

Halbjahresbericht
zum 28. Februar 2023.
DekaTresor

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 DekaTresor 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 Versorgungsengpässen 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
Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023	6
Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023	8
Anhang	30
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	32

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

DekaTresor

Anlagepolitik.

Anlageziel dieses Fonds ist es, kurz- bis mittelfristig Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch die positive Entwicklung der Kurse der im Fonds gehaltenen Vermögensgegenstände zu erzielen.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds hauptsächlich in verzinsliche Wertpapiere mit kurz- bis mittelfristiger Laufzeit an. Dabei bilden Anleihen öffentlicher Emittenten, Quasi-Staatsanleihen, besicherte, verzinsliche Wertpapiere (z.B. Pfandbriefe) und Unternehmensanleihen jeweils aus der Eurozone den Anlage-schwerpunkt. Die Investitionen erfolgen weitestgehend in auf Euro lautende Wertpapiere oder in gegenüber Euro abgesicherte Wertpapiere fremder Währung.

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 Prozent des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland investieren.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental orientierte Investmentansatz kombiniert gezielt „Top-Down“ sowie „Bottom-Up“-Elemente. Die Basis stellt die Analyse makroökonomischer sowie (geo)politischer Parameter dar, ergänzt durch qualitative sowie quantitative fundamentale Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände, z.B. Bonitätsanalyse der Emittenten, relativer Vergleich der Wertpapiere mit anderen korrespondierenden Ausstellern. Um den Erfolg des Wertpapierauswahlprozesses zu bewerten wird der Index 100% ICE BofA® Euro Large Cap Investment Grade 1-4 Jahre in EUR¹⁾ verwendet. Die initiale und kontinuierliche Wertpapierauswahl erfolgt im Rahmen des beschriebenen Investmentansatzes unabhängig von diesem Referenzwert und damit verbundenen quantitativen oder qualitativen Einschränkungen.

Wichtige Kennzahlen

DekaTresor

Performance*	6 Monate
	-0,3%
ISIN	DE0008474750
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

1) Referenzindex: 100% ICE BofA® Euro Large Cap Investment Grade 1-4 Jahre in EUR. Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Indexmarke stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

DekaTresor

Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	774.404.870,07	97,75
Andorra	447.150,00	0,06
Australien	4.795.330,38	0,61
Belgien	7.214.802,63	0,92
Bulgarien	5.861.635,50	0,73
Chile	1.682.415,00	0,21
Curaçao	313.337,55	0,04
Dänemark	13.684.991,31	1,73
Deutschland	127.172.026,33	16,10
Estland	2.265.613,50	0,28
Finnland	12.333.796,38	1,54
Frankreich	40.211.442,42	5,08
Griechenland	2.434.512,50	0,30
Großbritannien	24.319.012,33	3,10
Indonesien	1.449.637,50	0,18
Irland	16.090.515,91	2,02
Island	3.416.755,75	0,44
Israel	1.994.500,00	0,25
Italien	103.018.439,43	12,97
Japan	12.915.972,00	1,63
Kanada	15.898.139,40	2,01
Kolumbien	1.900.000,00	0,24
Korea, Republik	12.452.689,88	1,58
Kroatien	2.968.950,00	0,37
Lettland	2.714.097,50	0,34
Luxemburg	17.487.984,46	2,21
Marokko	1.296.690,00	0,16
Mazedonien	3.865.860,00	0,49
Mexiko	3.915.557,50	0,50
Neuseeland	1.156.704,00	0,14
Niederlande	61.463.811,95	7,73
Norwegen	5.950.691,50	0,74
Österreich	19.348.650,50	2,43
Philippinen	2.291.998,50	0,29
Polen	8.896.629,11	1,12
Portugal	32.976.509,00	4,17
Rumänien	16.163.301,33	2,04
Russische Föderation	281.988,00	0,04
San Marino	2.466.475,00	0,31
Schweden	4.400.605,00	0,56
Schweiz	13.050.743,59	1,66
Singapur	1.927.136,25	0,24
Slowakei	3.546.492,00	0,45
Slowenien	888.960,00	0,11
Sonstige	15.042.516,25	1,90
Spanien	74.008.346,78	9,34
Tschechische Republik	22.349.681,02	2,83
Ungarn	7.955.852,50	1,01
USA	28.914.479,13	3,64
Zypern	7.201.443,50	0,91
2. Investmentanteile	2.971.856,00	0,38
Deutschland	2.768.250,00	0,35
Luxemburg	203.606,00	0,03
3. Schuldscheindarlehen	4.863.450,00	0,61
Deutschland	710.850,00	0,09
Spanien	4.152.600,00	0,52
4. Derivate	3.269.136,86	0,40
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	33.353.908,79	4,21
6. Sonstige Vermögensgegenstände	43.709.386,49	5,51
II. Verbindlichkeiten	-70.209.579,01	-8,86
III. Fondsvermögen	792.363.029,20	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	774.404.870,07	97,75
CHF	3.271.695,20	0,42
CZK	6.349.571,41	0,80
DEM	1.075.643,08	0,14
DKK	2.855.527,29	0,37
EUR	737.541.029,13	93,09
GBP	4.154.045,46	0,53
ITL	2.656.760,73	0,34
JPY	1.371.042,75	0,17
NLG	854.568,89	0,11
PLN	1.193.550,61	0,15
RON	568.940,39	0,07

DekaTresor

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
SEK	1.266.793,65	0,16
SKK	1.294.562,84	0,16
USD	9.951.138,64	1,24
2. Investmentanteile	2.971.856,00	0,38
EUR	2.971.856,00	0,38
3. Schuldscheindarlehen	4.863.450,00	0,61
EUR	4.863.450,00	0,61
4. Derivate	3.269.136,86	0,40
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	33.353.908,79	4,21
6. Sonstige Vermögensgegenstände	43.709.386,49	5,51
II. Verbindlichkeiten	-70.209.579,01	-8,86
III. Fondsvermögen	792.363.029,20	100,00

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

DekaTresor

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								656.475.635,27	82,90
Verzinsliche Wertpapiere								656.475.635,27	82,90
EUR								625.268.563,49	78,95
XS2491189408	2,5000 % A2A S.p.A. MTN 22/26	EUR		1.225.000	0	0	% 95,659	1.171.816,63	0,15
DE000AAR0355	4,5000 % Aareal Bank AG MTN IHS S.317 22/25	EUR		1.600.000	0	0	% 100,945	1.615.120,00	0,20
ES0265936023	0,5000 % ABANCA Corporación Bancaria SA FLR MTN 21/27	EUR		100.000	0	1.400.000	% 85,075	85.075,00	0,01
ES0211845260	3,7500 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 13/23	EUR		900.000	0	0	% 100,168	901.512,00	0,11
XS2573331324	3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. Preferred MTN 23/26	EUR		900.000	900.000	0	% 99,376	894.384,00	0,11
XS0911388675	6,0000 % Achmea B.V. FLR MTN 13/43	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 100,250	1.002.500,00	0,13
XS2560411543	3,6250 % Achmea B.V. MTN 22/25	EUR		1.450.000	1.450.000	0	% 99,166	1.437.907,00	0,18
XS2189592616	1,3750 % ACS, Act.de Constr.y Serv. SA MTN 20/25	EUR		1.500.000	0	1.500.000	% 92,893	1.393.395,00	0,18
NL0000116150	2,5890 % AEGON N.V. FLR Nts 04/Und. ¹⁾	EUR		500.000	0	0	% 83,616	418.077,50	0,05
XS2491963638	3,6250 % AIB Group PLC FLR MTN 22/26	EUR		1.250.000	0	0	% 97,981	1.224.756,25	0,15
XS2003442436	1,2500 % AIB Group PLC MTN 19/24	EUR		200.000	0	0	% 96,745	193.490,00	0,02
FR001400F2Q0	7,2500 % Air France-KLM S.A. MTN 23/26	EUR		400.000	400.000	0	% 101,550	406.200,00	0,05
FR0014004AF5	3,8750 % Air France-KLM S.A. Obl. 21/26	EUR		800.000	800.000	0	% 92,250	738.000,00	0,09
XS2451372499	1,2500 % ALD S.A. MTN 22/26 Reg.S	EUR		1.200.000	0	600.000	% 91,587	1.099.038,00	0,14
XS1622624242	1,2500 % Allergan Funding SCS Notes 17/24	EUR		1.555.000	0	0	% 95,622	1.486.914,33	0,19
XS1992938347	3,8370 % Alpha Bank Romania S.A. FLR MT Hyp.-Pfe. 19/24	EUR		2.100.000	0	0	% 100,486	2.110.206,00	0,27
XS2063246198	1,3750 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 19/25	EUR		3.940.000	0	0	% 95,135	3.748.299,30	0,47
XS2502220929	4,3750 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 22/26	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 98,297	1.965.930,00	0,25
XS2583211201	4,6250 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 23/27 ¹⁾	EUR		1.600.000	1.600.000	0	% 98,818	1.581.088,00	0,20
XS2445667236	1,2500 % Andorra MTN 22/27	EUR		500.000	0	2.100.000	% 89,430	447.150,00	0,06
XS2459053943	0,8950 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. MT Mg.Cov.Bds 22/27	EUR		1.000.000	0	0	% 89,598	895.980,00	0,11
XS2082324018	1,7500 % ArcelorMittal S.A. MTN 19/25 ¹⁾	EUR		500.000	0	0	% 93,648	468.240,00	0,06
XS2364754098	0,3750 % Arion Bank hf. MTN 21/25	EUR		2.150.000	0	0	% 88,206	1.896.418,25	0,24
XS2023872174	0,6250 % Aroundtown SA MTN 19/25	EUR		500.000	500.000	0	% 84,632	423.157,50	0,05
FR0014005OL1	0,0000 % Arval Service Lease S.A. MTN 21/25	EUR		3.000.000	0	0	% 89,921	2.697.615,00	0,34
FR0014008FH1	0,8750 % Arval Service Lease S.A. MTN 22/25	EUR		500.000	0	0	% 93,943	469.715,00	0,06
FR001400BDD5	3,3750 % Arval Service Lease S.A. MTN 22/26	EUR		1.300.000	0	0	% 97,680	1.269.833,50	0,16
XS0452314536	5,1250 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 09/24	EUR		100.000	0	0	% 102,301	102.301,00	0,01
XS1062900912	4,1250 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 14/26	EUR		100.000	0	0	% 100,094	100.094,00	0,01
FR0010406090	3,9750 % Assist.Publ.-Hôpitaux de Paris MTN 06/36 ²⁾	EUR		1.000.000	0	0	% 49,121	491.206,34	0,06
XS1600704982	2,3750 % Athora Netherlands N.V. Notes 17/24	EUR		1.400.000	400.000	0	% 96,705	1.353.870,00	0,17
XS1558491855	1,6250 % Atlantia S.p.A. MTN 17/25	EUR		600.000	0	800.000	% 94,216	565.296,00	0,07
FR0013378452	1,7500 % Atos SE Obl. 18/25	EUR		600.000	0	0	% 90,500	543.000,00	0,07
FR0010807503	5,7500 % Autoroutes du Sud de la France MTN 09/24	EUR		500.000	0	0	% 102,193	510.962,50	0,06
XS0542534192	4,3750 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN 10/25	EUR		600.000	0	0	% 99,865	599.187,00	0,08
XS1316569638	1,8750 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN S.2 15/25	EUR		2.500.000	0	0	% 93,437	2.335.912,50	0,29
IT0005108490	1,6250 % Autostrade per L'Italia S.p.A. Obbl. 15/23	EUR		500.000	0	0	% 99,525	497.625,00	0,06
XS1134541306	3,9410 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und.	EUR		700.000	0	0	% 97,500	682.500,00	0,09
XS1203859928	1,2500 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 15/27	EUR		600.000	600.000	0	% 88,352	530.109,00	0,07
ES0413211A75	3,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Cédulas Hip. 23/27	EUR		2.100.000	2.100.000	0	% 98,043	2.058.903,00	0,26
XS2485259241	1,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/25	EUR		2.300.000	0	0	% 94,332	2.169.636,00	0,27
XS2016160777	2,5000 % Banco BPM S.p.A. Preferred MTN 19/24 ¹⁾	EUR		1.750.000	0	0	% 97,625	1.708.428,75	0,22
XS2072815066	1,7500 % Banco BPM S.p.A. Preferred MTN 19/25	EUR		500.000	0	0	% 95,007	475.035,00	0,06
XS2577572188	4,8750 % Banco BPM S.p.A. Preferred MTN 23/27	EUR		2.375.000	2.375.000	0	% 98,028	2.328.165,00	0,29
PTBPCPHOM0066	1,1250 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR MT Obl. 21/27	EUR		3.000.000	0	0	% 85,347	2.560.410,00	0,32

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
PTBCPEOM0069	1,7500 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR Pref. MTN 21/28		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 82,325	823.250,00	0,10
PTBCPBOM0062	8,5000 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR Pref. MTN 22/25		EUR	1.100.000	1.100.000	0	% 103,295	1.136.245,00	0,14
XS1918887156	5,3750 % Banco de Sabadell S.A. FLR MTN 18/28 ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 100,313	601.875,00	0,08
XS2588884481	6,0000 % Banco de Sabadell S.A. FLR MTN 23/33		EUR	900.000	900.000	0	% 96,505	868.545,00	0,11
XS2528155893	5,3750 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 100,376	1.003.760,00	0,13
XS2228245838	1,1250 % Banco de Sabadell S.A. FLR Preferred MTN 20/27		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 90,572	905.720,00	0,11
XS1876076040	1,6250 % Banco de Sabadell S.A. MTN 18/24 ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 97,857	587.139,00	0,07
XS1991397545	1,7500 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/24		EUR	2.000.000	0	0	% 97,023	1.940.460,00	0,24
XS2055190172	1,1250 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/25		EUR	500.000	500.000	0	% 92,724	463.620,00	0,06
XS2028816028	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. Preferred MTN 19/25		EUR	1.600.000	0	1.900.000	% 92,896	1.486.336,00	0,19
ES0413900905	3,3750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 23/26		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 98,997	2.969.895,00	0,37
ES0213900220	1,0000 % Banco Santander S.A. FLR Notes 17/Und.		EUR	1.500.000	0	0	% 89,188	1.337.812,50	0,17
XS2436160779	0,1000 % Banco Santander S.A. FLR Preferred MTN 22/25		EUR	2.500.000	0	0	% 96,469	2.411.725,00	0,30
XS2538366878	3,6250 % Banco Santander S.A. FLR Preferred MTN 22/26		EUR	2.900.000	2.900.000	0	% 98,423	2.854.267,00	0,36
XS1751004232	1,1250 % Banco Santander S.A. Non-Pref. MTN 18/25		EUR	100.000	0	0	% 94,883	94.883,00	0,01
XS2575952424	3,7500 % Banco Santander S.A. Preferred MTN 23/26		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 98,942	1.978.830,00	0,25
XS1829259008	1,3750 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 18/25		EUR	1.000.000	0	0	% 93,267	932.665,00	0,12
XS2465984289	1,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 22/26		EUR	1.075.000	0	0	% 94,133	1.011.924,38	0,13
XS2023633931	0,7500 % Bank of Ireland Group PLC FLR Preferred MTN 19/24		EUR	625.000	0	0	% 98,985	618.653,13	0,08
XS2465609191	1,0000 % Bank of Montreal MT Mortg.Cov. Bds 22/26		EUR	3.000.000	0	0	% 92,031	2.760.930,00	0,35
XS0241192896	2,6196 % Bank of Scotland PLC FLR MTN 06/26		EUR	900.000	0	0	% 95,299	857.691,00	0,11
ES0413679525	3,0500 % Bankinter S.A. Cédulas Hipotec. 22/28		EUR	500.000	2.000.000	1.500.000	% 96,911	484.555,00	0,06
ES0213679HN2	0,8750 % Bankinter S.A. Non-Pref. Obl. 19/26		EUR	600.000	0	0	% 89,486	536.916,00	0,07
XS2082324364	0,7500 % Barclays PLC FLR MTN 19/25		EUR	925.000	0	0	% 95,586	884.170,50	0,11
XS2456247605	0,7500 % BASF SE MTN 22/26		EUR	1.200.000	0	0	% 92,507	1.110.078,00	0,14
XS2281342878	0,0500 % Bayer AG Anl. 21/25		EUR	4.100.000	0	0	% 93,059	3.815.398,50	0,48
XS2002496409	3,1250 % BayWa AG Notes 19/24		EUR	2.375.000	0	0	% 99,694	2.367.732,50	0,30
XS2383811424	1,7500 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 21/28		EUR	500.000	0	0	% 80,918	404.590,00	0,05
XS2535283548	8,0000 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 22/26		EUR	1.000.000	1.300.000	300.000	% 102,450	1.024.500,00	0,13
IT0005386922	0,8750 % Bca Monte dei Paschi di Siena Mortg.Cov. MTN 19/26		EUR	750.000	750.000	0	% 88,242	661.815,00	0,08
XS1975757789	2,3750 % Bca Pop. di Sondrio S.c.p.A. Preferred MTN 19/24		EUR	500.000	0	0	% 97,943	489.715,00	0,06
XS2375836553	0,0340 % Becton, Dickinson & Co. Notes 21/25		EUR	1.650.000	0	0	% 90,905	1.499.924,25	0,19
DE000A2YNQW7	4,5000 % Bilfinger SE Anl. 19/24		EUR	1.200.000	0	0	% 100,000	1.200.000,00	0,15
XS2190502323	1,8750 % BPER Banca S.p.A. Preferred MTN 20/25		EUR	500.000	0	0	% 94,079	470.392,50	0,06
XS1851268893	2,2000 % BPP Europe Holdings S.A.R.L. MTN 18/25		EUR	600.000	0	0	% 91,535	549.210,00	0,07
FR0014006XE5	0,0100 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Preferred MTN 21/25		EUR	1.900.000	0	0	% 92,348	1.754.612,00	0,22
XS1839682116	3,5000 % Bulgarian Energy Holding EAD Bonds 18/25		EUR	2.300.000	0	0	% 94,737	2.178.939,50	0,27
XS2367164576	2,4500 % Bulgarian Energy Holding EAD Bonds 21/28		EUR	400.000	400.000	0	% 82,540	330.160,00	0,04
XS1083844503	2,9500 % Bulgarien Bonds 14/24 ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 98,700	592.200,00	0,07
XS1208855889	2,6250 % Bulgarien MTN 15/27		EUR	2.900.000	500.000	600.000	% 95,184	2.760.336,00	0,35
XS0733094840	4,0500 % Bundesimmobiliengesellschaft MTN 12/27		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 101,757	1.526.347,50	0,19
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep. Deutschland Bundesobl. S.180 19/24 ¹⁾		EUR	4.000.000	1.000.000	0	% 95,091	3.803.640,00	0,48
XS2585964476	5,8850 % C.C.Bca-Cr.Coop.Italiano S.p.A FLR MTN 23/27		EUR	975.000	975.000	0	% 100,196	976.911,00	0,12

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS1025870574	3,5000 % Corporación Andina de Fomento MTN 14/39		EUR	500.000	0	0	% 88,336	441.680,00	0,06
XS1943474483	0,6250 % Corporación Andina de Fomento MTN 19/24		EUR	183.000	0	1.000.000	% 97,135	177.757,05	0,02
XS2182121827	1,6250 % Corporación Andina de Fomento MTN 20/25 ¹⁾		EUR	100.000	0	0	% 94,316	94.316,00	0,01
XS2296027217	0,2500 % Corporación Andina de Fomento MTN 21/26		EUR	850.000	350.000	0	% 88,790	754.715,00	0,10
XS2495583978	2,3750 % Corporación Andina de Fomento MTN 22/27		EUR	500.000	0	1.400.000	% 92,405	462.022,50	0,06
FR001400D0Y0	4,0000 % Crédit Agricole S.A. FLR Non-Prefer. 22/26		EUR	700.000	700.000	0	% 99,256	694.788,50	0,09
FR0014009857	1,0000 % Crédit Agricole S.A. MTN 22/25		EUR	500.000	0	0	% 93,596	467.980,00	0,06
XS2016807864	0,5000 % Crédit Agricole S.A. Non-Prefer. MTN 19/24		EUR	600.000	0	0	% 95,795	574.767,00	0,07
FR0013166477	2,8000 % Crédit Agricole S.A. OBL. 16/26		EUR	750.000	0	0	% 95,788	718.410,00	0,09
FR0012395689	3,0000 % Crédit Agricole S.A. Obligations 15/25		EUR	800.000	0	0	% 97,453	779.620,00	0,10
FR001400E7J5	3,3750 % Crédit Agricole S.A. Preferred MTN 22/27		EUR	1.000.000	1.600.000	600.000	% 97,701	977.005,00	0,12
FR001400FZ24	3,1250 % Crédit Mu. Home Loan SFH SA MT Obl.Fin.Hab. 23/27		EUR	2.300.000	2.300.000	0	% 98,439	2.264.097,00	0,29
CH1230759495	3,3900 % Credit Suisse (Schweiz) AG MT Hyp.-Pfe. 22/25		EUR	1.000.000	3.200.000	2.200.000	% 97,803	978.030,00	0,12
XS2176686546	0,4500 % Credit Suisse AG MTN 20/25		EUR	500.000	0	0	% 90,262	451.307,50	0,06
XS2589907653	5,5000 % Credit Suisse AG MTN 23/26		EUR	600.000	600.000	0	% 98,726	592.356,00	0,07
CH0591979635	3,2880 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 21/26		EUR	2.500.000	0	0	% 90,596	2.264.900,00	0,29
CH1174335732	2,1250 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 22/26		EUR	1.350.000	0	0	% 86,588	1.168.938,00	0,15
IT0004955271	4,1500 % Credito Emiliano S.p.A. Mortg.Cov. Bds 13/28		EUR	1.400.000	0	0	% 101,673	1.423.422,00	0,18
IT0005358491	1,1250 % Credito Emiliano S.p.A. Mortg.Cov. Bds 19/24		EUR	2.000.000	0	1.000.000	% 97,699	1.953.980,00	0,25
XS1117286580	4,3750 % Danica Pension Livsforsik. A/S FLR Notes 15/45		EUR	500.000	0	500.000	% 97,625	488.125,00	0,06
FR0013292828	1,7500 % Danone S.A. FLR MTN 17/Und.		EUR	500.000	0	0	% 99,360	496.800,00	0,06
FR0014003Q41	0,0000 % Danone S.A. MTN 21/25		EUR	500.000	0	1.400.000	% 90,954	454.770,00	0,06
XS2573569220	4,0000 % Danske Bank AS FLR Preferred MTN 23/27		EUR	1.950.000	1.950.000	0	% 99,397	1.938.241,50	0,24
XS2475502832	2,3750 % De Volksbank N.V. FLR Non-Prefer. MTN 22/27		EUR	1.600.000	0	400.000	% 93,345	1.493.520,00	0,19
XS2356091269	0,2500 % De Volksbank N.V. Non-Prefer. MTN 21/26		EUR	1.100.000	0	0	% 87,349	960.839,00	0,12
DE000DL19VR6	1,0000 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/25		EUR	1.400.000	0	0	% 94,340	1.320.753,00	0,17
DE000DL19VD6	1,3750 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/26		EUR	325.000	0	0	% 94,303	306.484,10	0,04
DE000DL19VP0	1,3750 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/26		EUR	500.000	0	0	% 91,815	459.072,50	0,06
DE000DB7XJP9	1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 15/25		EUR	800.000	0	0	% 94,667	757.336,00	0,10
ES0413320096	0,5000 % Deutsche Bank S.A.E. Cédulas Hipotec. 18/24		EUR	1.000.000	0	0	% 96,763	967.630,00	0,12
ES0413320104	0,8750 % Deutsche Bank S.A.E. Cédulas Hipotec. 19/25		EUR	1.400.000	0	0	% 94,674	1.325.436,00	0,17
XS2265369657	3,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN 20/26		EUR	400.000	400.000	0	% 93,625	374.500,00	0,05
XS2363244513	2,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN 21/24		EUR	2.300.000	0	1.200.000	% 97,000	2.231.000,00	0,28
XS2296201424	2,8750 % Deutsche Lufthansa AG MTN 21/25		EUR	3.000.000	0	1.000.000	% 96,313	2.889.375,00	0,36
DE000A3T0X22	0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35408 21/25		EUR	1.500.000	0	1.500.000	% 89,665	1.344.967,50	0,17
DE000A3T0X97	0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35413 22/25		EUR	2.100.000	0	0	% 92,431	1.941.040,50	0,24
DE000A30WFF84	5,0000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35424 23/27 ¹⁾		EUR	785.000	785.000	0	% 101,130	793.870,50	0,10
DE000A0DEN75	2,6670 % Deutsche Postbank Fdg Trust I FLR T.P.Sec. 04/Und.		EUR	1.000.000	0	0	% 73,000	730.000,00	0,09
XS0218189925	0,0000 % Dexia Crédit Local S.A. FLR MTN 05/25		EUR	1.200.000	0	0	% 90,046	1.080.552,00	0,14
XS2588099478	3,6250 % DNB Bank ASA FLR Non-Prefer. MTN 23/27 ¹⁾		EUR	725.000	725.000	0	% 98,455	713.795,13	0,09
DE000A3T0YH5	1,0000 % Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15317 22/26		EUR	500.000	0	600.000	% 92,537	462.685,00	0,06
DE000DG4T416	3,2340 % DZ BANK AG Dt.Zen-Gen. NRI FLR MTN Ausg.548 15/25		EUR	600.000	0	0	% 98,800	592.800,00	0,07

DekaTresor

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2557526006	3,2000 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 22/26		EUR	1.050.000	1.050.000	0	% 98,398	1.033.179,00	0,13
XS1974787480	1,7500 % TotalEnergies SE FLR MTN 19/Und.		EUR	800.000	0	0	% 96,000	768.000,00	0,10
XS2430285077	0,0640 % Toyota Finance Australia Ltd. MTN 22/25		EUR	1.250.000	0	0	% 93,278	1.165.968,75	0,15
XS2400997131	0,0000 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV MTN 21/25		EUR	3.275.000	0	0	% 90,668	2.969.377,00	0,37
XS2572989650	3,3750 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV MTN 23/26		EUR	2.650.000	2.650.000	0	% 98,878	2.620.267,00	0,33
DE000A3K5G19	3,5320 % TRATON Finance Luxembourg S.A. FLR MTN 22/24		EUR	1.500.000	0	0	% 99,793	1.496.887,50	0,19
DE000A3KYMA6	0,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. MTN 21/24		EUR	1.400.000	0	0	% 93,507	1.309.098,00	0,17
DE000A3LBGG1	4,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. MTN 22/25		EUR	900.000	900.000	0	% 99,355	894.195,00	0,11
DE000A3LC4C3	4,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. MTN 23/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 99,250	992.500,00	0,13
CZ0001006480	0,0000 % Tschechien Bonds S.146 22/24		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 96,045	960.450,00	0,12
CH1194000340	2,7500 % UBS Group AG FLR MTN 22/27		EUR	500.000	0	0	% 95,193	475.962,50	0,06
XS1887498282	1,2500 % Ungarn Bonds 18/25		EUR	1.500.000	0	600.000	% 92,625	1.389.367,50	0,18
XS2558594391	5,0000 % Ungarn Bonds 22/27		EUR	600.000	1.150.000	550.000	% 100,230	601.380,00	0,08
FR0013506813	2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 20/25		EUR	1.000.000	0	0	% 96,094	960.940,00	0,12
ES0380907057	4,5000 % Unicaja Banco S.A. FLR Preferred MTN 22/25		EUR	600.000	0	0	% 99,636	597.816,00	0,08
XS2541314584	3,1250 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as Mrtg Cov.Bds 22/27 ¹⁾		EUR	500.000	2.500.000	2.000.000	% 96,472	482.360,00	0,06
XS2104967695	1,2000 % UniCredit S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 20/26		EUR	1.250.000	0	0	% 93,773	1.172.162,50	0,15
XS2063547041	0,5000 % UniCredit S.p.A. Preferred MTN 19/25		EUR	500.000	0	0	% 92,895	464.475,00	0,06
XS2450200824	0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 22/26 ¹⁾		EUR	1.150.000	0	0	% 92,198	1.060.271,25	0,13
XS1206977495	3,0000 % Unipol Gruppo S.p.A. MTN 15/25 Reg.S ¹⁾		EUR	500.000	0	0	% 97,726	488.627,50	0,06
XS1078235733	5,7500 % UnipolSai Assicurazioni S.p.A. FLR MTN 14/Und.		EUR	100.000	0	0	% 98,895	98.895,00	0,01
XS0808635436	6,8750 % UNIQA Insurance Group AG FLR Bonds 13/43		EUR	100.000	0	0	% 101,240	101.240,00	0,01
XS1145750037	2,3750 % Urenco Finance N.V. MTN 14/24 ¹⁾		EUR	600.000	600.000	0	% 96,999	581.994,00	0,07
XS2126084750	2,8750 % Virgin Money UK PLC FLR MTN 20/25		EUR	1.000.000	0	0	% 97,068	970.675,00	0,12
XS2479941499	1,5000 % VISA Inc. Notes 22/26		EUR	1.175.000	0	0	% 93,304	1.096.316,13	0,14
XS1888179477	3,1000 % Vodafone Group PLC FLR Cap. Sec. 18/79		EUR	1.200.000	0	0	% 98,855	1.186.260,00	0,15
AT000B122080	0,8750 % Volksbank Wien AG Non-Preferred MTN 21/26		EUR	1.800.000	0	0	% 89,147	1.604.637,00	0,20
XS2152062209	3,0000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 20/25 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 98,403	984.030,00	0,12
XS2374595127	0,0000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 21/25		EUR	1.000.000	0	1.500.000	% 92,741	927.405,00	0,12
XS1830986326	1,2500 % Volkswagen Bank GmbH MTN 18/24		EUR	1.000.000	0	0	% 96,455	964.545,00	0,12
XS0175737997	5,4000 % Volkswagen Bank GmbH Sub. MTN 03/23		EUR	1.000.000	0	0	% 100,691	1.006.910,00	0,13
XS2554487905	4,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. MTN 22/25		EUR	500.000	1.500.000	1.000.000	% 99,997	499.982,50	0,06
XS2343821794	0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 21/24		EUR	1.000.000	0	625.000	% 94,661	946.605,00	0,12
XS2282094494	0,2500 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 21/26		EUR	500.000	500.000	0	% 89,419	447.095,00	0,06
DE000A2RWZZ6	1,8000 % Vonovia Finance B.V. MTN 19/25		EUR	500.000	0	0	% 94,804	474.017,50	0,06
DE000A3MP4T1	0,0000 % Vonovia SE MTN 21/25		EUR	2.500.000	0	1.000.000	% 88,973	2.224.325,00	0,28
DE000A3MQS56	1,3750 % Vonovia SE MTN 22/26		EUR	600.000	0	700.000	% 92,312	553.872,00	0,07
XS2392462730	0,5000 % Werfenlife S.A. Notes 21/26		EUR	400.000	0	0	% 86,906	347.622,00	0,04
XS2575952853	3,7030 % Westpac Banking Corp. MTN 23/26		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 98,992	1.979.830,00	0,25
XS2421006201	0,4270 % Westpac Securities NZ Ltd. MTN 21/26		EUR	300.000	0	0	% 86,908	260.724,00	0,03
AT000A2GLA0	2,7500 % Wienerberger AG Schuldv. 20/25		EUR	1.000.000	0	0	% 97,488	974.880,00	0,12
XS2288097483	1,3500 % Wizz Air Finance Company B.V. MTN 21/24 ¹⁾		EUR	1.600.000	0	0	% 96,125	1.538.000,00	0,19
XS2433361719	1,0000 % Wizz Air Finance Company B.V. MTN 22/26		EUR	1.000.000	450.000	0	% 86,107	861.070,00	0,11
XS2231715322	3,0000 % ZF Finance GmbH MTN 20/25		EUR	1.500.000	0	0	% 94,800	1.422.000,00	0,18
XS2582404724	5,7500 % ZF Finance GmbH MTN 23/26		EUR	600.000	600.000	0	% 100,992	605.952,00	0,08

DekaTresor

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CH1111393000	0,0000 % Zuercher Kantonalbank Anl. 21/26		EUR	5.250.000	0	0	% 88,977	4.671.292,50	0,59
CH1170565753	2,0200 % Zuercher Kantonalbank FLR Notes 22/28		EUR	575.000	0	0	% 90,907	522.712,38	0,07
DEM								1.075.643,08	0,14
DE0001345759	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero Bonds 96/26		DEM	2.500.000	0	0	% 84,151	1.075.643,08	0,14
CHF								3.271.695,20	0,42
CH1179184390	0,8750 % BKW AG Anl. 22/26		CHF	500.000	0	0	% 95,975	482.325,21	0,06
CH0505011962	0,4500 % Black Sea Trade & Developmt Bk Anl. 19/23		CHF	300.000	0	0	% 98,625	297.385,72	0,04
CH1104885954	0,9350 % Cellnex Telecom S.A. MTN 21/26		CHF	500.000	0	500.000	% 95,225	478.556,06	0,06
CH0220734930	3,2380 % DZ BANK AG Dt.Zen-Gen. Nachr. MTN IHS A.299 13/23		CHF	1.000.000	0	1.200.000	% 100,495	1.010.081,21	0,13
CH0224396983	1,2500 % Schweizerische Eidgenossensch. Anl. 14/26		CHF	1.000.000	800.000	0	% 99,825	1.003.347,00	0,13
CZK								6.349.571,41	0,80
XS2333787047	1,5000 % Intl Investment Bank -IIB- MTN 21/24		CZK	36.000.000	0	0	% 90,675	1.381.802,02	0,17
CZ0002005689	7,2500 % Moneta Money Bank A.S. FLR MT Cov. Bds 18/23		CZK	40.000.000	0	0	% 99,500	1.684.763,05	0,21
CZ0003529786	8,1600 % NET4GAS s.r.o. FLR Bonds 21/28		CZK	18.000.000	0	0	% 75,170	572.760,18	0,07
CZ0001005870	1,2500 % Tschechien Bonds 20/25		CZK	60.000.000	0	115.000.000	% 92,160	2.340.720,05	0,30
CZ0001004469	1,0000 % Tschechien Bonds S.95 15/26		CZK	10.000.000	0	30.000.000	% 87,295	369.526,11	0,05
DKK								2.855.527,29	0,37
DE0001345940	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero Notes 96/26		DKK	4.670.000	0	0	% 82,488	517.558,73	0,07
DK0009923138	1,7500 % Königreich Dänemark Anl. 14/25		DKK	18.000.000	0	0	% 96,675	2.337.968,56	0,30
GBP								4.154.045,46	0,53
XS2106542165	1,7500 % Commerzbank AG MTN Anl. S.947 20/25		GBP	1.000.000	0	0	% 92,374	1.051.323,64	0,13
DE000A30WF43	7,6250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35421 22/25		GBP	2.500.000	2.500.000	0	% 101,884	2.898.926,18	0,37
XS1311391012	3,5000 % Hammerson PLC Notes 15/25		GBP	200.000	0	0	% 89,532	203.795,64	0,03
ITL								2.343.423,18	0,30
XS0071094667	0,0000 % Commerzbank AG Zero LI-Anl. Tr.46 96/26		ITL	5.500.000.000	0	0	% 82,500	2.343.423,18	0,30
NLG								854.568,89	0,11
NL0000120004	1,5060 % AEGON N.V. Anl. 95/Und.		NLG	2.200.000	0	0	% 85,601	854.568,89	0,11
PLN								1.193.550,61	0,15
PL0000108866	2,5000 % Republik Polen Bonds S.0726 15/26		PLN	5.000.000	5.000.000	0	% 88,459	937.556,97	0,12
PL0000113460	0,2500 % Republik Polen Bonds S.P51026 20/26		PLN	1.500.000	0	4.000.000	% 80,510	255.993,64	0,03
RON								568.940,39	0,07
ROHRVN7NLNO2	4,8500 % Republik Rumänien Bonds 18/26		RON	3.000.000	3.000.000	0	% 93,319	568.940,39	0,07
SEK								1.266.793,65	0,16
SE0007125927	1,0000 % Königreich Schweden Loan Nr.1059 14/26		SEK	15.000.000	15.000.000	0	% 93,223	1.266.793,65	0,16
USD								7.273.312,62	0,90
XS2018639539	3,5000 % Black Sea Trade & Developmt Bk MTN 19/24		USD	1.100.000	500.000	0	% 92,543	958.814,17	0,12
US219868CG98	4,7500 % Corporación Andina de Fomento Notes 23/26		USD	1.800.000	1.800.000	0	% 98,469	1.669.429,22	0,21
LU0001344653	5,2500 % DNB Bank ASA FLR Notes 84/Und.		USD	280.000	0	0	% 71,000	187.246,87	0,02
XS1507486584	1,5000 % European Investment Bank MTN 16/26		USD	900.000	900.000	0	% 88,385	749.237,07	0,09
GB0005902332	5,4375 % HSBC Bank PLC FLR Notes 85/Und.		USD	800.000	0	0	% 78,500	591.504,19	0,07
XS1055787680	6,2500 % Norddte Ldsbk -GZ- Nachr. IHS S.1748 14/24		USD	2.400.000	2.400.000	0	% 98,125	2.218.140,72	0,28
XS1885506813	3,5000 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 18/25		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 95,441	898.940,38	0,11
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								107.655.937,18	13,56
Verzinsliche Wertpapiere								107.655.937,18	13,56
EUR								106.897.155,64	13,46
XS2575555938	3,2500 % ABB Finance B.V. MTN 23/27		EUR	650.000	650.000	0	% 98,602	640.913,00	0,08
XS1953929608	2,8000 % Acquirente Unico S.p.A. Notes 19/26		EUR	2.400.000	400.000	0	% 95,550	2.293.200,00	0,29
XS2555178644	3,0000 % adidas AG Anl. 22/25		EUR	1.000.000	1.900.000	900.000	% 97,819	978.190,00	0,12
XS2454766473	0,7500 % American Medical Syst.Eu. B.V. Notes 22/25		EUR	1.600.000	0	0	% 93,867	1.501.864,00	0,19
XS2594025814	4,8750 % Arcadis N.V. Notes 23/28 ¹⁾		EUR	1.250.000	1.250.000	0	% 99,230	1.240.368,75	0,16

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS0207617688	2,4300 % ASIF III (Jersey) Ltd. FLR MTN 04/24		EUR	3.000.000	0	0	% 99,750	2.992.500,00	0,38
XS2384413311	0,3660 % Athene Global Funding Notes 21/26		EUR	500.000	0	0	% 85,208	426.037,50	0,05
XS2080317832	0,8750 % Ball Corp. Notes 19/24		EUR	900.000	0	0	% 96,750	870.750,00	0,11
ES0413860836	3,5000 % Banco de Sabadell S.A. Cédulas Hipotec. 23/26		EUR	1.400.000	1.400.000	0	% 99,345	1.390.830,00	0,18
XS2093880735	1,0000 % Berry Global Inc. Notes 20/25 Reg.S		EUR	1.100.000	0	0	% 94,125	1.035.375,00	0,13
FR0013299641	1,0000 % BNP Paribas Cardif S.A. Notes 17/24		EUR	1.500.000	0	0	% 94,627	1.419.405,00	0,18
BE0933899800	4,0620 % BNP Paribas Fortis S.A. FLR Conv. Nts 07/Und.		EUR	750.000	750.000	0	% 80,772	605.786,25	0,08
XS2308321962	0,1000 % Booking Holdings Inc. Notes 21/25		EUR	500.000	0	0	% 92,731	463.655,00	0,06
XS2555218291	4,0000 % Booking Holdings Inc. Notes 22/26		EUR	1.000.000	2.525.000	1.525.000	% 100,705	1.007.045,00	0,13
ES0415306101	3,0000 % Caja Rural de Navarra S.C.d.C. Cédulas Hip. 23/27		EUR	3.000.000	3.500.000	500.000	% 97,337	2.920.095,00	0,37
ES0422714172	3,3750 % Cajamar Caja Rural, S.C.Créd. Cédulas Hipot. 23/28		EUR	2.200.000	2.200.000	0	% 97,979	2.155.527,00	0,27
XS2468979302	3,1250 % CETIN Group N.V. MTN 22/27		EUR	1.500.000	0	0	% 93,193	1.397.887,50	0,18
XS2358343833	0,0000 % China Constr. Bank (Europe) SA MTN 21/24		EUR	1.000.000	0	0	% 94,534	945.340,00	0,12
XS1392459381	1,5000 % Credit Suisse AG MTN 16/26		EUR	500.000	500.000	0	% 87,915	439.572,50	0,06
XS2068978050	1,5000 % Credito Emiliano S.p.A. FLR Non-Pref. 19/25		EUR	900.000	0	0	% 94,467	850.198,50	0,11
XS2412556461	1,1250 % Credito Emiliano S.p.A. FLR Notes 22/28 Reg.S		EUR	1.625.000	0	0	% 88,056	1.430.910,00	0,18
XS2264194205	0,6250 % CTP N.V. MTN 20/23		EUR	1.000.000	0	0	% 97,253	972.530,00	0,12
XS2356029541	0,5000 % CTP N.V. MTN 21/25		EUR	1.275.000	0	0	% 89,548	1.141.737,00	0,14
XS2466172280	1,2500 % Daimler Truck Intl Finance MTN 22/25		EUR	900.000	0	0	% 94,683	852.142,50	0,11
XS2400445289	0,5000 % Dell Bank International DAC MTN 21/26 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 87,618	438.087,50	0,06
XS2193734733	1,6250 % Dell Bank International DAC Notes 20/24		EUR	1.700.000	0	800.000	% 96,422	1.639.165,50	0,21
DE000DL8Y3N6	0,2000 % Deutsche Bank AG Festzinsanl. 20/26		EUR	1.000.000	0	0	% 87,416	874.160,00	0,11
XS0461374182	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero Coupon Nts 16/26		EUR	795.000	0	0	% 87,270	693.796,50	0,09
XS2247614063	2,6250 % Drax Finco PLC Notes 20/25 Reg.S		EUR	500.000	0	675.000	% 95,495	477.475,00	0,06
XS2526860965	2,6140 % East Japan Railway Co. MTN 22/25		EUR	1.900.000	1.900.000	0	% 97,259	1.847.921,00	0,23
XS2354685575	0,3610 % EEW Energy from Waste GmbH Anl. 21/26		EUR	1.000.000	0	0	% 87,040	870.400,00	0,11
XS0905658349	2,7500 % Erdöl-Lagergesellschaft m.b.H. Bonds 13/28		EUR	3.000.000	1.800.000	0	% 95,938	2.878.125,00	0,36
XS2488092219	4,3750 % Eurobank S.A. FLR Preferred MTN 22/25 ¹⁾		EUR	600.000	0	400.000	% 98,405	590.430,00	0,07
XS1959338630	0,2500 % Export Development Canada MTN 19/26		EUR	800.000	0	0	% 90,887	727.096,00	0,09
XS2081491727	0,8150 % FCC Serv.Medio Ambiente Hld.SA Notes 19/23		EUR	2.175.000	0	0	% 97,828	2.127.748,13	0,27
XS2586123965	4,8670 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 23/27		EUR	1.700.000	1.700.000	0	% 97,938	1.664.937,50	0,21
XS2088659789	0,1250 % Gas Networks Ireland MTN 19/24		EUR	1.500.000	0	0	% 93,225	1.398.367,50	0,18
DE000A3E5QW6	0,1250 % GEWO BAG Wohnungsbau-AG Berlin MTN 21/27		EUR	300.000	0	0	% 84,184	252.552,00	0,03
DE000A30VGD9	2,6250 % Heraeus Finance GmbH Anl. 22/27		EUR	3.000.000	0	2.000.000	% 92,358	2.770.725,00	0,35
XS2406914346	0,3180 % Highland Holdings S.A.r.L. Notes 21/26		EUR	2.725.000	0	0	% 86,454	2.355.871,50	0,30
XS2385389551	0,1250 % Hldg d'Infra.Métiers Environ. Notes 21/25		EUR	1.825.000	0	0	% 89,698	1.636.979,38	0,21
XS2586947082	3,0500 % Instituto de Credito Oficial MTN 23/27		EUR	600.000	600.000	0	% 98,211	589.266,00	0,07
IT0005363772	3,5200 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Obbl. 19/24		EUR	1.000.000	0	0	% 101,101	1.011.010,00	0,13
IT0005363780	1,7000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Obbl. 19/24		EUR	2.100.000	0	0	% 96,976	2.036.496,00	0,26
XS2408491947	0,2440 % JDE Peet's N.V. MTN 21/25		EUR	1.250.000	500.000	0	% 92,766	1.159.568,75	0,15
XS2354444023	0,0000 % JDE Peet's N.V. MTN 21/26		EUR	3.000.000	0	0	% 88,442	2.653.245,00	0,33
XS1883352095	1,1250 % JT Intl. Finl. Services B.V MTN 18/25		EUR	1.500.000	1.000.000	0	% 92,351	1.385.265,00	0,17
DE000HLB2DM0	3,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ Nachr. Anl. 15/25		EUR	107.000	0	0	% 97,650	104.485,50	0,01

DekaTresor

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE000HLB1KN5	2,5000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ Nachr. IHS 14/24		EUR	350.000	0	0	% 97,149	340.019,75	0,04
XS2563348361	4,3750 % Leasys S.p.A. Notes 22/24		EUR	1.750.000	2.250.000	500.000	% 100,747	1.763.063,75	0,22
XS2391860843	0,0000 % Linde PLC MTN 21/26		EUR	2.000.000	0	0	% 88,131	1.762.620,00	0,22
IT0005212292	2,4340 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA FLR Obbl. 16/24		EUR	1.000.000	0	0	% 98,715	987.150,00	0,12
XS1974394675	1,6250 % Mexiko MTN 19/26		EUR	1.000.000	400.000	0	% 93,745	937.450,00	0,12
XS2530031546	3,2730 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. FLR MTN 22/25		EUR	1.425.000	1.425.000	0	% 98,313	1.400.960,25	0,18
XS2465984107	1,6310 % Mizuho Financial Group Inc. MTN 22/27		EUR	1.000.000	0	500.000	% 90,130	901.300,00	0,11
XS2390849318	0,9930 % MPT Operating Partnership L.P. Notes 21/26		EUR	575.000	0	0	% 74,500	428.375,00	0,05
XS2066703989	1,7500 % Nexi S.p.A. Nts 19/24 Reg.S		EUR	200.000	0	500.000	% 96,775	193.550,00	0,02
XS2332589972	1,6250 % Nexi S.p.A. Nts 21/26 Reg.S		EUR	500.000	0	500.000	% 89,500	447.500,00	0,06
XS2323295563	0,0460 % Nidec Corp. Bonds 21/26		EUR	1.000.000	0	0	% 88,828	888.280,00	0,11
XS2228683277	2,6520 % Nissan Motor Co. Ltd. Notes 20/26 Reg.S		EUR	400.000	0	0	% 93,788	375.150,00	0,05
DE000NLB2UT1	2,1410 % Norddte Ldsbk -GZ- FLR IHS 18/24		EUR	1.000.000	0	0	% 99,010	990.100,00	0,12
XS2583644146	4,4770 % ORIX Corp. MTN 23/28		EUR	500.000	500.000	0	% 100,737	503.685,00	0,06
XS2591026856	3,6250 % Orsted A/S MTN 23/26		EUR	1.925.000	1.925.000	0	% 99,738	1.919.956,50	0,24
XS1568874983	3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/24		EUR	1.100.000	0	1.000.000	% 97,928	1.077.202,50	0,14
XS1824425182	3,6250 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 18/25		EUR	1.000.000	500.000	0	% 91,857	918.565,00	0,12
XS2334361271	0,2500 % Philippinen Bonds 21/25		EUR	2.475.000	0	0	% 92,606	2.291.998,50	0,29
XS1435229460	3,6250 % PVH Corp. Notes 16/24 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 99,216	496.077,50	0,06
XS2579606927	4,7500 % Raiffeisen Bank Intl AG FLR MTN 23/27		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 98,200	1.178.400,00	0,15
XS1151586945	1,6250 % Republik Chile Bonds 14/25		EUR	1.750.000	750.000	0	% 96,138	1.682.415,00	0,21
XS1385239006	3,8750 % Republik Kolumbien Bonds 16/26		EUR	2.000.000	0	0	% 95,000	1.900.000,00	0,24
ROE3GCPAFCP6	1,0000 % Republik Rumänien Bonds 18/23		EUR	3.000.000	0	0	% 98,810	2.964.300,00	0,37
XS2239061927	3,2500 % Republik San Marino Obbl. 21/24		EUR	2.500.000	500.000	500.000	% 98,659	2.466.475,00	0,31
XS1731882186	1,6250 % Roadster Finance DAC MTN 17/29		EUR	825.000	0	500.000	% 90,959	750.411,75	0,09
XS1711584430	2,6250 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 17/25 ¹⁾		EUR	900.000	0	0	% 96,676	870.084,00	0,11
XS2202907510	3,3750 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 20/26		EUR	500.000	500.000	0	% 94,800	474.000,00	0,06
XS1562623584	2,6250 % Sigma Alimentos S.A. Notes 17/24 Reg.S		EUR	1.000.000	0	0	% 98,234	982.340,00	0,12
XS1117298759	2,7500 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. Notes 15/25 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 97,514	487.570,00	0,06
XS1849518276	2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. Notes 18/26 Reg.S		EUR	1.500.000	0	0	% 96,860	1.452.892,50	0,18
DE000A30V3G9	3,0000 % Sparkasse Hannover Hyp.-Pfe. R.9 22/26		EUR	500.000	2.500.000	2.000.000	% 97,922	489.607,50	0,06
DE000A30V5G4	3,0000 % Sparkasse Pforzheim Calw Hyp.-Pfe. S.P23 23/27		EUR	800.000	800.000	0	% 98,219	785.752,00	0,10
XS2547591474	3,6020 % Sumitomo Mitsui Banking Corp. Mortg.Cov. MTN 23/26		EUR	725.000	725.000	0	% 98,941	717.322,25	0,09
SK4000022505	5,9520 % Tatra Banka AS FLR MTN 23/26		EUR	700.000	700.000	0	% 99,480	696.356,50	0,09
XS2198213956	6,0000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 20/25		EUR	800.000	0	0	% 101,875	815.000,00	0,10
XS2587306403	3,8200 % The Sage Group PLC MTN 23/28		EUR	450.000	450.000	0	% 98,535	443.407,50	0,06
XS2592659242	4,1250 % V.F. Corp. Notes 23/26		EUR	1.275.000	1.275.000	0	% 99,824	1.272.749,63	0,16
DE000A3H3J14	0,0000 % Vantage Towers AG Kp.-Anl. 21/25		EUR	1.000.000	0	1.300.000	% 96,730	967.295,00	0,12
XS2314794491	0,5000 % Versito Int. Cmpt.2020-01 MTN 21/23 ²⁾		EUR	4.000.000	0	0	% 100,000	4.000.000,00	0,50
XS2378468420	2,1250 % Wuestenrot& Wuerttem. AG FLR Nachr. Anl. 21/41		EUR	1.000.000	0	500.000	% 72,274	722.740,00	0,09
ITL								313.337,55	0,04
XS0071948540	0,0000 % UBS Finance (Curaçao) N.V. Zero Bonds 97/27		ITL	715.000.000	0	0	% 84,854	313.337,55	0,04
USD								445.443,99	0,06
US40428NAC39	5,7024 % HSB Group Inc. FLR Debts S.B 97/27		USD	525.000	0	0	% 90,082	445.443,99	0,06
Neuemissionen								1.278.667,00	0,16
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen								1.278.667,00	0,16
Verzinsliche Wertpapiere								1.278.667,00	0,16
EUR								1.278.667,00	0,16
DE000HV2AZC4	3,0000 % UniCredit Bank AG Pfe. 23/26		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 98,359	1.278.667,00	0,16

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Nichtnotierte Wertpapiere								8.994.630,62	1,13
Verzinsliche Wertpapiere								8.994.630,62	1,13
EUR								4.096.643,00	0,52
PTADOBOM0006	2,4730 % ADP - Águas Portugal, SGPS,SA FLR Obr. 07/27		EUR	2.000.000	500.000	0	% 96,725	1.934.500,00	0,24
XS1132135747	2,8750 % Ceske Drahý AS Notes 14/24		EUR	1.200.000	0	0	% 96,827	1.161.918,00	0,15
BE6235350939	3,8500 % Communauté française Belgique MTN 12/24		EUR	1.000.000	0	0	% 100,023	1.000.225,00	0,13
JPY								1.371.042,75	0,17
XS1793332526	0,7640 % KKR Group Finance Co. IV LLC Notes 18/25 Reg.S		JPY	200.000.000	0	0	% 99,500	1.371.042,75	0,17
SKK								1.294.562,84	0,16
XS0163253924	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero MTN 03/23		SKK	39.000.000	0	0	% 100,000	1.294.562,84	0,16
USD								2.232.382,03	0,28
XS1788992870	6,0377 % Deutsche Bank AG FLR MTN 18/25		USD	2.400.000	0	0	% 98,755	2.232.382,03	0,28
Wertpapier-Investmentanteile								2.971.856,00	0,38
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								2.768.250,00	0,35
EUR								2.768.250,00	0,35
DE0008479981	Frankfurter-Sparrent Deka		ANT	25.000	15.000	0	EUR 48,840	1.221.000,00	0,15
DE0008474537	RenditDeka CF		ANT	75.000	0	0	EUR 20,630	1.547.250,00	0,20
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								203.606,00	0,03
EUR								203.606,00	0,03
LU0044138906	Deka-Renten: Euro 1-3 CF A		ANT	200	4.900	5.700	EUR 1.018,030	203.606,00	0,03
Summe Wertpapiervermögen								777.376.726,07	98,13
Schuldscheindarlehen								4.863.450,00	0,61
6,1300 % BHW Bausparkasse AG Nachr. SSD 03/23		OTC	EUR	700.000	0	0	% 101,550	710.850,00	0,09
5,6550 % Generalitat de Catalunya SSD 09/24		OTC	EUR	2.000.000	0	0	% 107,800	2.156.000,00	0,27
3,8660 % Generalitat de Catalunya SSD 21/25		OTC	EUR	2.000.000	0	0	% 99,830	1.996.600,00	0,25
Summe der Schuldscheindarlehen								4.863.450,00	0,61
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								1.033.467,76	0,13
EURO Bobl Future (FGBM) März 23		XEUR	EUR	-39.500.000				976.660,00	0,12
EURO Bund Future (FGBL) März 23		XEUR	EUR	-9.000.000				156.420,00	0,02
EURO Schatz Future (FGBS) März 23		XEUR	EUR	12.000.000				-27.650,00	0,00
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Juni 23		XCBT	USD	3.500.000				-7.211,31	0,00
SHORT EURO-BTP Future (FBTS) März 23		XEUR	EUR	7.500.000				-51.800,00	-0,01
Two-Year US Treasury Note Future (TU) Juni 23		XCBT	USD	8.000.000				-12.950,93	0,00
Summe Zins-Derivate								EUR 1.033.467,76	0,13
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)								-58.468,72	-0,01
Offene Positionen									
JPY/EUR 250.000.000,00			OTC					-58.468,72	-0,01
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								110.259,23	0,01
Offene Positionen									
CZK/EUR 100.000.000,00			OTC					-2.337,68	0,00
USD/EUR 20.000.000,00			OTC					112.596,91	0,01
Optionsrechte								80.634,55	0,01
Optionsrechte auf Devisen (Kauf)								80.634,55	0,01
CALL USD/HKD 7,82000 29.08.2023			OTC	34.900.000			% 0,245	80.634,55	0,01
Summe Devisen-Derivate								EUR 132.425,06	0,01
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsswaps								2.490.416,07	0,31
(Erhalten/Zahlen)									
IRS 0,6105% GBP/SONIA +0,2766% GBP / CITIGLMD_FRA 09.10.2029		OTC	GBP	13.000.000				-3.154.598,75	-0,40
IRS -0,059% EUR / EURIBORM06 EUR / DGZ_FRA 15.11.2026		OTC	EUR	20.000.000				-2.555.374,80	-0,32
IRS 1,583% EUR / EURIBORM06 EUR / CITIGLMD_FRA 11.07.2026		OTC	EUR	10.000.000				-542.091,40	-0,07
IRS 2,115% USD / LIBUSD03 USD / CITIGMX_LDN 25.11.2026		OTC	USD	4.000.000				-285.318,45	-0,04
IRS 2,727% EUR / EURIBORM06 EUR / DGZ_FRA 28.11.2025		OTC	EUR	10.000.000				-218.625,20	-0,03
IRS 2,848% EUR / EURIBORM06 EUR / JPMORGAN_FRA 20.12.2032		OTC	EUR	21.000.000				-625.649,01	-0,08

DekaTresor

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
IRS 3.15% EUR / EURIBORM06 EUR / DGZ_FRA 24.10.2026		OTC	EUR	6.000.000				-45.589,02	-0,01	
IRS ESTR +0,085% EUR/-0,3625% EUR / GOLDMANS_FRA 20.01.2024		OTC	EUR	50.000.000				1.882.046,50	0,24	
IRS EURIBORM03 EUR / 0.249% EUR / DGZ_FRA 18.10.2023		OTC	EUR	15.000.000				310.558,20	0,04	
IRS EURIBORM06 EUR / -0.2885% EUR / JPMORGAN_FRA 15.09.2026		OTC	EUR	5.000.000				664.659,70	0,08	
IRS EURIBORM06 EUR / 0.479% EUR / DBK_FRA 15.02.2025		OTC	EUR	15.100.000				936.458,06	0,12	
IRS EURIBORM06 EUR / 2.127% EUR / JPMORGAN_FRA 20.12.2052		OTC	EUR	8.800.000				1.034.347,42	0,13	
IRS LIBUSDM03 USD / 2.39% USD / CITIGMX_LDN 25.11.2046		OTC	USD	1.600.000				296.826,63	0,04	
IRS PRIBORM06 CZK / 1.24% CZK / JPMORGAN_FRA 10.02.2025		OTC	CZK	350.000.000				1.423.577,50	0,18	
IRS PRIBORM06 CZK / 2.0975% CZK / MOST_LDN 27.12.2023		OTC	CZK	150.000.000				317.979,49	0,04	
IRS SONIA +0,2766% GBP/0,6925% GBP / CITIGLMD_FRA 09.10.2049		OTC	GBP	5.000.000				3.051.209,20	0,39	
Credit Default Swaps (CDS)								-387.172,03	-0,05	
Protection Buyer								-374.137,47	-0,05	
CDS 300300CHN201808MOF68 / CITIGLMD_FRA 20.12.2026		OTC	USD	5.000.000				-74.379,35	-0,01	
CDS CDX.EM. S29 V4 5Y / MERRILL_LDN 20.06.2023		OTC	USD	3.000.000				-5.977,18	0,00	
CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S30 V8 5Y / MERRILL_LDN 20.12.2023		OTC	EUR	5.000.000				-147.083,64	-0,02	
CDS ITRAXX EUROPE S36 V1 5Y / CITIGLMD_FRA 20.12.2026		OTC	EUR	10.000.000				-146.697,30	-0,02	
Protection Seller								-13.034,56	0,00	
CDS 254900HROIFWPRGM1V77 / BNP_PAR 20.12.2023		OTC	EUR	-4.000.000				-13.034,56	0,00	
Summe Swaps							EUR	2.103.244,04	0,26	
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds										
Bankguthaben										
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle										
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	26.072.607,73			%	100,000	26.072.607,73	3,30
EUR-Guthaben bei										
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	483.600,33			%	100,000	483.600,33	0,06
Landesbank Berlin AG			EUR	24.032,64			%	100,000	24.032,64	0,00
Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-			EUR	29.674,20			%	100,000	29.674,20	0,00
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	371.077,89			%	100,000	49.855,96	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			HUF	10.163.920,19			%	100,000	26.790,16	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	20.862.845,95			%	100,000	1.902.927,97	0,24
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	5.902.511,01			%	100,000	534.725,23	0,07
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	52.676,88			%	100,000	33.344,12	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	468,41			%	100,000	324,73	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	39.866,55			%	100,000	45.373,02	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	602.431.483,00			%	100,000	4.150.549,33	0,52
DekaBank Deutsche Girozentrale			SGD	148,00			%	100,000	103,37	0,00
Summe Bankguthaben							EUR	33.353.908,79	4,21	
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	33.353.908,79	4,21	
Sonstige Vermögensgegenstände										
Zinsansprüche			EUR	6.267.981,33				6.267.981,33	0,79	
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	1.283.731,25				1.283.731,25	0,16	
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	5.598,84				5.598,84	0,00	
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	170.323,65				170.323,65	0,02	
Forderungen aus Wertpapiergeschäften			EUR	2.567.501,18				2.567.501,18	0,32	
Forderungen aus Devisenspots			EUR	30.435.312,74				30.435.312,74	3,85	
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	11.437,50				11.437,50	0,00	
Forderungen aus Ersatzleistung Zinsen/Dividenden			EUR	7.500,00				7.500,00	0,00	
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	2.960.000,00				2.960.000,00	0,37	
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	43.709.386,49	5,51	
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme										
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	-2.540.860,52			%	100,000	-2.553.834,00	-0,32
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	-22.040.869,60			%	100,000	-20.759.978,90	-2,62
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			CZK	-139.385.956,44			%	100,000	-5.900.309,29	-0,74
DekaBank Deutsche Girozentrale			PLN	-43.725,76			%	100,000	-9.268,84	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			RON	-2.610.692,20			%	100,000	-530.553,01	-0,07
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-29.753.944,04	-3,75	
Sonstige Verbindlichkeiten										

DekaTresor

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-1.847,68				-1.847,68	0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneidgeschäften		EUR	-236.574,24				-236.574,24	-0,03
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-4.143.231,52				-4.143.231,52	-0,52
	Verbindlichkeiten aus Devisenspots		EUR	-30.564.517,55				-30.564.517,55	-3,86
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-319.463,98				-319.463,98	-0,04
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-5.190.000,00				-5.190.000,00	-0,66
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-40.455.634,97	-5,11
	Fondsvermögen						EUR	792.363.029,20	100,00
	Umlaufende Anteile						STK	9.709.534,000	
	Anteilwert						EUR	81,61	

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

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

²⁾ Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um Poolfaktoranleihen, deren Kurswert auch durch Teilrückzahlung oder Teilzinskaptalisierung beeinflusst wird.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
2,5890 % AEGON N.V. FLR Nts 04/Und.	EUR	250.000	209.038,75	
4,6250 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 23/27	EUR	800.000	790.544,00	
4,8750 % Arcadis N.V. Notes 23/28	EUR	675.000	669.799,13	
1,7500 % ArcelorMittal S.A. MTN 19/25	EUR	500.000	468.240,00	
2,5000 % Banco BPM S.p.A. Preferred MTN 19/24	EUR	1.500.000	1.464.367,50	
5,3750 % Banco de Sabadell S.A. FLR MTN 18/28	EUR	600.000	601.875,00	
1,6250 % Banco de Sabadell S.A. MTN 18/24	EUR	500.000	489.282,50	
2,9500 % Bulgarien Bonds 14/24	EUR	600.000	592.200,00	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24	EUR	3.000.000	2.852.730,00	
1,2500 % Caixa Geral de Depósitos S.A. Non-Pref. MTN 19/24	EUR	700.000	666.792,00	
1,6250 % Caixabank S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26	EUR	500.000	469.590,00	
5,8750 % CDP RETI S.p.A. Obbl. 22/27	EUR	200.000	209.210,00	
4,8750 % CEZ AS MTN 10/25	EUR	2.500.000	2.529.000,00	
1,6250 % Corporación Andina de Fomento MTN 20/25	EUR	100.000	94.316,00	
5,0000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35424 23/27	EUR	217.000	219.452,10	
3,6250 % DNB Bank ASA FLR Non-Pref. MTN 23/27	EUR	100.000	98.454,50	
1,0000 % E.ON Intl Finance B.V. MTN 17/25	EUR	11.000	10.406,72	
1,6250 % EDP Finance B.V. MTN 18/26	EUR	100.000	94.318,00	
1,6590 % EP Infrastructure a.s. Notes 18/24	EUR	500.000	466.250,00	
4,3750 % Eurobank S.A. FLR Preferred MTN 22/25	EUR	400.000	393.620,00	
0,7500 % FNM S.p.A. MTN 21/26	EUR	450.000	388.838,25	
2,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 20/26	EUR	900.000	840.208,50	
1,0000 % General Motors Financial Co. MTN 22/25	EUR	100.000	94.503,50	
2,5000 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 20/24	EUR	555.000	544.091,48	
0,7500 % Iliad S.A. Obl. 21/24	EUR	1.000.000	965.000,00	
0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 19/24	EUR	500.000	473.435,00	
1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.77 16/26	EUR	2.500.000	2.342.325,00	
0,0000 % Königreich Spanien Bonos 20/25	EUR	2.000.000	1.879.600,00	
1,9630 % Korea Housing Fin.Corp. Mortg.Cov.Bds 22/26 R.S	EUR	1.700.000	1.589.712,50	
3,6250 % Ldsbk Baden-Württemb. SMT IHS 15/25	EUR	100.000	97.342,50	
2,3750 % Leonardo S.p.A. MTN 20/26	EUR	100.000	94.976,50	
0,5000 % RCI Banque S.A. Senior MTN 22/25	EUR	500.000	457.782,50	
1,5000 % Republik Polen MTN 15/25	EUR	1.000.000	952.390,00	
2,5000 % RWE AG MTN 22/25	EUR	1.350.000	1.309.081,50	
2,6250 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 17/25	EUR	400.000	386.704,00	
1,3750 % SEB S.A. Notes 20/25	EUR	300.000	279.843,00	
1,0000 % Südzucker Intl Finance B.V. Notes 17/25	EUR	500.000	467.482,50	
3,1250 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as Mrtg Cov.Bds 22/27	EUR	500.000	482.360,00	
0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 22/26	EUR	675.000	622.333,13	
3,0000 % Unipol Gruppo S.p.A. MTN 15/25 Reg.S	EUR	281.000	274.608,66	
2,3750 % Urenco Finance N.V. MTN 14/24	EUR	500.000	484.995,00	
3,0000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 20/25	EUR	1.000.000	984.030,00	
1,3500 % Wizz Air Finance Company B.V. MTN 21/24	EUR	1.102.000	1.059.297,50	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		30.460.427,22	30.460.427,22

DekaTresor

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

Deutschland, Mark	(DEM)	1,95583	= 1 Euro (EUR)
Niederlande, Gulden	(NLG)	2,20371	= 1 Euro (EUR)
Italien, Lira	(ITL)	1.936,27000	= 1 Euro (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87864	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,44300	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,96355	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,03840	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,99492	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,71750	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	23,62350	= 1 Euro (EUR)
Slowakei, Kronen	(SKK)	30,12600	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	379,39000	= 1 Euro (EUR)
Rumänien, Leu	(RON)	4,92070	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06170	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,44247	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,43175	= 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)
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				
CZK				
CZ0001006167	0,0000 % Tschechien Bonds S.135 21/24	CZK	0	30.000.000
EUR				
DE000AAR0371	3,0000 % Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.254 23/27	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2582860909	4,1250 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 23/29	EUR	700.000	700.000
XS1346254573	2,8750 % ABN AMRO Bank N.V. FLR MTN 16/28	EUR	400.000	400.000
XS2180510732	1,2500 % ABN AMRO Bank N.V. Non-Preferred MTN 20/25	EUR	0	1.200.000
XS2575971994	4,0000 % ABN AMRO Bank N.V. Non-Preferred MTN 23/28	EUR	1.000.000	1.000.000
XS2224621347	0,0000 % adidas AG Anl. 20/24	EUR	0	900.000
XS2464405229	2,2500 % AIB Group PLC FLR MTN 22/28	EUR	0	1.350.000
XS2578472339	4,6250 % AIB Group PLC FLR MTN 23/29	EUR	625.000	625.000
XS2531420730	2,6250 % Alliander N.V. MTN 22/27	EUR	250.000	250.000
DE000A3KY342	0,0000 % Allianz Finance II B.V. Zero MTN 21/26	EUR	0	1.000.000
XS1762980065	2,5000 % Alpha Bank S.A. Covered MTN 18/23	EUR	0	2.000.000
XS1951095329	2,6250 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 19/24	EUR	0	2.000.000
XS2579897633	4,7500 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN 23/31	EUR	475.000	475.000
XS1117528189	1,7500 % Babcock International Grp PLC MTN 14/22	EUR	0	500.000
IT0005489932	0,7500 % Banco BPM S.p.A. MT Mortg.Cov. Bds 22/27	EUR	0	1.000.000
XS2583203950	5,2500 % Banco de Sabadell S.A. FLR N.-Pref. MTN 23/29	EUR	700.000	700.000
XS2353366268	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28	EUR	0	500.000
XS2553801502	5,1250 % Banco de Sabadell S.A. FLR Preferred MTN 22/28	EUR	700.000	700.000
ES0413900848	2,3750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 22/27	EUR	3.000.000	3.000.000
ES0413900939	3,2500 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 23/28	EUR	600.000	600.000
ES0413900913	3,3750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 23/30	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2530208490	4,0000 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 22/27	EUR	1.000.000	1.000.000
XS2486282358	3,0000 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 22/29	EUR	0	975.000
XS2576362839	4,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 23/28	EUR	475.000	475.000
XS2489398185	1,8390 % Bank of Queensland Ltd. MT Mortg.Cov.Bds 22/27	EUR	0	1.000.000
XS2539425095	10,0000 % Bank of Valletta PLC FLR Non-Pref. MTN 22/27	EUR	1.475.000	1.475.000
ES0313679K13	0,8750 % Bankinter S.A. Preferred Bonos 19/24	EUR	0	800.000
XS2199265617	0,3750 % Bayer AG Anl. 20/24	EUR	0	1.800.000
XS2445374213	1,2060 % Beijing St.-ow.Cap.Op.M.I.Hld. Bonds 22/25	EUR	0	650.000
BE6324012978	0,3750 % Belfius Bank S.A. Non-Preferred MTN 20/25	EUR	0	600.000
FR001400F5R1	3,1250 % BPCE SFH MT Obl.Fin.Hab. 23/27	EUR	1.100.000	1.100.000
FR001400F323	5,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 23/33	EUR	500.000	500.000
XS2536817211	4,1250 % Bulgarien MTN 22/29	EUR	3.450.000	3.450.000
DE0001141836	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.183 21/26	EUR	0	1.000.000
DE0001030567	0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 15/26	EUR	0	100.000
XS1897489578	1,7500 % Caixabank S.A. Non-Preferred MTN 18/23	EUR	0	1.000.000
ES0415306051	0,6250 % Caja Rural de Navarra S.C.d.C. Céd. Hipotec. 16/23	EUR	0	1.300.000
ES0415306093	0,7500 % Caja Rural de Navarra S.C.d.C. Céd. Hipotec. 22/29	EUR	0	2.800.000
XS2461785185	2,0000 % Castellum Helsinki Fin.Hol.Abp MTN 22/25	EUR	0	925.000
XS1468525057	2,3750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 16/24	EUR	0	100.000
XS2461786829	2,3750 % CEZ AS MTN 22/27	EUR	0	850.000
FR0012317758	4,0000 % CNP Assurances S.A. FLR Notes 14/Und.	EUR	500.000	500.000

DekaTresor

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2585553097	7,3750 % Bankinter S.A. FLR Bond 23/Und.	EUR	400.000	400.000
XS2555220867	4,2500 % Booking Holdings Inc. Notes 22/29	EUR	850.000	850.000
XS2356316872	1,7500 % CECONOMY AG Anl. 21/26	EUR	0	700.000
XS2466172363	1,6250 % Daimler Truck Intl Finance MTN 22/27	EUR	0	300.000
XS2545259876	4,5000 % Dell Bank International DAC MTN 22/27	EUR	1.500.000	1.500.000
XS2526379313	2,1250 % Development Bank of Japan MTN 22/26	EUR	0	700.000
XS2388910270	2,2500 % DIC Asset AG Anl. 21/26	EUR	0	200.000
XS2384715244	0,4500 % DXC Capital Funding DAC Notes 21/27 Reg.S	EUR	0	2.375.000
XS2338193019	2,0000 % Eurobank S.A. FLR MTN 21/27	EUR	0	100.000
ES0844251019	9,1250 % Ibercaja Banco S.A.U. FLR Notes 23/Und.	EUR	200.000	200.000
XS2587558474	6,6250 % INEOS Finance PLC Notes 23/28 Reg.S	EUR	225.000	225.000
XS2366741770	0,0000 % Leasys S.p.A. Notes 21/24	EUR	0	1.025.000
XS2561647368	4,6250 % Liberty Mutual Group Inc. Notes 22/30 Reg.S	EUR	1.325.000	1.325.000
XS2431318711	0,6250 % Logicor Financing S.à.r.l. MTN 22/25	EUR	0	1.000.000
PTMTLAOM0008	7,3000 % Metropolitano de Lisboa Notes 10/25	EUR	0	500.000
XS1511779305	1,3750 % Mexiko MTN 16/25	EUR	0	2.500.000
XS2528323780	3,4900 % Mizuho Financial Group Inc. MTN 22/27	EUR	2.500.000	2.500.000
XS2166217278	3,0000 % Netflix Inc. Notes 20/25 Reg.S	EUR	0	950.000
DE000NLB1KJ5	1,2700 % Norddte Ldsbk -GZ- FLR IHS S.1648 13/23	EUR	0	1.400.000
XS2498964209	6,0000 % Nova Ljubljanska Banka d.d. FLR Pref. Notes 22/25	EUR	0	1.300.000
XS2559453431	3,2500 % Paccar Financial Europe B.V. MTN 22/25	EUR	700.000	700.000
XS2176872849	3,5000 % PPF Telecom Group B.V. MTN 20/24	EUR	0	1.000.000
XS2484339499	1,8750 % PPG Industries Inc. Notes 22/25	EUR	0	600.000
XS2552369469	4,6250 % Red Electrica Corporacion S.A. FLR Notes 23/Und.	EUR	600.000	600.000
XS2532473555	4,5650 % Smith & Nephew PLC Notes 22/29	EUR	700.000	700.000
XS1426022536	1,5460 % Sumitomo Mitsui Financ. Group Notes 16/26	EUR	0	750.000
XS2582389156	6,1350 % Telefónica Europe B.V. FLR Notes 23/Und.	EUR	1.100.000	1.100.000
XS2054209833	0,8400 % Wintershall Dea Finance B.V. Notes 19/25	EUR	0	100.000
USD				
US718286CY18	4,6250 % Philippinen Bonds 23/28	USD	300.000	300.000
US87264ACZ66	4,9500 % T-Mobile USA Inc. Notes 23/28	USD	550.000	550.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE0002456589	5,4500 % BHW Bausparkasse AG Nachr. IHS Ausg.28 03/23	EUR	0	1.000.000
FR0011349349	4,3000 % Collectivité Territoriale Bonds 12/22	EUR	0	1.000.000
DE000NLB1E80	3,5000 % Norddte Ldsbk -GZ- IHS S.1282 10/22	EUR	0	1.200.000
XS2104122986	0,0000 % Philippinen Bonds 20/23	EUR	0	2.200.000
DE000A3E5VF1	0,3000 % ProCredit Holding AG & Co.KGaA Anl. 21/22	EUR	0	1.300.000
RORKMPDW6594	0,4500 % Republik Rumänien Bonds 20/22	EUR	0	2.000.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Terminkontrakte		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): Euro Bund (10,0), EURO Bund Future (FGBL), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), SHORT EURO-BTP Future (FBTS), Two-Year US Treasury Note Future (TU), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY))	EUR	34.051
Verkaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO Schatz Future (FGBS), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), SHORT EURO-BTP Future (FBTS), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY))	EUR	307.989
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	13.300
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	13.100
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
CHF/EUR	EUR	4.030
CZK/EUR	EUR	51.252
GBP/EUR	EUR	6.223
PLN/EUR	EUR	6.180
RON/EUR	EUR	16.659
USD/EUR	EUR	53.283
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
CZK/EUR	EUR	12.904
GBP/EUR	EUR	455
JPY/EUR	EUR	4.325
NOK/EUR	EUR	1.851
SEK/EUR	EUR	31.354
USD/EUR	EUR	2.089

DekaTresor

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	9.709.534
Anteilwert	EUR	81,61

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

Investmentanteile

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

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR

30.460.427,22

in % des Fondsvermögens

3,84

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

30.460.427,22

Sitzstaat

Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)

unbefristet

absolute Beträge in EUR

30.460.427,22

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 Anleiherrating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR

GBP

USD

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

42.823.439,94

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

Kostenanteil des Fonds

Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

39.565,06

13.056,54

13.056,54

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00

33,00

33,00

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

Abwicklung inklusive der Sicherheitenstellung abgegolten.

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

3,92% (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
Lloyds Bank PLC	27.885.096,01
Citigroup Global Markets Holdings Inc.	7.741.642,80
Netflix Inc.	2.646.945,58
PayPal Holdings Inc.	1.968.767,07
Danone S.A.	1.247.405,49
Vonovia SE	572.161,50
Iberdrola Finanzas S.A.	464.886,16
Deutsche Bank AG	296.535,33

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	40.707.337,62 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking	2.116.102,32 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

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

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

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

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

Frankfurt am Main, den 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

