

Halbjahresbericht
zum 28. Februar 2023.
Deka-Global Balance

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

28. Februar 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Global Balance für den Zeitraum vom 1. September 2022 bis zum 28. Februar 2023.

Auch mehr als ein Jahr nach dem Beginn des russischen Angriffskriegs auf die Ukraine zählten die Auswirkungen auf die verschiedenen Volkswirtschaften zu den prägenden Faktoren an den internationalen Kapitalmärkten. Exorbitante Preissteigerungen sowie Befürchtungen vor Versorgungsgespässen im Winter sorgten zeitweise für große Verunsicherung, insbesondere in Europa. Gut gefüllte Gasspeicher und leicht nachgebende Teuerungsraten trugen zuletzt jedoch zu einer moderaten Entspannung bei. Daneben führten die Null-Covid-Politik in China und die damit einhergehenden Lockdown-Maßnahmen zu wiederholten Beeinträchtigungen im globalen Handel, ehe im Dezember die Staatsführung einen abrupten Wechsel in der Corona-Politik vollzog.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtshalbjahr die dynamische Inflationsentwicklung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu restriktiven Schritten zwang. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 4,50 bis 4,75 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen bis Ende Februar auf 3,00 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in Aussicht gestellt. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen weiter an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,7 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 3,9 Prozent.

Die Aktienbörsen wiesen im Berichtszeitraum einige Schwankungen auf. Unsicherheiten hinsichtlich der zukünftigen Energiesicherheit und der hohen Inflation in Kombination mit dem Krieg in der Ukraine wechselten sich mit unterstützenden Signalen, wie etwa der Hoffnung auf eine weniger aggressive Fortführung der restriktiven Geldpolitik in den USA, ab. Vor allem in Europa konnten in den ersten beiden Monaten des Jahres 2023 steigende Kurse verzeichnet werden. Unter Druck geriet im Herbst der Euro, der zeitweise unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, sich jedoch ab November wieder spürbar erholte.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Anteilklassen im Überblick	6
Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023	7
Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023	8
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

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

Deka-Global Balance

Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist ein mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs insbesondere durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Fonds enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds weltweit in verzinsliche Wertpapiere, Aktien und Anlageinstrumente mit Rohstoffbezug an. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Aktien und Aktienfonds investiert werden darf, beträgt maximal 35 Prozent. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Anlageinstrumente mit Rohstoffbezug investiert werden darf, beträgt maximal 15 Prozent. Die Auswahl der Vermögenswerte trifft das Fondsmanagement nach einem mathematischen Verfahren, durch welches Trends in der Entwicklung verschiedener Anlageklassen aktiv genutzt werden sollen. Zur Begrenzung der Anlagerisiken erfolgt eine regelmäßige Anpassung der Gewichtung der Anlageklassen. Sollte zu einem Zeitpunkt keine der Investitionsmöglichkeiten den Erwartungen des Fondsmanagements entsprechen, kann vermehrt in kurzfristige, liquide Geldanlagen angelegt werden.

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.

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35% des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland, Frankreichs, der Niederlande, Belgiens, der Vereinigten Staaten von Amerika und des Vereinigten Königreichs Großbritannien und Nordirland investieren.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen der sog. Trendfolgestrategie und dient der Steuerung einer taktischen Vermögensaufteilung im Zeitablauf. Sie nutzt dafür selbstentwickelte quantitative Indikatoren, welche in regelmäßigen Abständen Hinweise zur Markttrichtung geben. Mit Hilfe dieser Indikatoren werden mittelfristige Trends an den Aktien-, Rohstoff- und Rentenmärkten identifiziert. Aus den Trends werden wiederum Renditeprognosen erstellt. Die Güte der aus den Indikatoren gewonnenen Hinweise wird kontinuierlich überprüft und fließt in die Prognosebildung mit ein. Aus den Prognosen wird eine im Hinblick auf Ertragschancen optimierte Vermögensaufteilung sowie eine aktive Durationspositionierung der im Fondsvermögen enthaltenen Renten abgeleitet. Dabei unterliegt die Anlagestrategie keinem Referenzwert als Vergleichsmaßstab oder Orientierungspunkt. Für Phasen ohne erkennbare Trends oder bei schwächeren Hinweisen gibt es eine vordefinierte strategische Vermögensaufteilung und Duration. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation / Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Wichtige Kennzahlen

Deka-Global Balance

Performance*	6 Monate
Anteilklasse CF	-2,7%
Anteilklasse TF	-2,8%

ISIN

Anteilklasse CF	DE000DK2J8N2
Anteilklasse TF	DE000DK2J8P7

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

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds Deka-Global Balance können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung*, der Währung des Anteilwertes, der Vertriebsvergütungen**, der erfolgsabhängigen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von zwei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags und der Verwaltungsvergütung sowie der Vertriebsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung CF und TF.

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

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

Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	0,85% p.a.	3,00%	Ausschüttung
Anteilklasse TF**	1,20% p.a.	keiner	Ausschüttung

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

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

Deka-Global Balance

Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	155.726.740,95	66,20
Deutschland	87.128.987,50	37,04
Frankreich	24.390.350,00	10,37
USA	44.207.403,45	18,79
2. Investmentanteile	31.332.673,20	13,30
Deutschland	9.174.170,04	3,91
Frankreich	3.683,10	0,00
Irland	18.292.220,84	7,76
Luxemburg	3.862.599,22	1,63
3. Zertifikate	16.469,00	0,01
Irland	16.469,00	0,01
4. Derivate	926.839,15	0,43
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	42.875.620,03	18,23
6. Sonstige Vermögensgegenstände	5.035.313,24	2,15
II. Verbindlichkeiten	-752.851,52	-0,32
III. Fondsvermögen	235.160.804,05	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	155.726.740,95	66,20
EUR	111.519.337,50	47,41
USD	44.207.403,45	18,79
2. Investmentanteile	31.332.673,20	13,30
EUR	31.323.208,66	13,30
USD	9.464,54	0,00
3. Zertifikate	16.469,00	0,01
EUR	16.469,00	0,01
4. Derivate	926.839,15	0,43
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	42.875.620,03	18,23
6. Sonstige Vermögensgegenstände	5.035.313,24	2,15
II. Verbindlichkeiten	-752.851,52	-0,32
III. Fondsvermögen	235.160.804,05	100,00

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

Deka-Global Balance

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								106.635.906,50	45,34
Verzinsliche Wertpapiere								106.619.437,50	45,33
EUR								106.619.437,50	45,33
DE000A1E88F4	2,2120 % Aareal Bank AG FLR MTN Hyp.-Pfe. S.108 11/23	EUR		3.500.000	0	0	% 99,939	3.497.847,50	1,49
FR0013431137	0,2500 % Agence Française Développement MTN 19/29	EUR		5.000.000	0	0	% 82,137	4.106.850,00	1,75
DE000BLB7VS4	3,3980 % Bayerische Landesbank FLR IHS 19/23	EUR		9.500.000	0	0	% 100,050	9.504.750,00	4,04
FR0013448776	0,0500 % Bpifrance SACA MTN 19/29	EUR		10.000.000	0	0	% 80,521	8.052.050,00	3,42
XS2104031757	0,0000 % Cais. Ctr. du Crd. Imm. France MTN 20/24	EUR		8.500.000	0	0	% 96,945	8.240.325,00	3,50
DE000CZ40MW3	0,2500 % Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P25 18/23	EUR		6.000.000	6.000.000	0	% 98,475	5.908.500,00	2,51
DE000A2LQNP8	0,2500 % Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15286 19/24	EUR		7.000.000	7.000.000	0	% 97,050	6.793.500,00	2,89
DE000A30WUF3	1,7500 % Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15322 22/27	EUR		5.000.000	5.000.000	0	% 93,441	4.672.025,00	1,99
DE000A289PH2	0,0100 % DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1233 20/28	EUR		9.000.000	4.000.000	0	% 82,991	7.469.190,00	3,18
DE000A1R07S9	2,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 13/23	EUR		7.000.000	0	0	% 99,603	6.972.175,00	2,96
DE000A2BPP50	0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 16/23	EUR		6.500.000	8.000.000	1.500.000	% 98,420	6.397.300,00	2,72
DE000A289K97	2,8780 % Land Berlin FLR Landessch. Ausg.523 20/27	EUR		5.000.000	0	0	% 103,191	5.159.550,00	2,19
DE000A1RQCY2	0,3750 % Land Hessen Schatzanw. S.1605 16/26	EUR		5.000.000	0	0	% 90,936	4.546.800,00	1,93
DE000NRW0ME3	0,0000 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1502 20/25	EUR		6.000.000	6.000.000	0	% 92,790	5.567.400,00	2,37
DE000RLP1346	0,0100 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 22/24 ¹⁾	EUR		10.000.000	0	0	% 97,171	9.717.100,00	4,13
DE000NWB17Z1	3,4430 % NRW.BANK FLR IHS Ausg.17Z 17/23 ¹⁾	EUR		6.000.000	0	0	% 100,383	6.022.950,00	2,56
FR0013489259	0,0000 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. MTN 20/30 ¹⁾	EUR		5.000.000	0	0	% 79,823	3.991.125,00	1,70
Zertifikate								16.469,00	0,01
EUR								16.469,00	0,01
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK		100	145.800	145.700	EUR 164,690	16.469,00	0,01
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								49.107.303,45	20,87
Verzinsliche Wertpapiere								49.107.303,45	20,87
EUR								4.899.900,00	2,08
DE000DL8YQ26	0,2500 % Deutsche Bank AG Festzinsanl. 20/23	EUR		5.000.000	0	0	% 97,998	4.899.900,00	2,08
USD								44.207.403,45	18,79
US912828B667	2,7500 % U.S. Treasury Notes 14/24 ¹⁾	USD		48.000.000	3.000.000	0	% 97,781	44.207.403,45	18,79
Wertpapier-Investmentanteile								31.332.673,20	13,30
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								9.174.170,04	3,91
EUR								9.174.170,04	3,91
DE000DK0V6V5	Deka-Prämienstrategie Select I	ANT		56.732	18.950	0	EUR 95,970	5.444.570,04	2,32
DE0005424568	Deka-Vega Plus I (A)	ANT		56.000	24.600	0	EUR 66,600	3.729.600,00	1,59
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								522.405,00	0,22
EUR								522.405,00	0,22
LU0297135294	Deka-OptiRent 3y CF	ANT		4.500	4.500	0	EUR 116,090	522.405,00	0,22
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								21.636.098,16	9,17
EUR								21.626.633,62	9,17
LU1681041890	AIS-Amundi MSCI Eu.Quality F. Namens-Ant. C Cap.	ANT		100	44.000	43.900	EUR 95,640	9.564,00	0,00
IE00B66F4759	iShs EO H.Yield Corp Bd U.ETF Reg.Shares	ANT		117.500	117.500	0	EUR 91,628	10.766.290,00	4,58
IE00B2QWDY88	iShs III-MSCI Jap.Sm.Cap U.ETF Reg.Shares	ANT		100	69.900	69.800	EUR 34,590	3.459,00	0,00
IE00B2NPKV68	iShsII-J.P.M.USD EM Bond U.ETF Reg.Shares	ANT		100	142.100	142.000	EUR 79,332	7.933,20	0,00
IE00BYZK4669	iShsIV-Ageing Population U.ETF Reg.Shares	ANT		449.000	1.116.000	667.000	EUR 6,278	2.818.822,00	1,20
IE00BYZK4552	iShsIV-Automation&Robot.U.ETF Reg.Shares	ANT		1.000	235.000	234.000	EUR 9,999	9.999,00	0,00
IE00BYXG2H39	iShsIV-NASDAQ US Biotech.U.ETF Reg.Shares Acc.	ANT		100	747.000	746.900	EUR 5,530	553,00	0,00
IE00B6R52143	iShsV-Agribusiness UCITS ETF Reg.Shares (Acc)	ANT		100	75.000	74.900	EUR 47,985	4.798,50	0,00
IE00B9M6RS56	iShsVI-JPM DL EM Bd EOH U.ETFD Reg.Shares	ANT		100	0	0	EUR 65,820	6.582,00	0,00
FR0010524777	Lyxor MSCI NE ESG Fil.DR UETF Act. au Port. Dist	ANT		100	60.000	59.900	EUR 36,831	3.683,10	0,00

Deka-Global Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
LU1829218749	MUL-Am.BI.E.-W.Comm.xAgr.U.ETF Namens-Ant. Acc.		ANT	313	313	0	EUR 22,770	7.130,22	0,00
IE00B9F5YL18	Vanguard FTSE D.A.Px.J.U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	198.600	300.500	101.900	EUR 23,486	4.664.319,60	1,98
LU0328476410	Xtr.S&P Select Frontier Swap 1C USD		ANT	230.000	250.600	20.600	EUR 14,450	3.323.500,00	1,41
IE00B4PY7Y77	iShsII-\$Hgh Yld Corp Bd U.ETF Reg.Shares		ANT	100	265.200	265.100	USD 90,640	8.537,25	0,00
IE00BD1F4N50	iShsIV-Edge MSCI USA M.F.U.ETF Reg.Shares (Acc)		ANT	100	284.900	284.800	USD 9,845	927,29	0,00
Summe Wertpapiervermögen							EUR	187.075.883,15	79,51
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								1.334.445,57	0,56
DJ Stoxx 600 Future (FXXP) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 1.330				315.845,00	0,13
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) März 23		XIOM	USD	Anzahl 1				-1.215,03	0,00
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				3.037,58	0,00
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) März 23		XCME	USD	Anzahl 36				-110.842,82	-0,05
E-Mini S&P Con St.Sel.Se. Idx Future (XAP) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				-4.097,20	0,00
E-Mini S&P Energy Future (XAE) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				-5.962,14	0,00
E-Mini S&P Fin. Select Idx Future (XAF) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				1.483,47	0,00
E-Mini S&P Health C.S.Sec.Idx Future (XAV) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				-11.773,57	-0,01
E-Mini S&P Industr.Sel. Index Future (AIX) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				1.346,90	0,00
E-Mini S&P Materials Future (XAB) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				-1.422,25	0,00
E-Mini S&P Utilities Sect.Idx Future (XAU) März 23		XCME	USD	Anzahl 1				-7.280,78	0,00
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) März 23		IFUS	USD	Anzahl 271				-79.000,66	-0,03
MSCI World Index Future (FMWO) März 23		XEUR	USD	Anzahl -157				26.617,69	0,01
Nikkei 225 Stock Avg. Index Future (JNI) März 23		XOSE	JPY	Anzahl 12				-2.480,28	0,00
STXE 600 Autom. & Par. Index Future (SXAP) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 90				187.245,00	0,08
STXE 600 Banks Future (FSTB) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 230				335.468,46	0,14
STXE 600 Basic Res. Index Future (FSTS) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 1				-3.041,50	0,00
STXE 600 Chemicals Index Future (FSTC) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 1				2.019,50	0,00
STXE 600 Constr.& Mat. Index Future (FSTN) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 92				102.980,00	0,04
STXE 600 Healthcare Index Future (FSTH) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 1				-1.548,00	0,00
STXE 600 Insurance Index Future (FSTI) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 1				666,96	0,00
STXE 600 Media Index Future (FSTM) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 136				100.830,00	0,04
STXE 600 Oil & Gas Index Future (FSTE) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 1				535,00	0,00
STXE 600 Retail Index Future (FSTR) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 93				158.193,31	0,07
STXE 600 Technology Index Future (FSTY) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 56				13.453,42	0,01
STXE 600 Travel & Lei. Index Future (FSTV) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 162				192.618,07	0,08
STXE600 Pers. & H. G. Index Future (FSTZ) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 45				121.121,84	0,05
STXE600 Real Estate Index Future (FSTL) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 1				-352,40	0,00
Optionsrechte								124.076,29	0,10
Optionsrechte auf Aktienindices								149.042,29	0,11
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Dez. 23 2900		XEUR		Anzahl -20			EUR 31,700	-6.340,00	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Dez. 24 2800		XEUR		Anzahl -20			EUR 74,750	-14.950,00	-0,01
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 23 2850		XEUR		Anzahl -20			EUR 7,600	-1.520,00	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 24 2400		XEUR		Anzahl -20			EUR 30,900	-6.180,00	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Mai 23 3075		XEUR		Anzahl -20			EUR 7,050	-1.410,00	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put März 23 4150		XEUR		Anzahl 285			EUR 31,000	88.350,00	0,04
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put März 24 2900		XEUR		Anzahl -23			EUR 44,300	-10.189,00	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Okt. 23 2900		XEUR		Anzahl -20			EUR 24,150	-4.830,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Aug. 23 2900		OTC		Anzahl -200			EUR 16,030	-3.206,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Aug. 24 2650		OTC		Anzahl -200			EUR 48,660	-9.732,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Juli 23 2850		OTC		Anzahl -200			EUR 11,680	-2.336,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put März 23 2700		OTC		Anzahl -175			EUR 0,090	-15,75	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Nov. 23 3000		OTC		Anzahl -175			EUR 31,790	-5.563,25	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Sep. 23 2800		OTC		Anzahl -200			EUR 16,840	-3.368,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Apr. 23 2800		OTC		Anzahl -175			EUR 1,930	-337,75	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Feb. 24 2700		OTC		Anzahl -175			EUR 29,920	-5.236,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Feb. 25 3200		OTC		Anzahl -200			EUR 125,540	-25.108,00	-0,01
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Jan. 24 2800		OTC		Anzahl -175			EUR 31,180	-5.456,50	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Juli 24 2400		OTC		Anzahl -200			EUR 32,540	-6.508,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Mai 24 2600		OTC		Anzahl -200			EUR 36,440	-7.288,00	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Nov. 24 2700		OTC		Anzahl -175			EUR 61,890	-10.830,75	0,00
S & P 500 Index (S500) Put Dez. 23 3000		XCBO		Anzahl -2			USD 45,210	-8.516,53	0,00
S & P 500 Index (S500) Put Juni 23 3000		XCBO		Anzahl -2			USD 11,900	-2.241,69	0,00
S & P 500 Index (S500) Put März 23 4000		XCBO		Anzahl 29			USD 73,900	201.855,51	0,09
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte								-24.966,00	-0,01
ESTX 50 Divi. Index Future (FEXD) Put Dez. 24 95		XEUR		Anzahl -114			EUR 2,190	-24.966,00	-0,01
Summe Aktienindex-Derivate							EUR	1.458.521,86	0,66
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								-241.773,34	-0,10
10 Year Spanish Bono Futures (FBON) März 23		XEUR	EUR	5.800.000				-355.624,84	-0,15

Deka-Global Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	EURO Bund Future (FGBL) März 23	XEUR	EUR	-6.700.000				218.940,00	0,09
	EURO-BTP Future (FBTP) März 23	XEUR	EUR	6.800.000				-240.774,71	-0,10
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) März 23	XEUR	EUR	-5.800.000				136.790,00	0,06
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Juni 23	XCBT	USD	3.000.000				-1.103,79	0,00
	Summe Zins-Derivate						EUR	-241.773,34	-0,10
	Devisen-Derivate								
	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
	Devisenterminkontrakte (Kauf)							136.013,02	0,06
	Offene Positionen								
	USD/EUR 23.700.000,00	OTC						136.013,02	0,06
	Devisenterminkontrakte (Verkauf)							-691.077,33	-0,30
	Offene Positionen								
	USD/EUR 66.700.000,00	OTC						-691.077,33	-0,30
	Summe Devisen-Derivate						EUR	-555.064,31	-0,24
	Sonstige Derivate								
	Sonstige Optionsrechte							265.154,94	0,11
	CBOE Volatility Index (VIX) Put März 23 30	XCBO	USD	12.200			% 9,150	105.142,70	0,04
	CBOE Volatility Index (VIX) Put März 23 35	XCBO	USD	12.200			% 13,925	160.012,24	0,07
	Summe Sonstige Derivate						EUR	265.154,94	0,11
	Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								
	Bankguthaben								
	EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	10.903.898,67			% 100,000	10.903.898,67	4,64
	EUR-Guthaben bei								
	Bayerische Landesbank		EUR	16.744.891,08			% 100,000	16.744.891,08	7,11
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	5.024.496,27			% 100,000	5.024.496,27	2,14
	Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	2.011.071,43			% 100,000	182.188,67	0,08
	Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	1.486.950,44			% 100,000	941.230,00	0,40
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	1.110.637,37			% 100,000	769.955,26	0,33
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	264.205,62			% 100,000	265.554,64	0,11
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	919.197,08			% 100,000	1.046.158,93	0,44
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	136.332.124,00			% 100,000	939.282,26	0,40
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	6.431.740,64			% 100,000	6.057.964,25	2,58
	Summe Bankguthaben						EUR	42.875.620,03	18,23
	Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR	42.875.620,03	18,23
	Sonstige Vermögensgegenstände								
	Zinsansprüche		EUR	250.982,36				250.982,36	0,11
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	4.040.026,37				4.040.026,37	1,72
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	1.031,26				1.031,26	0,00
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	13.273,25				13.273,25	0,01
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	730.000,00				730.000,00	0,31
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	5.035.313,24	2,15
	Sonstige Verbindlichkeiten								
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-340,32				-340,32	0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-176.333,79				-176.333,79	-0,07
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-348.270,00				-348.270,00	-0,15
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-227.907,41				-227.907,41	-0,10
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-752.851,52	-0,32
	Fondsvermögen						EUR	235.160.804,05	100,00
	Umlaufende Anteile Klasse CF						STK	776.171,000	
	Umlaufende Anteile Klasse TF						STK	1.586.159,000	
	Anteilwert Klasse CF						EUR	100,98	
	Anteilwert Klasse TF						EUR	98,85	

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

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

Gattungsbezeichnung

Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)

Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
0,0100 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 22/24	EUR 10.000.000		9.717.100,00	
3,4430 % NRW.BANK FLR IHS Ausg. 17Z 17/23	EUR 6.000.000		6.022.950,00	
0,0000 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. MTN 20/30	EUR 2.600.000		2.075.385,00	
2,7500 % U.S. Treasury Notes 14/24	USD 200.000		184.197,51	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		17.999.632,51	17.999.632,51

Deka-Global Balance

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.02.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87864 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,03840 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,99492 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06170 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,44247 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	145,14500 = 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,57980 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XIOM	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Option Market (IOM)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
IFUS	New York/N.Y. - ICE Futures U.S.
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

OTC Over-the-Counter

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1690676439	0,3820 % Dexia Crédit Local S.A. FLR MTN 17/22	EUR	0	8.000.000
EU000A1G0EH3	0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 20/23	EUR	0	10.000.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000DZ1JQK9	0,0000 % DZ BANK AG Dt.Zen-Gen. FLR MTN IHS C31 DZ Br 12/22	EUR	0	5.000.000
DE000A1ROV63	1,7500 % Land Mecklenburg-Vorpommern Landessch.Ausg.1 13/23	EUR	9.000.000	9.000.000
DE000RLP1213	1,3180 % Land Rheinland-Pfalz FLR Landessch. 20/22	EUR	0	5.000.000
DE000A2E4D34	0,0000 % Land Sachsen-Anhalt MTN Landessch. 21/23	EUR	0	3.000.000
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
DE0002635307	iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE) EUR (Dist)	ANT	0	80.000
LU0419741177	Lyxor BBG Commo. ex Agric. ETF Inh.-An.I	ANT	77.240	77.240
USD				
LU1079841513	OSS.Shill.Bar.C.US Sec.Val.TR Inh.-Ant. UCITS ETF	ANT	0	100
IE00BSPLC520	SPDR MSCI USA Value UCITS ETF Reg.Shares	ANT	0	100

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
	EUR	529.226
(Basiswert(e): Amsterdam EXchanges (AEX) Index, FTSE 100 Index, FTSE MIB Index, MSCI Emerging Markets Index, MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, Nikkei 225 Stock Average Index (JPY), Russell 2000 Index, S&P 500 Financial Select Sec. Index (Price), S&P 500 Index, S&P Consumer St. Select Sector Index (Total Ret.), S&P Energy Select Sector Index, S&P Health Care Select Sector Index (Total Return), S&P Industrial Select Sector Index (Total Return), S&P Materials Select Sector Index (Price), S&P Utilities Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 600 Index (Price) (CAD), STXE 600 Banks Index (Price) (EUR), STXE 600 Basic Resources Index (Price) (EUR), STXE 600 Chemicals Index (Price) (EUR), STXE 600 Health Care Index (Price) (EUR), STXE 600 Index (Price) (EUR), STXE 600 Insurance Index (Price) (EUR), STXE 600 Oil & Gas Index (Price) (EUR), STXE 600 Pers. & Househ.Goods Index (Price) (EUR), STXE 600 Retail Index (Price) (EUR), STXE 600 Technology Index (Price) (EUR), STXE 600 Travel & Leisure Index (Price) (EUR), STXE600 Real Estate Index (Price) (EUR), Swiss Market Index (Price) (CHF))		
Verkaufte Kontrakte:		
	EUR	24.853
(Basiswert(e): MSCI World Index (Net Return) (USD))		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
	EUR	58.133
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))		
Verkaufte Kontrakte:		
	EUR	172.011
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))		
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):		
	EUR	134.364
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index)		

Deka-Global Balance

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. EUR	Volumen in 1.000
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))		34.790
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): S&P 500 Index)	EUR	113.308
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): VSTOXX Index Future (V2TX))	EUR	376
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): Ten-Year US Treasury Note Future (TY))	EUR	25.745
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	94.631
Sonstige Optionsrechte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): CBOE Volatility Index (VIX))	EUR	15.351
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin: USD/EUR	EUR	61.412
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin: JPY/EUR	EUR	128
USD/EUR	EUR	62.229
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	27.123
<small>(Basiswert(e): 0,0000 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. MTN 20/30, 0,0100 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 22/24, 2,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 13/23, 2,7500 % U.S. Treasury Notes 14/24, 3,3980 % Bayerische Landesbank FLR IHS 19/23)</small>		

Deka-Global Balance

Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF	STK	776.171
Umlaufende Anteile Klasse TF	STK	1.586.159
Anteilwert Klasse CF	EUR	100,98
Anteilwert Klasse TF	EUR	98,85

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

Investmentanteile

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

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	17.999.632,51	7,65

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	17.999.632,51	Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	17.999.632,51

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

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

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen
CHF
EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR
unbefristet	21.979.604,90

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	8.909,70	100,00
Kostenanteil des Fonds	2.940,21	33,00
Ertragsanteil der KVG	2.940,21	33,00

Deka-Global Balance

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

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihe Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

9,62% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Partners Group Holding AG	7.812.218,87
Diageo Finance PLC	4.349.332,39
Bayerische Landesbank	1.998.580,00
UniCredit Bank AG	1.952.990,68
Vonovia SE	1.766.858,22
Münchener Hypothekenbank eG	1.013.540,22
DZ HYP AG	981.960,81
Development Bank of Japan	940.087,26
Kreditanstalt für Wiederaufbau	574.974,00
Eika BoligKredit A.S.	310.964,17

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

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

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer	2
J.P. Morgan AG	13.690.700,97 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking	8.288.903,93 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

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

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps	
gesonderte Konten/Depots	0,00%
Sammelkonten/Depots	0,00%
andere Konten/Depots	0,00%
Verwahrart bestimmt Empfänger	0,00%

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

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

Frankfurt am Main, den 1. März 2023
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2021

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH, Köln
und der Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 28. Februar 2023

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



Deka Investment GmbH

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

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

