider Electric S.A. (SND) Put März 24 140									
		XEUR	STK	-5.300			EUR 3,945	-20.908,50	-0,07
Siemens AG (SIE) Put Nov. 23 120									
		XEUR	STK	-5.800			EUR 1,070	-6.206,00	-0,02
STMicroelectronics N.V. (SGM) Put März 24 32									
		XEUR	STK	-15.800			EUR 0,780	-12.324,00	-0,04
Vinci S.A. (SQU) Put Okt. 23 97									
		XEUR	STK	-4.200			EUR 0,195	-819,00	0,00
<b>Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>								<b>EUR -505.290,00</b>	<b>-1,70</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
			EUR	2.215.265,68			% 100,000	2.215.265,68	7,47
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR 2.215.265,68</b>	<b>7,47</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 2.215.265,68</b>	<b>7,47</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
			EUR	837.385,67				837.385,67	2,82
			EUR	92,03				92,03	0,00
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR 837.477,70</b>	<b>2,82</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
			EUR	-30,35				-30,35	0,00
			EUR	-15.625,45				-15.625,45	-0,05
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR -15.655,80</b>	<b>-0,05</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>EUR 29.660.660,83</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile Klasse I</b>								<b>STK 310.046,000</b>	
<b>Anteilwert Klasse I</b>								<b>EUR 95,67</b>	

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

<sup>1)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

# Deka-Prämienstrategie Select

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
<b>Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)</b>				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: 6,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 94/24				
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>	EUR EUR	1.405.779	1.415.282,07	<b>1.415.282,07</b>

**Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 3.020.280,00**

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

**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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
BE0000332412	2,6000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.72 14/24	EUR	0	1300.000
IE00B6X95T99	3,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 14/24	EUR	300.000	1.600.000
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS0968926757	2,5000 % ABN AMRO Bank N.V. Cov. MTN 13/23	EUR	100.000	600.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>		
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>		
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	<b>EUR</b>	<b>10.653</b>
(Basiswert(e): adidas AG Namens-Aktien, Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port., ASM International N.V. Reg.Shares, ASML Holding N.V. Aandelen op naam, Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien, EssilorLuxottica S.A. Actions Port., Ferrari N.V. Aandelen op naam, Infineon Technologies AG Namens-Aktien, Kering S.A. Actions Port., Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien, Sanofi S.A. Actions Port., SAP SE Inhaber-Aktien, Schneider Electric SE Actions Port., Siemens AG Namens-Aktien)		
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
<b>unbefristet</b>	<b>EUR</b>	<b>9.731</b>
(Basiswert(e): 6,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 94/24)		

# Deka-Prämienstrategie Select

## Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse I  
Anteilwert Klasse I

STK  
EUR

310,046  
95,67

### 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 Umsatzvolumina 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.

### 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

1.415.282,07

in % des Fondsvermögens

4,77

#### 10 größte Gegenparteien

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

1.415.282,07

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

1.415.282,07

#### 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)

##### Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

1.838.594,50

#### Ertrags- und Kostenanteile

##### Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

Kostenanteil des Fonds

Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

245,29

80,93

80,93

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00

32,99

32,99

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.



# Deka-Prämienstrategie Select

## 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

5,22% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps Wertpapier-Darlehen

	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Deutsche Bank AG	1.003.892,90
NRW.BANK	834.701,61

## 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	1
Clearstream Banking Frankfurt	1.838.594,50 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%
Verwahrt 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. Oktober 2023

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.

### Alleingesellschafterin

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)  
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH, Köln  
und der Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln;  
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: 30. September 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](http://www.deka.de)

