

# Halbjahresbericht zum 31. Oktober 2024. KölnFondsStruktur:

Ein Investmentfonds mit Teilfonds gemäß Teil II des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (AIF).

Verwaltungsgesellschaft: Deka International S.A.

**.Deka**  
Investments



# Bericht des Vorstands.

31. Oktober 2024

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

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Umbrellafonds KölnFondsStruktur: bestehend aus den vier Teilfonds KölnFondsStruktur: Ertrag, KölnFondsStruktur: Wachstum, KölnFondsStruktur: Chance und KölnFondsStruktur: ChancePlus für den Zeitraum vom 1. Mai 2024 bis zum 31. Oktober 2024.

Rückläufige Inflationsraten sowie sinkende Notenbankzinsen in den USA und der Eurozone stabilisierten in der Berichtsperiode die Finanzmärkte, auch wenn sich die wirtschaftliche Lage weltweit uneinheitlich zeigte. Während sich in Europa, bedingt vor allem durch eine Stagnation in Deutschland, nur eine moderate konjunkturelle Aktivität abzeichnete, präsentierte sich die Wirtschaftslage in den USA in einer dynamischen Verfassung. Jedoch sorgten die geopolitischen Belastungsfaktoren und militärischen Konflikte wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken wurde weiterhin durch die Inflationsentwicklung bestimmt. Den spürbar nachlassenden Inflationsdruck nahmen einige der bedeutenden Zentralbanken ab dem Frühjahr 2024 zum Anlass für erste Leitzinssenkungen. So führte die EZB den Hauptrefinanzierungssatz seit Juni in drei Schritten auf zuletzt 3,40 Prozent zurück. Die US-Notenbank Fed läutete im September die Zinswende mit einem Absenken des Leitzinsintervalls um 50 Basispunkte auf 4,75 Prozent bis 5,00 Prozent ein. Zwischen Ende April und Anfang September waren die Renditen 10-jähriger US-Treasuries stark rückläufig. Zuletzt stiegen die Verzinsungen jedoch erneut deutlich an. Den Hintergrund bildeten insbesondere Erwartungen hinsichtlich möglicher Handelszölle und der zukünftig steigenden Verschuldung der USA. Die Verzinsung 10-jähriger Euroland-Staatsanleihen lag zum Monatsultimo bei 2,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,3 Prozent.

Die globalen Zinssenkungserwartungen wirkten über weite Strecken unterstützend für die Kurse an den weltweiten Aktienmärkten, die sich überwiegend in einer freundlichen Verfassung zeigten. Dabei erreichten viele Indizes, wie der DAX, der S&P 500, der Dow Jones Industrial und der Nasdaq Composite sowie der Nikkei 225, neue Rekordstände. Der chinesische Aktienmarkt hinkte hingegen der internationalen Marktentwicklung zunächst hinterher. Die Ankündigung von Konjunkturstimuli durch die chinesische Regierung im September bescherte dem chinesischen Aktienmarkt in der Folge bis Anfang Oktober einen rasanten Anstieg, der seinerseits belebend auf die globalen Märkte ausstrahlte.

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 International S.A.  
Der Vorstand



Holger Hildebrandt



Eugen Lehnertz

# Inhalt.

|   |    |
|---|----|
| Anlagepolitik                               |    |
| KölnFondsStruktur: Ertrag                   | 5  |
| KölnFondsStruktur: Wachstum                 | 6  |
| KölnFondsStruktur: Chance                   | 7  |
| KölnFondsStruktur: ChancePlus               | 8  |
| Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024     |    |
| KölnFondsStruktur: Ertrag                   | 9  |
| Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024   |    |
| KölnFondsStruktur: Ertrag                   | 10 |
| Anhang                                      |    |
| KölnFondsStruktur: Ertrag                   | 13 |
| Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024     |    |
| KölnFondsStruktur: Wachstum                 | 14 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024   |    |
| KölnFondsStruktur: Wachstum                 | 15 |
| Anhang                                      |    |
| KölnFondsStruktur: Wachstum                 | 18 |
| Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024     |    |
| KölnFondsStruktur: Chance                   | 19 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024   |    |
| KölnFondsStruktur: Chance                   | 20 |
| Anhang                                      |    |
| KölnFondsStruktur: Chance                   | 23 |
| Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024     |    |
| KölnFondsStruktur: ChancePlus               | 24 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024   |    |
| KölnFondsStruktur: ChancePlus               | 25 |
| Anhang                                      |    |
| KölnFondsStruktur: ChancePlus               | 27 |
| Fondszusammensetzung                        | 28 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 30 |

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

# KölnFondsStruktur: Ertrag Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, legt der Teilfonds hauptsächlich in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) an. Festgelegte Anlagegrenzen: Aktienfonds bis zu 40%, Rentenfonds bis zu 100%, sonstige Fonds (z.B. Mischfonds) bis zu 30%, Geldmarktfonds bis zu 30 %, Bankguthaben bis zu 49%, Immobilienfonds bis zu 20% (kein Neuerwerb), OGA mit Sitz außerhalb des Großherzogtums Luxemburg bis zu 100%.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

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.

Der AIFM hat auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

## Wichtige Kennzahlen

### KölnFondsStruktur: Ertrag

| Performance* | 6 Monate     |
|--------------|--------------|
|              | 4,9%         |
| ISIN         | LU0101436672 |

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

# KölnFondsStruktur: Wachstum Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, legt der Teilfonds hauptsächlich in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) an. Festgelegte Anlagegrenzen: Aktienfonds bis zu 65 %, Rentenfonds bis zu 100%, sonstige Fonds (z.B. Mischfonds) bis zu 30%, Geldmarktfonds bis zu 30%, Bankguthaben bis zu 49%, Immobilienfonds bis zu 20% (kein Neuerwerb), OGA mit Sitz außerhalb des Großherzogtums Luxemburg bis zu 100%.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

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.

Der AIFM hat auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

## Wichtige Kennzahlen

### KölnFondsStruktur: Wachstum

| Performance* | 6 Monate     |
|--------------|--------------|
|              | 6,4%         |
| ISIN         | LU0101437217 |

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

# KölnFondsStruktur: Chance Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, legt der Teilfonds hauptsächlich in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) an. Folgende Anlagegrenzen sind dabei festgelegt: Aktienfonds bis zu 100%, Rentenfonds bis zu 60%, sonstige Fonds (z.B. Mischfonds) bis zu 30%, Geldmarktfonds bis zu 30%, Bankguthaben bis zu 49%, Immobilienfonds bis zu 20% (ein Neuerwerb von Immobilienfonds ist ausgeschlossen), OGA mit Sitz außerhalb des Großherzogtums Luxemburg bis zu 100%.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

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.

Der AIFM hat auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

## Wichtige Kennzahlen

### KölnFondsStruktur: Chance

| Performance*  | 6 Monate     |
|---|--------------|
|   | 6,7%         |
| ISIN  | LU0101437480 |
| * Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. |              |

# KölnFondsStruktur: ChancePlus

## Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Teilfonds hauptsächlich in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) an. Folgende Anlagegrenzen sind dabei festgelegt: Aktienfonds mindestens 70%, sonstige Fonds (z.B. Mischfonds) bis zu 30%, Geldmarktfonds bis zu 30%, Bankguthaben bis zu 30%, OGA mit Sitz außerhalb des Großherzogtums Luxemburg bis zu 100%.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

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.

Der AIFM hat auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deko Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

### Wichtige Kennzahlen

#### KölnFondsStruktur: ChancePlus

| Performance* | 6 Monate     |
|--------------|--------------|
|              | 5,9%         |
| ISIN         | LU0117172097 |

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

# KölnFondsStruktur: Ertrag

## Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024.

| Gliederung nach Anlageart - Land                            | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| Deutschland   | 9.333.776,85         | 32,38                        |
| Irland  | 567.299,39           | 1,97                         |
| Luxemburg   | 14.060.353,91        | 48,78                        |
| Österreich  | 579.634,60           | 2,01                         |
| <b>2. Zertifikate</b>                                       |                      |                              |
| Irland  | 1.313.960,96         | 4,56                         |
| <b>3. Derivate</b>  | <b>-62.061,15</b>    | <b>-0,21</b>                 |
| <b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>3.280.578,66</b>  | <b>11,38</b>                 |
| <b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>126.896,24</b>    | <b>0,44</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-378.151,96</b>   | <b>-1,31</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>28.822.287,50</b> | <b>100,00</b>                |

| Gliederung nach Anlageart - Währung                         | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| EUR   | 23.539.050,84        | 81,66                        |
| JPY   | 242.531,22           | 0,84                         |
| USD   | 759.482,69           | 2,64                         |
| <b>2. Zertifikate</b>                                       |                      |                              |
| EUR   | 1.313.960,96         | 4,56                         |
| <b>3. Derivate</b>  | <b>-62.061,15</b>    | <b>-0,21</b>                 |
| <b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>3.280.578,66</b>  | <b>11,38</b>                 |
| <b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>126.896,24</b>    | <b>0,44</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-378.151,96</b>   | <b>-1,31</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>28.822.287,50</b> | <b>100,00</b>                |

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

# KölnFondsStruktur: Ertrag Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024.

| ISIN  | Gattungsbezeichnung                                | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs          | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|---|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------------|----------------------|-------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>1.313.960,96</b>  | <b>4,56</b>             |
| <b>Zertifikate</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>1.313.960,96</b>  | <b>4,56</b>             |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>1.313.960,96</b>  | <b>4,56</b>             |
| DE000A2TOVU5  | XTrackers ETC PLC Rohst.-Zert. XAU 20/80           |       | STK                          | 33.248             | 12.810                             | 6.438             | EUR 39,520    | 1.313.960,96         | 4,56                    |
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>24.541.064,75</b> | <b>85,14</b>            |
| <b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>3.318.902,21</b>  | <b>11,52</b>            |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>3.318.902,21</b>  | <b>11,52</b>            |
| LU0350136957  | Deka-EM Bond Inhaber-Anteile CF                    |       | ANT                          | 10.765             | 0                                  | 596               | EUR 69,010    | 742.892,65           | 2,58                    |
| LU117993268   | DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)   |       | ANT                          | 1.427              | 0                                  | 0                 | EUR 143,240   | 204.403,48           | 0,71                    |
| LU0230155797  | Deka-Renten konservativ Inhaber-Anteile            |       | ANT                          | 47.328             | 0                                  | 0                 | EUR 50,110    | 2.371.606,08         | 8,23                    |
| <b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>15.998.752,68</b> | <b>55,50</b>            |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>15.998.752,68</b> | <b>55,50</b>            |
| DE000DK1CJZ4  | Deka Bund + S Finanz: 7-15 Inhaber-Anteile I       |       | ANT                          | 12.397             | 0                                  | 474               | EUR 89,000    | 1.103.333,00         | 3,83                    |
| DE000ETFL284  | Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile         |       | ANT                          | 4.210              | 0                                  | 13.468            | EUR 17,370    | 73.127,70            | 0,25                    |
| DE000DK0V7C3  | Deka Nachh.Sel.Akt.Rheinediti. Inhaber-Anteile I   |       | ANT                          | 15.376             | 0                                  | 0                 | EUR 85,190    | 1.309.881,44         | 4,54                    |
| DE0008480666  | Deka Rentenfonds RheinEdition Inhaber-Anteile      |       | ANT                          | 82.643             | 0                                  | 0                 | EUR 29,390    | 2.428.877,77         | 8,43                    |
| DE0007019416  | Deka-Instit. Renten Europa Inhaber-Anteile         |       | ANT                          | 15.711             | 0                                  | 1.481             | EUR 63,830    | 1.002.833,13         | 3,48                    |
| DE000DK094E9  | Deka-Multimanager Renten Inhaber-Anteile           |       | ANT                          | 35.080             | 0                                  | 12.312            | EUR 73,500    | 2.578.380,00         | 8,95                    |
| AT000A34MN2   | Deka-SektorInvest Nam.-Ant. VTIA                   |       | ANT                          | 5.365              | 0                                  | 593               | EUR 108,040   | 579.634,60           | 2,01                    |
| LU0230856071  | IFM-Invest: Renten Europa Inhaber-Anteile          |       | ANT                          | 55.709             | 1.630                              | 6.913             | EUR 74,860    | 4.170.375,74         | 14,46                   |
| LU0203963425  | IFM-Invest: Vermögensma.Aktien Inhaber-Anteile     |       | ANT                          | 25.870             | 2.043                              | 6.493             | EUR 106,390   | 2.752.309,30         | 9,55                    |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>5.223.409,86</b>  | <b>18,12</b>            |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>4.221.395,95</b>  | <b>14,64</b>            |
| LU2613274492  | AGIF-US Investment Gr. Cred. Act.Por. WT3(H2) Acc. |       | ANT                          | 1.560              | 0                                  | 209               | EUR 1.077,820 | 1.681.399,20         | 5,83                    |
| DE000A3ERMA3  | Berenberg Guardian Inhaber-Anteile M A             |       | ANT                          | 1.478              | 1.478                              | 0                 | EUR 100,620   | 148.716,36           | 0,52                    |
| DE000A407MK1  | Defensive Portfolio Inhaber-Anteile X              |       | ANT                          | 3.547              | 3.547                              | 0                 | EUR 98,610    | 349.769,67           | 1,21                    |
| DE000A407MQ8  | Diversified Income Portfolio Inhaber-Anteile X     |       | ANT                          | 296                | 296                                | 0                 | EUR 100,250   | 29.674,00            | 0,10                    |
| LU2608816471  | FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.       |       | ANT                          | 22.316             | 6.000                              | 0                 | EUR 10,480    | 233.871,68           | 0,81                    |
| DE000A0D8QZ7  | iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)      |       | ANT                          | 8.574              | 0                                  | 940               | EUR 32,720    | 280.541,28           | 0,97                    |
| LU1004011935  | Jan.Hend.Hor.-J.H.H.Eu.Co.Bd Actions Nom.G2 (Acc)  |       | ANT                          | 1.212              | 0                                  | 0                 | EUR 118,170   | 143.222,04           | 0,50                    |
| LU1727354448  | JPMorgan Fds-Gl Corp. Bon. ANJPM Gl Co.B.I2(acc)   |       | ANT                          | 3.364              | 0                                  | 442               | EUR 101,770   | 342.354,28           | 1,19                    |
| LU2018762653  | MUL Amundi US Curve Ste 2-10Y UCITS ETF Inh.A. Acc |       | ANT                          | 4.385              | 0                                  | 0                 | EUR 88,830    | 389.519,55           | 1,35                    |
| LU1602110832  | Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.     |       | ANT                          | 621                | 0                                  | 0                 | EUR 256,680   | 159.398,28           | 0,55                    |
| LU1071420456  | Robeco Cap.Gr.F.-R.Glob.Cred. Act. Nom. CLIH       |       | ANT                          | 1.783              | 0                                  | 293               | EUR 117,700   | 209.859,10           | 0,73                    |
| LU0717821077  | Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I       |       | ANT                          | 134                | 0                                  | 59                | EUR 584,220   | 78.285,48            | 0,27                    |
| LU1078767826  | Schroder ISF Euro Corp.Bond Namens-Anteile IZ Acc. |       | ANT                          | 5.529              | 0                                  | 0                 | EUR 26,432    | 146.142,53           | 0,51                    |
| DE000A3DQ2Q1  | Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X       |       | ANT                          | 285                | 0                                  | 1.331             | EUR 100,500   | 28.642,50            | 0,10                    |
| <b>JPY</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>242.531,22</b>    | <b>0,84</b>             |
| LU0950671825  | UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.   |       | ANT                          | 11.130             | 0                                  | 0                 | JPY 3.605,500 | 242.531,22           | 0,84                    |
| <b>USD</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>759.482,69</b>    | <b>2,64</b>             |
| LU0786609700  | GS Fds-GS Gl.Millen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.   |       | ANT                          | 2.912              | 0                                  | 1.179             | USD 32,210    | 86.399,71            | 0,30                    |
| IE000MLMNY50  | iShs III-S&P 500 Equi.Weil.ETF Reg.Shs () Acc.     |       | ANT                          | 73.374             | 156.994                            | 83.620            | USD 6,324     | 427.415,71           | 1,48                    |
| IE00B3WJG14   | iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)    |       | ANT                          | 4.548              | 0                                  | 1.098             | USD 33,390    | 139.883,68           | 0,49                    |
| LU2210346602  | Schroder ISF-Gl.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.   |       | ANT                          | 8.858              | 0                                  | 3.340             | USD 12,964    | 105.783,59           | 0,37                    |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b>    | <b>25.855.025,71</b> | <b>89,70</b>            |
| <b>Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                      |                         |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                      |                         |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                      |                         |
| <b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                      |                         |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                      |                         |
| DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Dez.24   |  | XEUR  | EUR                          | Anzahl -12         |                                    |                   |               | <b>-3.660,00</b>     | <b>-0,01</b>            |
|   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | -3.660,00            | -0,01                   |

# KölnFondsStruktur: Ertrag

| ISIN   | Gattungsbezeichnung                           | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum | Kurs        | Kurswert in EUR          | % des Fondsvermögens *) |
|--|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|---------------------------------------|-------------|--------------------------|-------------------------|
| <b>Optionsrechte**)</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>9.929,07</b>          | <b>0,03</b>             |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>                             |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>9.929,07</b>          | <b>0,03</b>             |
|  | S & P 500 Index (\$500) Put März 25 5500      | XCBO  |                              | Anzahl 1           |                                    |                                       | USD 107,790 | 9.929,07                 | 0,03                    |
| <b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>                              |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR 6.269,07</b>      | <b>0,02</b>             |
| <b>Zins-Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
| <b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>                              |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>-68.330,22</b>        | <b>-0,23</b>            |
|  | EURO Bobl Future (FGBM) Dez. 24               | XEUR  | EUR                          | 400.000            |                                    |                                       |             | -1.170,00                | 0,00                    |
|  | EURO Bund Future (FGBL) Dez. 24               | XEUR  | EUR                          | 900.000            |                                    |                                       |             | -6.250,00                | -0,02                   |
|  | Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Dez. 24 | XCBT  | USD                          | 2.800.000          |                                    |                                       |             | -60.910,22               | -0,21                   |
| <b>Summe der Zins-Derivate</b>                                     |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR -68.330,22</b>    | <b>-0,23</b>            |
| <b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>           |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
| <b>Bankguthaben</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
| <b>EUR-Guthaben bei</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
|  | DekaBank Deutsche Girozentrale                |       | EUR                          | 3.277.985,28       |                                    |                                       | % 100,000   | 3.277.985,28             | 11,37                   |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                          |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
|  | DekaBank Deutsche Girozentrale                |       | JPY                          | 429.100,00         |                                    |                                       | % 100,000   | 2.593,38                 | 0,01                    |
| <b>Summe der Bankguthaben</b>                                      |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR 3.280.578,66</b>  | <b>11,38</b>            |
| <b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR 3.280.578,66</b>  | <b>11,38</b>            |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                               |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
|  | Einschüsse (Initial Margins)                  |       | EUR                          | 63.300,80          |                                    |                                       |             | 63.300,80                | 0,22                    |
|  | Einschüsse (Initial Margins)                  |       | USD                          | 56.000,00          |                                    |                                       |             | 51.584,38                | 0,18                    |
|  | Forderungen aus Anteilscheingeschäften        |       | EUR                          | 85,76              |                                    |                                       |             | 85,76                    | 0,00                    |
|  | Forderungen aus Bestandsprovisionen           |       | EUR                          | 11.925,30          |                                    |                                       |             | 11.925,30                | 0,04                    |
| <b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>                    |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR 126.896,24</b>    | <b>0,44</b>             |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>                              |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
| <b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                           |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
|  | DekaBank Deutsche Girozentrale                |       | USD                          | -400.761,64        |                                    |                                       | % 100,000   | -369.161,42              | -1,28                   |
| <b>Summe der kurzfristigen Verbindlichkeiten</b>                   |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR -369.161,42</b>   | <b>-1,28</b>            |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                  |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
|  | Verwaltungsvergütung                          |       | EUR                          | -1.229,26          |                                    |                                       |             | -1.229,26                | 0,00                    |
|  | Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften  |       | EUR                          | -7.761,28          |                                    |                                       |             | -7.761,28                | -0,03                   |
| <b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>                       |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR -8.990,54</b>     | <b>-0,03</b>            |
| <b>Fondsvermögen</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR 28.822.287,50</b> | <b>100,00</b>           |
| <b>Umlaufende Anteile</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>STK 672.365,000</b>   |                         |
| <b>Anteilwert</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>EUR 42,87</b>         |                         |
| <b>Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf</b>                |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          |                         |
| Anzahl des Anteilumlaufs am Beginn des Berichtszeitraumes          |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | 721.093,000              |                         |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile                                    |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | 6.955,000                |                         |
| Anzahl der zurückgezahlten Anteile                                 |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | 55.683,000               |                         |
| <b>Anzahl des Anteilumlaufs am Ende des Berichtszeitraumes</b>     |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             | <b>672.365,000</b>       |                         |
| <b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>             |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          | <b>89,70</b>            |
| <b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>                |   |       |                              |                    |                                    |                                       |             |                          | <b>-0,21</b>            |

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

\*\*) Bei Future-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung durch tägliche Ausgleichszahlungen (Variation Margin); bei Stock-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung bei Geschäftsabschluss. Stock-Styled Optionsrechte fließen mit ihrem Kurswert in das Sondervermögen ein, Future-Styled Optionsrechte mit ihrem unrealisierten Ergebnis.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
In-/ ausländische Zertifikate, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 30.10.2024  
Alle anderen Vermögenswerte per: 31.10.2024

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2024

Vereinigte Staaten, Dollar (USD) 1,08560 = 1 Euro (EUR)  
Japan, Yen (JPY) 165,46000 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)  
XCBO Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)  
XCBT Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

# KölnFondsStruktur: Ertrag

Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.10.2024 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

|   |     |              |
|---|-----|--------------|
| Finanztermingeschäfte                   |     |              |
| - gekaufte Terminkontrakte auf Renten   | EUR | 4.524.755,88 |
| - verkaufte Terminkontrakte auf Indices | EUR | 589.200,00   |

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>Wertpapier-Investmentanteile</b>               |   |   |                |                   |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b> |   |   |                |                   |
| <b>EUR</b>  |   |   |                |                   |
| LU0575255335                                      | Assenagon Alpha Volatility Namens-Anteile I2 Acc. | ANT                                     | 0              | 147               |
| LU0438336264                                      | BlackRock Str.F-Fxd Inc.Str.Fd Act. Nom. A        | ANT                                     | 0              | 1.251             |
| LU1829218749                                      | MUL-Am.Bl.E.-W.Comm.xAgr.U.ETF Namens-Ant. Acc.   | ANT                                     | 0              | 18.995            |

# KölnFondsStruktur: Ertrag

## Anhang.

|   |     |             |
|---|-----|-------------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) |     | 89,70       |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)    |     | -0,21       |
| Umlaufende Anteile                              | STK | 672.365,000 |
| Anteilwert                                      | EUR | 42,87       |

### Angaben zu Bewertungsverfahren

#### 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.

Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:

|  |      |
|--|------|
| AGIF-US Investment Gr. Cred. Act.Por. WT3(H2) Acc. | 0,32 |
| Berenberg Guardian Inhaber-Anteile M A             | 0,75 |
| Defensive Portfolio Inhaber-Anteile X              | 0,15 |
| Deka Bund + S Finanz: 7-15 Inhaber-Anteile I       | 0,60 |
| Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile         | 0,30 |
| Deka Nachh.Sel.Akt.Rheinediti. Inhaber-Anteile I   | 0,70 |
| Deka Rentenfonds RheinEdition Inhaber-Anteile      | 0,55 |
| Deka-EM Bond Inhaber-Anteile CF                    | 1,20 |
| Deka-Instit. Renten Europa Inhaber-Anteile         | 0,55 |
| Deka-Multimanager Renten Inhaber-Anteile           | 0,60 |
| Deka-Renten konservativ Inhaber-Anteile            | 0,18 |
| Deka-SektorInvest Nam.-Ant. VTIA                   | 0,40 |
| DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)   | 1,00 |
| Diversified Income Portfolio Inhaber-Anteile X     | 0,15 |
| FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.       | 0,64 |
| GS Fds-GS Gl.Millen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.   | 0,75 |
| IFM-Invest: Renten Europa Inhaber-Anteile          | 0,54 |
| IFM-Invest: Vermögensma.Aktien Inhaber-Anteile     | 1,00 |
| JPMorgan Fds-Gl Corp. Bon. ANJPM Gl Co.B.I2(acc)   | 0,32 |
| Jan.Hend.Hor.-J.H.H.Eu.Co.Bd Actions Nom.G2 (Acc)  | 0,40 |
| MUL Amundi US Curve Ste 2-10Y UCITS ETF Inh.A. Acc | 0,30 |
| Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.     | 0,80 |
| Robeco Cap.Gr.F.-R.Glob.Cred. Act. Nom. CLIH       | 0,35 |
| Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I       | 0,80 |
| Schroder ISF Euro Corp.Bond Namens-Anteile IZ Acc. | 0,45 |
| Schroder ISF-Gl.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.   | 0,75 |
| Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X       | 0,27 |
| UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.   | 0,19 |
| iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)      | 0,19 |
| iShs III-S&P 500 Equ.Weit.ETF Reg.Shs () Acc.      | 0,20 |
| iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)    | 0,15 |

# KölnFondsStruktur: Wachstum

## Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024.

| Gliederung nach Anlageart - Land                            | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| Deutschland   | 11.318.869,71        | 33,00                        |
| Irland  | 1.368.557,17         | 3,99                         |
| Luxemburg   | 13.360.056,37        | 38,93                        |
| Österreich  | 1.368.110,52         | 3,99                         |
| <b>2. Zertifikate</b>                                       |                      |                              |
| Irland  | 2.784.737,28         | 8,12                         |
| <b>3. Derivate</b>  | <b>-74.812,28</b>    | <b>-0,22</b>                 |
| <b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>3.946.069,29</b>  | <b>11,50</b>                 |
| <b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>251.684,43</b>    | <b>0,74</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-19.765,66</b>    | <b>-0,05</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>34.303.506,83</b> | <b>100,00</b>                |

| Gliederung nach Anlageart - Währung                         | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| EUR   | 25.198.282,26        | 73,44                        |
| JPY   | 359.939,86           | 1,05                         |
| USD   | 1.857.371,65         | 5,42                         |
| <b>2. Zertifikate</b>                                       |                      |                              |
| EUR   | 2.784.737,28         | 8,12                         |
| <b>3. Derivate</b>  | <b>-74.812,28</b>    | <b>-0,22</b>                 |
| <b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>3.946.069,29</b>  | <b>11,50</b>                 |
| <b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>251.684,43</b>    | <b>0,74</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-19.765,66</b>    | <b>-0,05</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>34.303.506,83</b> | <b>100,00</b>                |

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

# KölnFondsStruktur: Wachstum

## Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024.

| ISIN  | Gattungsbezeichnung                                | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs          | Kurswert in EUR          | % des Fondsvermögens *) |
|---|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------------|--------------------------|-------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>2.784.737,28</b>      | <b>8,12</b>             |
| <b>Zertifikate</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>2.784.737,28</b>      | <b>8,12</b>             |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>2.784.737,28</b>      | <b>8,12</b>             |
| DE000A2TOVU5  | XTrackers ETC PLC Rohst.-Zert. XAU 20/80           |       | STK                          | 70.464             | 36.788                             | 16.852            | EUR 39,520    | 2.784.737,28             | 8,12                    |
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>27.415.593,77</b>     | <b>79,91</b>            |
| <b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>656.325,68</b>        | <b>1,91</b>             |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>656.325,68</b>        | <b>1,91</b>             |
| LU1117993268  | DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)   |       | ANT                          | 4.582              | 328                                | 400               | EUR 143,240   | 656.325,68               | 1,91                    |
| <b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>21.776.481,38</b>     | <b>63,48</b>            |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>21.776.481,38</b>     | <b>63,48</b>            |
| DE000DK1CJZ4  | Deka Bund + S Finanz: 7-15 Inhaber-Anteile I       |       | ANT                          | 12.416             | 0                                  | 0                 | EUR 89,000    | 1.105.024,00             | 3,22                    |
| DE000ETFL284  | Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile         |       | ANT                          | 88.658             | 5.951                              | 12.210            | EUR 17,370    | 1.539.989,46             | 4,49                    |
| DE000DK0V7C3  | Deka Nachh.Sel.Akt.Rheinediti. Inhaber-Anteile I   |       | ANT                          | 21.257             | 0                                  | 0                 | EUR 85,190    | 1.810.883,83             | 5,28                    |
| DE0008480666  | Deka Rentenfonds RheinEdition Inhaber-Anteile      |       | ANT                          | 61.114             | 0                                  | 0                 | EUR 29,390    | 1.796.140,46             | 5,24                    |
| DE000DK094E9  | Deka-Multimanager Renten Inhaber-Anteile           |       | ANT                          | 41.713             | 0                                  | 12.142            | EUR 73,500    | 3.065.905,50             | 8,94                    |
| AT000A34MN2   | Deka-Sektorinvest Nam.-Ant. VTIA                   |       | ANT                          | 12.663             | 0                                  | 946               | EUR 108,040   | 1.368.110,52             | 3,99                    |
| LU0230856071  | IFM-Invest: Renten Europa Inhaber-Anteile          |       | ANT                          | 55.407             | 3.697                              | 5.034             | EUR 74,860    | 4.147.768,02             | 12,09                   |
| LU0203963425  | IFM-Invest: Vermögensma.Aktien Inhaber-Anteile     |       | ANT                          | 61.839             | 5.462                              | 12.065            | EUR 106,390   | 6.579.051,21             | 19,17                   |
| DE0008474537  | RenditDeka Inhaber-Anteile CF                      |       | ANT                          | 16.298             | 3.710                              | 4.147             | EUR 22,310    | 363.608,38               | 1,06                    |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>4.982.786,71</b>      | <b>14,52</b>            |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>2.765.475,20</b>      | <b>8,05</b>             |
| DE000A3ERMA3  | Berenberg Guardian Inhaber-Anteile M A             |       | ANT                          | 2.573              | 2.573                              | 0                 | EUR 100,620   | 258.895,26               | 0,75                    |
| DE000A407MK1  | Defensive Portfolio Inhaber-Anteile X              |       | ANT                          | 6.893              | 6.893                              | 0                 | EUR 98,610    | 679.718,73               | 1,98                    |
| DE000A407MQ8  | Diversified Income Portfolio Inhaber-Anteile X     |       | ANT                          | 345                | 345                                | 0                 | EUR 100,250   | 34.586,25                | 0,10                    |
| DE000A0D8QZ7  | iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)      |       | ANT                          | 20.297             | 0                                  | 1.461             | EUR 32,720    | 664.117,84               | 1,94                    |
| LU2018762653  | MUL Amundi US Curve Ste 2-10Y UCITS ETF Inh.A. Acc |       | ANT                          | 2.046              | 0                                  | 0                 | EUR 88,830    | 181.746,18               | 0,53                    |
| LU1602110832  | Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.     |       | ANT                          | 1.353              | 0                                  | 145               | EUR 256,680   | 347.288,04               | 1,01                    |
| LU0717821077  | Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I       |       | ANT                          | 361                | 0                                  | 70                | EUR 584,220   | 210.903,42               | 0,61                    |
| LU1496798478  | Schroder ISF Euro High Yield Namensant. IZ Acc.    |       | ANT                          | 1.064              | 0                                  | 0                 | EUR 184,537   | 196.347,37               | 0,57                    |
| LU2094083099  | UBS (Lux) BF-EO H. Yield (EUR) N.-Ant. I-A3-Acc 1  |       | ANT                          | 1.627              | 0                                  | 0                 | EUR 117,930   | 191.872,11               | 0,56                    |
| <b>JPY</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>359.939,86</b>        | <b>1,05</b>             |
| LU0950671825  | UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.   |       | ANT                          | 16.518             | 0                                  | 0                 | JPY 3.605,500 | 359.939,86               | 1,05                    |
| <b>USD</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>1.857.371,65</b>      | <b>5,42</b>             |
| LU0786609700  | GS Fds-GS Gl.Millen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.   |       | ANT                          | 7.362              | 0                                  | 1.753             | USD 32,210    | 218.432,22               | 0,64                    |
| IE000MLMNY50  | iShs III-S&P 500 Equi.Weil.ETF Reg.Shs () Acc.     |       | ANT                          | 176.214            | 370.691                            | 194.477           | USD 6,324     | 1.026.475,76             | 2,99                    |
| IE00B3WJKG14  | iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)    |       | ANT                          | 11.122             | 1.791                              | 4.047             | USD 33,390    | 342.081,41               | 1,00                    |
| LU2210346602  | Schroder ISF-Gl.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.   |       | ANT                          | 22.641             | 0                                  | 4.540             | USD 12,964    | 270.382,26               | 0,79                    |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>EUR 30.200.331,05</b> | <b>88,03</b>            |
| <b>Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Dez.24   |  | XEUR  | EUR                          | Anzahl -25         |                                    |                   |               | -248,96                  | 0,00                    |
| E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Dez. 24  |  | XCME  | USD                          | Anzahl 1           |                                    |                   |               | -7.655,00                | -0,02                   |
| <b>Optionsrechte**)</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| S & P 500 Index (S500) Put März 25 5500   |  | XCBO  |                              | Anzahl 3           |                                    |                   | USD 107,790   | 7.406,04                 | 0,02                    |
| <b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>EUR 29.787,21</b>     | <b>0,09</b>             |
| <b>Zins-Derivate</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| EURO Bobl Future (FGBM) Dez. 24   |  | XEUR  | EUR                          | 2.100.000          |                                    |                   |               | -104.350,53              | -0,31                   |
| EURO Bund Future (FGBL) Dez. 24   |  | XEUR  | EUR                          | 1.800.000          |                                    |                   |               | 420,00                   | 0,00                    |
| Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Dez. 24   |  | XCBT  | USD                          | 4.200.000          |                                    |                   |               | -5.550,00                | -0,02                   |
| <b>Summe der Zins-Derivate</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>EUR -99.220,53</b>    | <b>-0,29</b>            |
|   |  |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>EUR -104.350,53</b>   | <b>-0,31</b>            |

# KölnFondsStruktur: Wachstum

| ISIN   | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge<br>Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|--|--|-------|------------------------------|--------------------|---------------------------------------|-------------------|------------|----------------------|-------------------------|
| <b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>           |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
| <b>Bankguthaben</b>  |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
| <b>EUR-Guthaben bei</b>  |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|  | DekaBank Deutsche Girozentrale                                 |       | EUR                          | 3.826.239,44       |                                       |                   | % 100,000  | 3.826.239,44         | 11,15                   |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                          |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|  | DekaBank Deutsche Girozentrale                                 |       | JPY                          | 2.907.765,00       |                                       |                   | % 100,000  | 17.573,82            | 0,05                    |
|  | DekaBank Deutsche Girozentrale                                 |       | USD                          | 111.009,15         |                                       |                   | % 100,000  | 102.256,03           | 0,30                    |
|  | <b>Summe der Bankguthaben</b>                                  |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>3.946.069,29</b>  | <b>11,50</b>            |
| <b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|  |  |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>3.946.069,29</b>  | <b>11,50</b>            |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                               |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|  | Einschüsse (Initial Margins)                                   |       | EUR                          | 147.631,00         |                                       |                   |            | 147.631,00           | 0,43                    |
|  | Einschüsse (Initial Margins)                                   |       | USD                          | 95.200,00          |                                       |                   |            | 87.693,44            | 0,26                    |
|  | Forderungen aus Anteilsceingeschäften                          |       | EUR                          | 827,64             |                                       |                   |            | 827,64               | 0,00                    |
|  | Forderungen aus Bestandsprovisionen                            |       | EUR                          | 15.532,35          |                                       |                   |            | 15.532,35            | 0,05                    |
|  | <b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>                |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>251.684,43</b>    | <b>0,74</b>             |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                  |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|  | Verwaltungsvergütung   |       | EUR                          | -1.470,46          |                                       |                   |            | -1.470,46            | 0,00                    |
|  | Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften                    |       | EUR                          | -18.295,20         |                                       |                   |            | -18.295,20           | -0,05                   |
|  | <b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>                   |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>-19.765,66</b>    | <b>-0,05</b>            |
| <b>Fondsvermögen</b>   |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|  | <b>Umlaufende Anteile</b>                                      |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>34.303.506,83</b> | <b>100,00</b>           |
|  | <b>Anteilwert</b>  |       |                              |                    |                                       |                   | <b>STK</b> | <b>788.371,000</b>   |                         |
|  |  |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>43,51</b>         |                         |
| <b>Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf</b>                |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|  | Anzahl des Anteilumlaufs am Beginn des Berichtszeitraumes      |       |                              |                    |                                       |                   |            | 825.828,000          |                         |
|  | Anzahl der ausgegebenen Anteile                                |       |                              |                    |                                       |                   |            | 12.082,000           |                         |
|  | Anzahl der zurückgezahlten Anteile                             |       |                              |                    |                                       |                   |            | 49.539,000           |                         |
|  | <b>Anzahl des Anteilumlaufs am Ende des Berichtszeitraumes</b> |       |                              |                    |                                       |                   |            | <b>788.371,000</b>   |                         |
| <b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>             |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
| <b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>                |  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |

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

\*\*) Bei Future-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung durch tägliche Ausgleichszahlungen (Variation Margin); bei Stock-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung bei Geschäftsabschluss. Stock-Styled Optionsrechte fließen mit ihrem Kurswert in das Sondervermögen ein, Future-Styled Optionsrechte mit ihrem unrealisierten Ergebnis.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Zertifikate, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 30.10.2024

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.10.2024

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2024

|                            |       |           |                |
|----------------------------|-------|-----------|----------------|
| Vereinigte Staaten, Dollar | (USD) | 1,08560   | = 1 Euro (EUR) |
| Japan, Yen                 | (JPY) | 165,46000 | = 1 Euro (EUR) |

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

|      |   |
|------|---|
| XEUR | Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)            |
| XCBO | Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE) |
| XCME | Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)     |
| XCBT | Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)         |

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.10.2024 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

### Finanztermingeschäfte

|   |     |              |
|---|-----|--------------|
| - gekaufte Terminkontrakte auf Indices  | EUR | 269.528,37   |
| - verkaufte Terminkontrakte auf Renten  | EUR | 9.165.623,83 |
| - verkaufte Terminkontrakte auf Indices | EUR | 1.227.500,00 |

# KölnFondsStruktur: Wachstum

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.<br>Anteile bzw.<br>Nominal in Whg. | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|---|--|---|-------------------|----------------------|
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>               |  |   |                   |                      |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b> |  |   |                   |                      |
| <b>EUR</b>  |  |   |                   |                      |
| LU1958620871                                      | AGIF-Allianz Emer.Mkts Sov. Bd Act. N. WT H2 Acc.  | ANT   | 0                 | 430                  |
| LU0575255335                                      | Assenagon Alpha Volatility Namens-Anteile I2 Acc.  | ANT   | 0                 | 306                  |
| LU1057294727                                      | BGF - Emerging Markets Bond Fd Act.Nom. I2 Acc.Hdg | ANT   | 0                 | 35.790               |
| LU2548015424                                      | J.H.H.E.M.D.H.C.F Act.Nom. E2 H Acc.               | ANT   | 0                 | 735                  |
| LU1829218749                                      | MUL-Am.Bi.E.-W.Comm.xAgr.U.ETF Namens-Ant. Acc.    | ANT   | 0                 | 43.915               |
| DE000A3DQ2Q1                                      | Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X       | ANT   | 0                 | 3.369                |

# KölnFondsStruktur: Wachstum

## Anhang.

|   |     |             |
|---|-----|-------------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) |     | 88,03       |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)    |     | -0,22       |
| Umlaufende Anteile                              | STK | 788.371,000 |
| Anteilwert                                      | EUR | 43,51       |

### Angaben zu Bewertungsverfahren

#### 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.

Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:

|  |      |
|--|------|
| Berenberg Guardian Inhaber-Anteile M A             | 0,75 |
| Defensive Portfolio Inhaber-Anteile X              | 0,08 |
| Deka Bund + S Finanz: 7-15 Inhaber-Anteile I       | 0,60 |
| Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile         | 0,30 |
| Deka Nachh.Sel.Akt.Rheinediti. Inhaber-Anteile I   | 0,70 |
| Deka Rentenfonds RheinEdition Inhaber-Anteile      | 0,55 |
| Deka-Multimanager Renten Inhaber-Anteile           | 0,60 |
| Deka-SektorInvest Nam.-Ant. VTIA                   | 0,40 |
| DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)   | 1,00 |
| Diversified Income Portfolio Inhaber-Anteile X     | 0,08 |
| GS Fds-GS Gl.Millen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.   | 0,75 |
| IFM-Invest: Renten Europa Inhaber-Anteile          | 0,54 |
| IFM-Invest: Vermögensma.Aktien Inhaber-Anteile     | 1,00 |
| MUL Amundi US Curve Ste 2-10Y UCITS ETF Inh.A. Acc | 0,30 |
| RenditDeka Inhaber-Anteile CF                      | 0,65 |
| Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.     | 0,80 |
| Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I       | 0,80 |
| Schroder ISF Euro High Yield Namensant. IZ Acc.    | 0,50 |
| Schroder ISF-Gl.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.   | 0,75 |
| UBS (Lux) BF-EO H. Yield (EUR) N.-Ant. I-A3-Acc 1  | 0,43 |
| UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.   | 0,19 |
| iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)      | 0,19 |
| iShs III-S&P 500 Equ.Weit.ETF Reg.Shs () Acc.      | 0,20 |
| iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)    | 0,15 |

# KölnFondsStruktur: Chance

## Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024.

| Gliederung nach Anlageart - Land                            | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| Deutschland   | 9.991.142,68         | 20,35                        |
| Irland  | 5.715.758,73         | 11,64                        |
| Luxemburg   | 22.352.625,18        | 45,50                        |
| Österreich  | 2.937.607,60         | 5,98                         |
| <b>2. Zertifikate</b>                                       |                      |                              |
| Irland  | 3.982.865,12         | 8,10                         |
| <b>3. Derivate</b>  | <b>-71.559,75</b>    | <b>-0,14</b>                 |
| <b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>3.786.457,00</b>  | <b>7,71</b>                  |
| <b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>441.122,56</b>    | <b>0,90</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-18.121,45</b>    | <b>-0,04</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>49.117.897,67</b> | <b>100,00</b>                |

| Gliederung nach Anlageart - Währung                         | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| EUR   | 34.000.562,57        | 69,21                        |
| JPY   | 248.436,52           | 0,51                         |
| USD   | 6.748.135,10         | 13,75                        |
| <b>2. Zertifikate</b>                                       |                      |                              |
| EUR   | 3.982.865,12         | 8,10                         |
| <b>3. Derivate</b>  | <b>-71.559,75</b>    | <b>-0,14</b>                 |
| <b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>3.786.457,00</b>  | <b>7,71</b>                  |
| <b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>441.122,56</b>    | <b>0,90</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-18.121,45</b>    | <b>-0,04</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>49.117.897,67</b> | <b>100,00</b>                |

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

# KölnFondsStruktur: Chance

## Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024.

| ISIN  | Gattungsbezeichnung                               | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs          | Kurswert in EUR          | % des Fondsvermögens *) |
|---|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------------|--------------------------|-------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>3.982.865,12</b>      | <b>8,10</b>             |
| <b>Zertifikate</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>3.982.865,12</b>      | <b>8,10</b>             |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>3.982.865,12</b>      | <b>8,10</b>             |
| DE000A2T0VU5  | XTrackers ETC PLC Rohst.-Zert. XAU 20/80          |       | STK                          | 100.781            | 51.598                             | 23.575            | EUR 39,520    | 3.982.865,12             | 8,10                    |
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>40.997.134,19</b>     | <b>83,47</b>            |
| <b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>3.950.085,60</b>      | <b>8,04</b>             |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>3.950.085,60</b>      | <b>8,04</b>             |
| LU117993268   | DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)  |       | ANT                          | 24.622             | 2.623                              | 1.974             | EUR 143,240   | 3.526.855,28             | 7,18                    |
| LU1138302986  | Deka-USA Aktien Spezial Inhaber-Anteile I         |       | ANT                          | 1.454              | 0                                  | 0                 | EUR 291,080   | 423.230,32               | 0,86                    |
| <b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>21.705.921,19</b>     | <b>44,18</b>            |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>21.705.921,19</b>     | <b>44,18</b>            |
| DE000ETF284   | Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile        |       | ANT                          | 42.006             | 26.851                             | 28.846            | EUR 17,370    | 729.644,22               | 1,49                    |
| DE000ETF573   | Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile    |       | ANT                          | 6.843              | 0                                  | 1.508             | EUR 51,560    | 352.825,08               | 0,72                    |
| DE000DK0V7C3  | Deka Nachh.Sel.Akt.Rheinediti. Inhaber-Anteile I  |       | ANT                          | 34.877             | 0                                  | 0                 | EUR 85,190    | 2.971.171,63             | 6,05                    |
| DE0008480666  | Deka Rentenfonds RheinEdition Inhaber-Anteile     |       | ANT                          | 83.857             | 0                                  | 0                 | EUR 29,390    | 2.464.557,23             | 5,02                    |
| AT0000A34MN2  | Deka-Sektorinvest Nam.-Ant. VTIA                  |       | ANT                          | 27.190             | 0                                  | 1.307             | EUR 108,040   | 2.937.607,60             | 5,98                    |
| LU0203962963  | IFM-Invest: Aktien Europa Inhaber-Anteile         |       | ANT                          | 99.981             | 2.485                              | 9.141             | EUR 48,350    | 4.834.081,35             | 9,83                    |
| LU0203963185  | IFM-Invest: Aktien USA Inhaber-Anteile            |       | ANT                          | 16.968             | 733                                | 2.406             | EUR 437,060   | 7.416.034,08             | 15,09                   |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>15.341.127,40</b>     | <b>31,25</b>            |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>8.344.555,78</b>      | <b>16,99</b>            |
| DE000A3ERMA3  | Berenberg Guardian Inhaber-Anteile M A            |       | ANT                          | 4.880              | 4.880                              | 0                 | EUR 100,620   | 491.025,60               | 1,00                    |
| DE000A407MK1  | Defensive Portfolio Inhaber-Anteile X             |       | ANT                          | 14.698             | 14.698                             | 0                 | EUR 98,610    | 1.449.369,78             | 2,95                    |
| DE000A407MQ8  | Diversified Income Portfolio Inhaber-Anteile X    |       | ANT                          | 490                | 490                                | 0                 | EUR 100,250   | 49.122,50                | 0,10                    |
| LU2608816471  | FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.      |       | ANT                          | 183.100            | 9.750                              | 18.611            | EUR 10,480    | 1.918.888,00             | 3,91                    |
| DE000A0D8QZ7  | iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)     |       | ANT                          | 45.337             | 0                                  | 0                 | EUR 32,720    | 1.483.426,64             | 3,02                    |
| IE00BF4G6Z54  | JPM I.-GIEM R.E.I.E.ETF R.S.JPM G.EM R.E.I.E.DL A |       | ANT                          | 33.242             | 33.242                             | 0                 | EUR 29,400    | 977.314,80               | 1,99                    |
| LU1602110832  | Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.    |       | ANT                          | 2.844              | 0                                  | 265               | EUR 256,680   | 729.997,92               | 1,49                    |
| LU0717821077  | Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I      |       | ANT                          | 776                | 0                                  | 0                 | EUR 584,220   | 453.354,72               | 0,92                    |
| LU1496798478  | Schroder ISF Euro High Yield Namensant. IZ Acc.   |       | ANT                          | 2.883              | 0                                  | 0                 | EUR 184,537   | 532.020,17               | 1,08                    |
| LU2094083099  | UBS (Lux) BF-EO H. Yield (EUR) N.-Ant. I-A3-Acc 1 |       | ANT                          | 2.205              | 0                                  | 0                 | EUR 117,930   | 260.035,65               | 0,53                    |
| <b>JPY</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>248.436,52</b>        | <b>0,51</b>             |
| LU0950671825  | UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.  |       | ANT                          | 11.401             | 0                                  | 33.813            | JPY 3.605,500 | 248.436,52               | 0,51                    |
| <b>USD</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>6.748.135,10</b>      | <b>13,75</b>            |
| LU0786609700  | GS Fds-GS Gl.Millen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.  |       | ANT                          | 14.517             | 0                                  | 1.996             | USD 32,210    | 430.722,71               | 0,88                    |
| IE000MLMNY50  | iShs III-S&P 500 Equ.WeI.ETF Reg.Shs () Acc.      |       | ANT                          | 378.824            | 782.400                            | 403.576           | USD 6,324     | 2.206.712,61             | 4,49                    |
| IE00B5L8K969  | iShs VII-MSCI EM Asia U.ETF Reg.Shares (Acc)      |       | ANT                          | 5.731              | 5.731                              | 0                 | USD 187,790   | 991.363,75               | 2,02                    |
| IE00BMTX1Y45  | iShs VI-iSh.S&P 500 Swap U.E. Reg.Shares (Acc)    |       | ANT                          | 87.850             | 121.967                            | 34.117            | USD 9,588     | 775.897,74               | 1,58                    |
| IE00B3WJG14   | iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)   |       | ANT                          | 24.855             | 0                                  | 3.665             | USD 33,390    | 764.469,83               | 1,56                    |
| LU0746585719  | Robeco CGF.-R.QI E.M.En.In.Eq. Act. Nominatives I |       | ANT                          | 6.059              | 6.059                              | 0                 | USD 174,980   | 976.606,32               | 1,99                    |
| LU2210346602  | Schroder ISF-Gl.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.  |       | ANT                          | 50.440             | 0                                  | 4.339             | USD 12,964    | 602.362,14               | 1,23                    |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>EUR 44.979.999,31</b> | <b>91,57</b>            |
| <b>Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |   |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>16.290,21</b>         | <b>0,04</b>             |
| DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Dez.24   |   | XEUR  | EUR                          | Anzahl -68         |                                    |                   |               | -20.740,00               | -0,04                   |
| E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Dez. 24  |   | XCME  | USD                          | Anzahl 5           |                                    |                   |               | 37.030,21                | 0,08                    |
| <b>Optionsrechte**)</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>59.574,43</b>         | <b>0,12</b>             |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>59.574,43</b>         | <b>0,12</b>             |
| S & P 500 Index (S500) Put März 25 5500   |   | XCBO  |                              | Anzahl 6           |                                    |                   | USD 107,790   | 59.574,43                | 0,12                    |
| <b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>EUR 75.864,64</b>     | <b>0,16</b>             |
| <b>Zins-Derivate</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |               |                          |                         |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |               | <b>-147.424,39</b>       | <b>-0,30</b>            |
| EURO Bobl Future (FGBM) Dez. 24   |   | XEUR  | EUR                          | 2.000.000          |                                    |                   |               | -900,00                  | 0,00                    |

# KölnFondsStruktur: Chance

| ISIN | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|------|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|---------------------------------------|------------|----------------------|-------------------------|
|      | Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Dez. 24                      | XCBT  | USD                          | 6.200.000          |                                    |                                       |            | -146.524,39          | -0,30                   |
|      | <b>Summe der Zins-Derivate</b>                                     |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>EUR</b> | <b>-147.424,39</b>   | <b>-0,30</b>            |
|      | <b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>           |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      |                         |
|      | <b>Bankguthaben</b>  |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      |                         |
|      | <b>EUR-Guthaben bei</b>  |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      |                         |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | EUR                          | 1.832.629,46       |                                    |                                       | % 100,000  | 1.832.629,46         | 3,73                    |
|      | <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                          |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      |                         |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | JPY                          | 901.755,00         |                                    |                                       | % 100,000  | 5.449,99             | 0,01                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | USD                          | 2.115.158,67       |                                    |                                       | % 100,000  | 1.948.377,55         | 3,97                    |
|      | <b>Summe der Bankguthaben</b>                                      |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>EUR</b> | <b>3.786.457,00</b>  | <b>7,71</b>             |
|      | <b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>EUR</b> | <b>3.786.457,00</b>  | <b>7,71</b>             |
|      | <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                               |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      |                         |
|      | Einschüsse (Initial Margins)                                       |       | EUR                          | 249.711,30         |                                    |                                       |            | 249.711,30           | 0,51                    |
|      | Einschüsse (Initial Margins)                                       |       | USD                          | 180.000,00         |                                    |                                       |            | 165.806,93           | 0,34                    |
|      | Forderungen aus Anteilscheingeschäften                             |       | EUR                          | 663,93             |                                    |                                       |            | 663,93               | 0,00                    |
|      | Forderungen aus Bestandsprovisionen                                |       | EUR                          | 24.940,40          |                                    |                                       |            | 24.940,40            | 0,05                    |
|      | <b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>                    |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>EUR</b> | <b>441.122,56</b>    | <b>0,90</b>             |
|      | <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                  |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      |                         |
|      | Verwaltungsvergütung   |       | EUR                          | -12.588,70         |                                    |                                       |            | -12.588,70           | -0,03                   |
|      | Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften                       |       | EUR                          | -5.532,75          |                                    |                                       |            | -5.532,75            | -0,01                   |
|      | <b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>                       |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>EUR</b> | <b>-18.121,45</b>    | <b>-0,04</b>            |
|      | <b>Fondsvermögen</b>   |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>EUR</b> | <b>49.117.897,67</b> | <b>100,00</b>           |
|      | <b>Umlaufende Anteile</b>  |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>STK</b> | <b>667.720,000</b>   |                         |
|      | <b>Anteilwert</b>  |       |                              |                    |                                    |                                       | <b>EUR</b> | <b>73,56</b>         |                         |
|      | <b>Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf</b>                |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      |                         |
|      | Anzahl des Anteilumlaufs am Beginn des Berichtszeitraumes          |       |                              |                    |                                    |                                       |            | 693.901,000          |                         |
|      | Anzahl der ausgegebenen Anteile                                    |       |                              |                    |                                    |                                       |            | 9.922,000            |                         |
|      | Anzahl der zurückgezahlten Anteile                                 |       |                              |                    |                                    |                                       |            | 36.103,000           |                         |
|      | <b>Anzahl des Anteilumlaufs am Ende des Berichtszeitraumes</b>     |       |                              |                    |                                    |                                       |            | <b>667.720,000</b>   |                         |
|      | <b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>             |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      | <b>91,57</b>            |
|      | <b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>                |       |                              |                    |                                    |                                       |            |                      | <b>-0,14</b>            |

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

\*\*) Bei Future-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung durch tägliche Ausgleichszahlungen (Variation Margin); bei Stock-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung bei Geschäftsabschluss. Stock-Styled Optionsrechte fließen mit ihrem Kurswert in das Sondervermögen ein, Future-Styled Optionsrechte mit ihrem unrealisierten Ergebnis.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Zertifikate, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 30.10.2024

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.10.2024

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2024

|                            |       |           |                |
|----------------------------|-------|-----------|----------------|
| Vereinigte Staaten, Dollar | (USD) | 1,08560   | = 1 Euro (EUR) |
| Japan, Yen                 | (JPY) | 165,46000 | = 1 Euro (EUR) |

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

|      |   |
|------|---|
| XEUR | Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)            |
| XCBO | Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE) |
| XCME | Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)     |
| XCBT | Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)         |

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.10.2024 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

### Finanztermingeschäfte

|   |            |                     |
|---|------------|---------------------|
| - gekaufte Terminkontrakte auf Indices  | <b>EUR</b> | <b>1.347.641,86</b> |
| - verkaufte Terminkontrakte auf Indices | <b>EUR</b> | <b>8.697.396,60</b> |
|   | <b>EUR</b> | <b>3.338.800,00</b> |

# KölnFondsStruktur: Chance

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.<br>Anteile bzw.<br>Nominal in Whg. | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|---|--|---|-------------------|----------------------|
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>               |  |   |                   |                      |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b> |  |   |                   |                      |
| <b>EUR</b>  |  |   |                   |                      |
| LU1057294727                                      | BGF - Emerging Markets Bond Fd Act.Nom. I2 Acc.Hdg | ANT   | 0                 | 25.901               |
| LU1559747883                                      | BGF - Emerging Markets Fund Act. Nom. Classe I2    | ANT   | 3.065             | 144.274              |
| LU1926204493                                      | Frank.E.M.D.Opps Hard Cr. Act. Nom. I Ydis H1 Dis. | ANT   | 0                 | 26.415               |
| LU1773286189                                      | JPM Fds-Em.Mark.Loc.Curr.Debt Act. Nom. I2 Acc.    | ANT   | 0                 | 5.009                |
| LU2018762653                                      | MUL Amundi US Curve Ste 2-10Y UCITS ETF Inh.A. Acc | ANT   | 0                 | 1.349                |
| LU1829218749                                      | MUL-Am.BLE.-W.Comm.xAgr.U.ETF Namens-Ant. Acc.     | ANT   | 0                 | 92.650               |
| LU0170991672                                      | Pictet-Global Emerging Debt Namens-Anteile         | ANT   | 0                 | 1.933                |
| <b>USD</b>  |  |   |                   |                      |
| LU0107852435                                      | GAM Multibd-Local Emerging Bd Act. Nom. C          | ANT   | 0                 | 1.208                |

# KölnFondsStruktur: Chance

## Anhang.

|   |     |             |
|---|-----|-------------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) |     | 91,57       |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)    |     | -0,14       |
| Umlaufende Anteile                              | STK | 667.720,000 |
| Anteilwert                                      | EUR | 73,56       |

### Angaben zu Bewertungsverfahren

#### 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.

Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:

|   |      |
|---|------|
| Berenberg Guardian Inhaber-Anteile M A            | 0,75 |
| Defensive Portfolio Inhaber-Anteile X             | 0,08 |
| Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile        | 0,30 |
| Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile    | 0,25 |
| Deka Nachh.Sel.Akt.Rheinediti. Inhaber-Anteile I  | 0,70 |
| Deka Rentenfonds RheinEdition Inhaber-Anteile     | 0,55 |
| Deka-SektorInvest Nam.-Ant. VTIA                  | 0,40 |
| Deka-USA Aktien Spezial Inhaber-Anteile I         | 0,45 |
| DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)  | 1,00 |
| Diversified Income Portfolio Inhaber-Anteile X    | 0,08 |
| FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.      | 0,64 |
| GS Fds-GS GIMillen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.   | 0,75 |
| IFM-Invest: Aktien Europa Inhaber-Anteile         | 1,00 |
| IFM-Invest: Aktien USA Inhaber-Anteile            | 1,00 |
| JPM I.-GIEM R.E.I.E.TF R.SJPM GEM R.E.I.E.DL A    | 0,36 |
| Robeco CGF.-R.QI E.M.En.In.Eq. Act. Nominatives I | 0,35 |
| Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.    | 0,80 |
| Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I      | 0,80 |
| Schroder ISF Euro High Yield Namensant. IZ Acc.   | 0,50 |
| Schroder ISF-GI.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.  | 0,75 |
| UBS (Lux) BF-EO H. Yield (EUR) N.-Ant. I-A3-Acc 1 | 0,43 |
| UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.  | 0,19 |
| iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)     | 0,19 |
| iShs III-S&P 500 Equ.Weit.ETF Reg.Shs () Acc.     | 0,20 |
| iShs VI-iSh.S&P 500 Swap U.E. Reg.Shares (Acc.)   | 0,07 |
| iShs VII-MSCI EM Asia U.ETF Reg.Shares (Acc)      | 0,20 |
| iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)   | 0,15 |

# KölnFondsStruktur: ChancePlus

## Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2024.

| Gliederung nach Anlageart - Land                            | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| Deutschland   | 5.428.512,86         | 19,12                        |
| Irland  | 8.783.891,88         | 30,93                        |
| Luxemburg   | 11.694.398,01        | 41,21                        |
| Österreich  | 2.284.073,64         | 8,03                         |
| <b>2. Derivate</b>  | <b>45.292,33</b>     | <b>0,16</b>                  |
| <b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>142.674,80</b>    | <b>0,50</b>                  |
| <b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>38.581,47</b>     | <b>0,14</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-24.751,02</b>    | <b>-0,09</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>28.392.673,97</b> | <b>100,00</b>                |

| Gliederung nach Anlageart - Währung                         | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Investmentanteile</b>                                 |                      |                              |
| EUR   | 17.687.100,66        | 62,29                        |
| JPY   | 685.524,05           | 2,42                         |
| USD   | 9.818.251,68         | 34,58                        |
| <b>2. Derivate</b>  | <b>45.292,33</b>     | <b>0,16</b>                  |
| <b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>142.674,80</b>    | <b>0,50</b>                  |
| <b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>38.581,47</b>     | <b>0,14</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-24.751,02</b>    | <b>-0,09</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>28.392.673,97</b> | <b>100,00</b>                |

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

# KölnFondsStruktur: ChancePlus

## Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024.

| ISIN  | Gattungsbezeichnung                                | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs           | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |              |
|---|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|----------------|----------------------|-------------------------|--------------|
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>28.190.876,39</b> | <b>99,29</b>            |              |
| <b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>4.204.514,48</b>  | <b>14,81</b>            |              |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>4.204.514,48</b>  | <b>14,81</b>            |              |
| LU0368601893  | Deka-Europa Aktien Spezial Inhaber-Anteile I(A)    |       | ANT                          | 1.292              | 0                                  | 0                 | EUR 243,930    | 315.157,56           | 1,11                    |              |
| LU1117993268  | DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)   |       | ANT                          | 15.147             | 1.540                              | 1.177             | EUR 143,240    | 2.169.656,28         | 7,64                    |              |
| LU1138302986  | Deka-USA Aktien Spezial Inhaber-Anteile I          |       | ANT                          | 5.908              | 217                                | 0                 | EUR 291,080    | 1.719.700,64         | 6,06                    |              |
| <b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>6.702.094,74</b>  | <b>23,59</b>            |              |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>6.702.094,74</b>  | <b>23,59</b>            |              |
| DE000ETFL284  | Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile         |       | ANT                          | 45.543             | 22.705                             | 60.048            | EUR 17,370     | 791.081,91           | 2,79                    |              |
| DE000ETFL573  | Deka MSCI USA CL.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile     |       | ANT                          | 29.512             | 0                                  | 5.552             | EUR 51,560     | 1.521.638,72         | 5,36                    |              |
| DE000DK0V7C3  | Deka Nachh.Sel.Akt.Rhenediti. Inhaber-Anteile I    |       | ANT                          | 24.713             | 0                                  | 0                 | EUR 85,190     | 2.105.300,47         | 7,41                    |              |
| AT0000A34MN2  | Deka-Sektorinvest Nam.-Ant. VTIA                   |       | ANT                          | 21.141             | 632                                | 1.606             | EUR 108,040    | 2.284.073,64         | 8,03                    |              |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>17.284.267,17</b> | <b>60,89</b>            |              |
| <b>EUR</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>6.780.491,44</b>  | <b>23,89</b>            |              |
| IE00BDFD9C92  | BlackRock I-BR Adv.Eu. Equ. Reg.Shs D Acc.         |       | ANT                          | 4.035              | 4.035                              | 0                 | EUR 166,891    | 673.405,19           | 2,37                    |              |
| LU2608816471  | FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.       |       | ANT                          | 130.530            | 38.028                             | 14.426            | EUR 10,480     | 1.367.954,40         | 4,82                    |              |
| DE000A0D8QZ7  | iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)      |       | ANT                          | 30.883             | 0                                  | 1.772             | EUR 32,720     | 1.010.491,76         | 3,56                    |              |
| LU1136954127  | Jan.Hend.-J.H.Pan European Fd Actions Nomi. G2     |       | ANT                          | 75.979             | 0                                  | 62.934            | EUR 8,961      | 680.870,61           | 2,40                    |              |
| IE00BF4G6Z54  | JPM I.-GI.EM R.E.I.E.ETF R.S.JPM G.EM R.E.I.E.DL A |       | ANT                          | 27.041             | 27.041                             | 0                 | EUR 29,400     | 795.005,40           | 2,80                    |              |
| IE00BF4G7183  | JPM ICAV-EU Res.EI Eq.ETF Reg.ShJ E.R.E.I.E.E.O A  |       | ANT                          | 15.627             | 15.627                             | 0                 | EUR 42,525     | 664.538,18           | 2,34                    |              |
| LU2040191186  | JPMorgan-Eur. Equity Pl. Fd Act. Nom. I2 PERF Cap. |       | ANT                          | 3.968              | 0                                  | 4.826             | EUR 171,110    | 678.964,48           | 2,39                    |              |
| LU1602110832  | Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.     |       | ANT                          | 2.220              | 0                                  | 150               | EUR 256,680    | 569.829,60           | 2,01                    |              |
| LU0717821077  | Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I       |       | ANT                          | 581                | 0                                  | 78                | EUR 584,220    | 339.431,82           | 1,20                    |              |
| <b>JPY</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>685.524,05</b>    | <b>2,42</b>             |              |
| LU0328437438  | GS Fds-GS Japan Equity Ptf Reg.Shs I Acc.Snap      |       | ANT                          | 3.127              | 324                                | 326               | JPY 27.137,970 | 512.875,81           | 1,81                    |              |
| LU0950671825  | UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.   |       | ANT                          | 7.923              | 7.923                              | 31.469            | JPY 3.605,500  | 172.648,24           | 0,61                    |              |
| <b>USD</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>9.818.251,68</b>  | <b>34,58</b>            |              |
| LU0368250220  | BGF - US Flexible Equity Fd Actions Nominatives I2 |       | ANT                          | 36.311             | 0                                  | 7.650             | USD 47,090     | 1.575.059,87         | 5,55                    |              |
| IE00BFZP7V49  | BlackRock I-BR Adv.US Equ.6 Reg.Shs D Acc.         |       | ANT                          | 7.466              | 0                                  | 2.220             | USD 226,684    | 1.558.974,52         | 5,49                    |              |
| LU0786609700  | GS Fds-GS GI.Millen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.   |       | ANT                          | 11.377             | 0                                  | 1.235             | USD 32,210     | 337.558,19           | 1,19                    |              |
| IE000MLMNY50  | iShs III-S&P 500 Equ.Wei.ETF Reg.Shs () Acc.       |       | ANT                          | 291.339            | 596.969                            | 305.630           | USD 6,324      | 1.697.097,98         | 5,98                    |              |
| IE00B5L8K969  | iShs VII-MSCI EM Asia U.ETF Reg.Shares (Acc)       |       | ANT                          | 4.452              | 4.452                              | 0                 | USD 187,790    | 770.118,90           | 2,71                    |              |
| IE00BMTX1Y45  | iShs VI-iSh.S&P 500 Swap U.E. Reg.Shares (Acc)     |       | ANT                          | 229.959            | 268.425                            | 38.466            | USD 9,588      | 2.031.015,01         | 7,15                    |              |
| IE00B3WJKG14  | iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)    |       | ANT                          | 19.304             | 0                                  | 2.395             | USD 33,390     | 593.736,70           | 2,09                    |              |
| LU0746585719  | Robeco CGF.-R.QI E.M.En.In.Eq. Act. Nominatives I  |       | ANT                          | 4.928              | 4.928                              | 0                 | USD 174,980    | 794.308,62           | 2,80                    |              |
| LU2210346602  | Schroder ISF-GI.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.   |       | ANT                          | 38.551             | 0                                  | 0                 | USD 12,964     | 460.381,89           | 1,62                    |              |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>EUR</b>           | <b>28.190.876,39</b>    | <b>99,29</b> |
| <b>Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| <b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Dez.24   |  | XEUR  | EUR                          | Anzahl -6          |                                    |                   |                | <b>5.576,04</b>      | <b>0,02</b>             |              |
| E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Dez. 24  |  | XCME  | USD                          | Anzahl 1           |                                    |                   |                | -1.830,00            | -0,01                   |              |
| <b>Optionsrechte**)</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>7.406,04</b>      | <b>0,03</b>             |              |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>39.716,29</b>     | <b>0,14</b>             |              |
| S & P 500 Index (S500) Put März 25 5500   |  | XCBO  |                              | Anzahl 4           |                                    |                   | USD 107,790    | 39.716,29            | 0,14                    |              |
| <b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>EUR</b>           | <b>45.292,33</b>        | <b>0,16</b>  |
| <b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>                                |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| <b>Bankguthaben</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| <b>EUR-Guthaben bei</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale  |  |       | EUR                          | 38.022,31          |                                    |                   | % 100,000      | 38.022,31            | 0,13                    |              |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                |                      |                         |              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale  |  |       | GBP                          | 94,26              |                                    |                   | % 100,000      | 112,72               | 0,00                    |              |

# KölnFondsStruktur: ChancePlus

| ISIN | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.10.2024 | Käufe/ Zugänge<br>Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|------|--|-------|------------------------------|--------------------|---------------------------------------|-------------------|------------|----------------------|-------------------------|
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | USD                          | 113.488,37         |                                       |                   | % 100,000  | 104.539,77           | 0,37                    |
|      | <b>Summe der Bankguthaben</b>                                      |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>142.674,80</b>    | <b>0,50</b>             |
|      | <b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>142.674,80</b>    | <b>0,50</b>             |
|      | <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                               |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|      | Einschüsse (Initial Margins)                                       |       | EUR                          | 19.711,30          |                                       |                   |            | 19.711,30            | 0,07                    |
|      | Einschüsse (Initial Margins)                                       |       | USD                          | 11.200,00          |                                       |                   |            | 10.316,88            | 0,04                    |
|      | Forderungen aus Anteilscheingeschäften                             |       | EUR                          | 4.631,04           |                                       |                   |            | 4.631,04             | 0,02                    |
|      | Forderungen aus Bestandsprovisionen                                |       | EUR                          | 3.922,25           |                                       |                   |            | 3.922,25             | 0,01                    |
|      | <b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>                    |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>38.581,47</b>     | <b>0,14</b>             |
|      | <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>                              |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|      | <b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                           |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | JPY                          | -816,00            |                                       |                   | % 100,000  | -4,93                | 0,00                    |
|      | <b>Summe der kurzfristigen Verbindlichkeiten</b>                   |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>-4,93</b>         | <b>0,00</b>             |
|      | <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                  |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|      | Verwaltungsvergütung   |       | EUR                          | -16.963,37         |                                       |                   |            | -16.963,37           | -0,06                   |
|      | Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften                       |       | EUR                          | -7.782,72          |                                       |                   |            | -7.782,72            | -0,03                   |
|      | <b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>                       |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>-24.746,09</b>    | <b>-0,09</b>            |
|      | <b>Fondsvermögen</b>   |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>28.392.673,97</b> | <b>100,00</b>           |
|      | <b>Umlaufende Anteile</b>  |       |                              |                    |                                       |                   | <b>STK</b> | <b>443.343,000</b>   |                         |
|      | <b>Anteilwert</b>  |       |                              |                    |                                       |                   | <b>EUR</b> | <b>64,04</b>         |                         |
|      | <b>Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf</b>                |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      |                         |
|      | Anzahl des Anteilumlafs am Beginn des Berichtszeitraumes           |       |                              |                    |                                       |                   |            | 452.688,000          |                         |
|      | Anzahl der ausgegebenen Anteile                                    |       |                              |                    |                                       |                   |            | 11.349,000           |                         |
|      | Anzahl der zurückgezählten Anteile                                 |       |                              |                    |                                       |                   |            | 20.694,000           |                         |
|      | <b>Anzahl des Anteilumlafs am Ende des Berichtszeitraumes</b>      |       |                              |                    |                                       |                   |            | <b>443.343,000</b>   |                         |
|      | <b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>             |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      | <b>99,29</b>            |
|      | <b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>                |       |                              |                    |                                       |                   |            |                      | <b>0,16</b>             |

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

\*\*) Bei Future-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung durch tägliche Ausgleichszahlungen (Variation Margin); bei Stock-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung bei Geschäftsabschluss. Stock-Styled Optionsrechte fließen mit ihrem Kurswert in das Sondervermögen ein, Future-Styled Optionsrechte mit ihrem unrealisierten Ergebnis.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
In-/ ausländische Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 30.10.2024  
Alle anderen Vermögenswerte per: 31.10.2024

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2024

|                               |       |           |                |
|-------------------------------|-------|-----------|----------------|
| Vereinigtes Königreich, Pfund | (GBP) | 0,83627   | = 1 Euro (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar    | (USD) | 1,08560   | = 1 Euro (EUR) |
| Japan, Yen                    | (JPY) | 165,46000 | = 1 Euro (EUR) |

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

|      |   |
|------|---|
| XEUR | Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)            |
| XCBO | Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE) |
| XCME | Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)     |

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.10.2024 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

|   |     |            |
|---|-----|------------|
| Finanztermingeschäfte                   |     |            |
| - gekaufte Terminkontrakte auf Indices  | EUR | 269.528,37 |
| - verkaufte Terminkontrakte auf Indices | EUR | 294.600,00 |

## 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>Wertpapier-Investmentanteile</b>               |   |                |                   |
|              | <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b> |   |                |                   |
|              | <b>EUR</b>  |   |                |                   |
| LU1559747883 | BGF - Emerging Markets Fund Act. Nom. Classe I2   | ANT                                     | 24.856         | 119.385           |

# KölnFondsStruktur: ChancePlus

## Anhang.

|   |     |             |
|---|-----|-------------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) |     | 99,29       |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)    |     | 0,16        |
| Umlaufende Anteile                              | STK | 443.343,000 |
| Anteilwert                                      | EUR | 64,04       |

### Angaben zu Bewertungsverfahren

#### 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.

Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:

|  |      |
|--|------|
| BGF - US Flexible Equity Fd Actions Nominatives I2 | 0,75 |
| BlackRock I-BR Adv.Eu. Equ. Reg.Shs D Acc.         | 0,35 |
| BlackRock I-BR Adv.US Equ.6 Reg.Shs D Acc.         | 0,30 |
| Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile         | 0,30 |
| Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile     | 0,25 |
| Deka Nachh.Sel.Akt.Rheinediti. Inhaber-Anteile I   | 0,70 |
| Deka-Europa Aktien Spezial Inhaber-Anteile I(A)    | 0,45 |
| Deka-SektorInvest Nam.-Ant. VTIA                   | 0,40 |
| Deka-USA Aktien Spezial Inhaber-Anteile I          | 0,45 |
| DekaLux-Japan Flex Hedged Euro Inh.-Anteile E(A)   | 1,00 |
| FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.       | 0,64 |
| GS Fds-GS Gl.Millen.Equit.Ptf. Regist.Shs.I Acc.   | 0,75 |
| GS Fds-GS Japan Equity Ptf Reg.Shs I Acc.Snap      | 0,65 |
| JPM I-GIEM R.E.I.ETF R.S.JPM G.EM R.E.I.E.DL A     | 0,36 |
| JPM ICAV-EU Res.E.I Eq.ETF Reg.Sh.J E.R.E.I.EEO A  | 0,25 |
| JPMorgan-Eur. Equity Pl. Fd Act. Nom. I2 PERF Cap. | 0,65 |
| Jan.Hend.-J.H.Pan European Fd Actions Nomi. G2     | 0,65 |
| Robeco CGF.-R.QI E.M.En.In.Eq. Act. Nominatives I  | 0,35 |
| Robeco Cap.Gr.F.-R.Dig.Innov. Act. Nom. I Acc.     | 0,80 |
| Robeco Global Consumer Trends Actions Nom. I       | 0,80 |
| Schroder ISF-Gl.Clim.Chan.Equ. Act. Nom. IZ Acc.   | 0,75 |
| UBS(L)FS-MSCI Japan UCITS ETF Namens-Ant. A Acc.   | 0,19 |
| iShares STOXX Europe Small 200 UCITS ETF (DE)      | 0,19 |
| iShs III-S&P 500 Equ.Weit.ETF Reg.Shs () Acc.      | 0,20 |
| iShs VI-iSh.S&P 500 Swap U.E. Reg.Shares (Acc.)    | 0,07 |
| iShs VII-MSCI EM Asia U.ETF Reg.Shares (Acc)       | 0,20 |
| iShsV-S&P 500 Inf.Te.Sec.U.ETF Reg.Shares (Acc)    | 0,15 |

# Fondszusammensetzung.

|                                | KölnFondsStruktur: Ertrag<br>in EUR | KölnFondsStruktur: Wachstum<br>in EUR | KölnFondsStruktur: Chance<br>in EUR | KölnFondsStruktur: ChancePlus<br>in EUR |
|--------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|---|
| <b>Vermögensaufstellung</b>    |                                     |                                       |                                     |   |
| Wertpapiervermögen             | 25.855.025,71                       | 30.200.331,05                         | 44.979.999,31                       | 28.190.876,39                           |
| Derivate                       | -62.061,15                          | -74.812,28                            | -71.559,75                          | 45.292,33                               |
| Bankguthaben/Geldmarktfonds    | 3.280.578,66                        | 3.946.069,29                          | 3.786.457,00                        | 142.674,80                              |
| Sonstige Vermögensgegenstände  | 126.896,24                          | 251.684,43                            | 441.122,56                          | 38.581,47                               |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | -369.161,42                         | 0,00                                  | 0,00                                | -4,93                                   |
| Sonstige Verbindlichkeiten     | -8.990,54                           | -19.765,66                            | -18.121,45                          | -24.746,09                              |
| <b>Fondsvermögen</b>           | <b>28.822.287,50</b>                | <b>34.303.506,83</b>                  | <b>49.117.897,67</b>                | <b>28.392.673,97</b>                    |

|                                | <b>Gesamt<br/>in EUR</b> |
|--------------------------------|--------------------------|
| <b>Vermögensaufstellung</b>    |                          |
| Wertpapiervermögen             | 129.226.232,46           |
| Derivate                       | -163.140,85              |
| Bankguthaben/Geldmarktfonds    | 11.155.779,75            |
| Sonstige Vermögensgegenstände  | 858.284,70               |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | -369.166,35              |
| Sonstige Verbindlichkeiten     | -71.623,74               |
| <b>Fondsvermögen</b>           | <b>140.636.365,97</b>    |

# KölnFondsStruktur:

---

Luxemburg, den 1. November 2024  
Deka International S.A.  
Der Vorstand

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## **AIFM**

Deka International S.A.  
6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Luxemburg

### **Eigenmittel zum 31. Dezember 2023**

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| gezeichnet und eingezahlt | EUR 10,4 Mio. |
| haftend                   | EUR 77,5 Mio. |

### **Vorstand**

Holger Hildebrandt  
Direktor der Deka International S.A., Luxemburg

Eugen Lehnertz  
Direktor der Deka International S.A., Luxemburg

## **Aufsichtsrat des AIFM**

### **Vorsitzender**

Thomas Schneider  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main  
und der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

### **Stellvertretender Vorsitzender**

Holger Knüppe  
Leiter Beteiligungen der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Mitglied des Aufsichtsrats der IQAM Invest GmbH, Salzburg

### **Unabhängiges Mitglied**

Marie-Anne van den Berg, Luxemburg

## **Verwahr-, Zahl- und Transferstelle**

DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main, Niederlassung Luxemburg  
6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Luxemburg

## **Cabinet de révision agréé für den Fonds und den AIFM**

Deloitte Audit  
Société à responsabilité limitée  
20 Boulevard de Kockelscheuer  
1821 Luxembourg,  
Großherzogtum Luxemburg

## **Repräsentant, Zahl-, Informations- und Vertriebsstelle in der Bundesrepublik Deutschland sowie Global Distributor**

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Große Gallusstraße 14  
60315 Frankfurt am Main  
Deutschland

Stand: 31. Oktober 2024

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



**Deka International S.A.**

6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Postfach 5 45  
2015 Luxembourg  
Luxemburg

Telefon: (+3 52) 34 09 - 27 39  
Telefax: (+3 52) 34 09 - 22 90  
[www.deka.lu](http://www.deka.lu)

