

Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2024.

Deka-AV Europa Balance

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2024

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deko-AV Europa Balance für den Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024.

Der Trend rückläufiger Inflationsraten in den vergangenen sechs Monaten stabilisierte die Finanzmärkte und verlieh den Aktienbörsen weiterhin kräftigen Auftrieb. Gleichwohl findet die europäische Wirtschaft nur langsam zurück auf den Aufwärtspfad. Die deutsche Volkswirtschaft wies im ersten Quartal 2024 wieder Erholungstendenzen auf, nachdem das größte EWU-Mitglied 2023 noch als Wachstumsstütze ausgefallen war. Während sich in Europa ein moderates Anziehen der wirtschaftlichen Aktivität abzeichnet, präsentierte sich die Wirtschaftslage in den USA hingegen sehr robust, auch die Schwellenländer wachsen solide. Jedoch sorgten die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken konzentrierte sich weiterhin auf die Inflationsbekämpfung, wobei sich die Hinweise für eine Senkung der Leitzinsen zur Jahresmitte verdichteten. Im ersten Quartal 2024 sorgten allerdings die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und wieder steigende Renditen. Die Fed behielt das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei. Die EZB senkte hingegen den Hauptrefinanzierungssatz im Juni von 4,50 Prozent um 25 Basispunkte auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende Juni bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,4 Prozent. Damit legten die Renditen auf Halbjahressicht zu.

Die globalen Zinssenkungserwartungen waren ein Antriebsfaktor für die Kurse der weltweiten Aktienmärkte, die sich in der Breite in einer freundlichen Verfassung zeigten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten zwischenzeitlich jeweils auf ein Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Die großen US-Technologiewerte mit Bezug zum Trendthema Künstliche Intelligenz verzeichneten dabei die stärksten Zuwächse.

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

Deko Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024	7
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

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

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

Um dies zu erreichen, legt der Fonds in verzinsliche Wertpapiere und Aktien von Ausstellern bzw. Unternehmen mit Sitz in Europa sowie in Anlageinstrumente mit Rohstoffbezug an. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Aktien und Aktienfonds investiert werden darf, beträgt maximal 35%. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Anlageinstrumente mit Rohstoffbezug investiert werden darf, beträgt maximal 15%. 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.

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 Marktrichtung 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.

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

Wichtige Kennzahlen

Deka-AV Europa Balance

Performance*	6 Monate
	0,0%
ISIN	DE000DK09VD9

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

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.

Deka-AV Europa Balance

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	379.863.641,33	70,96
Belgien	4.571.580,00	0,85
Deutschland	194.262.847,33	36,28
Frankreich	68.647.840,00	12,84
Italien	22.492.419,00	4,20
Niederlande	24.699.850,00	4,61
Österreich	11.710.256,00	2,19
Sonstige	7.935.531,00	1,48
Spanien	45.543.318,00	8,51
2. Investmentanteile	58.843.679,36	10,99
Deutschland	3.302.608,16	0,61
Irland	26.192.029,76	4,89
Luxemburg	26.873.537,44	5,03
Österreich	2.475.504,00	0,46
3. Derivate	-794.184,06	-0,15
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	82.088.949,39	15,35
5. Sonstige Vermögensgegenstände	15.696.026,67	2,93
II. Verbindlichkeiten	-417.106,89	-0,08
III. Fondsvermögen	535.281.005,80	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	379.863.641,33	70,96
EUR	379.863.641,33	70,96
2. Investmentanteile	58.843.679,36	10,99
EUR	58.843.679,36	10,99
3. Derivate	-794.184,06	-0,15
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	82.088.949,39	15,35
5. Sonstige Vermögensgegenstände	15.696.026,67	2,93
II. Verbindlichkeiten	-417.106,89	-0,08
III. Fondsvermögen	535.281.005,80	100,00

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

Deka-AV Europa Balance

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								370.157.237,33	69,15
Verzinsliche Wertpapiere								370.157.237,33	69,15
EUR								370.157.237,33	69,15
FR001400N7K2	3,0000 % Agence Française Développement MTN 24/34		EUR	8.000.000	8.000.000	0	% 96,126	7.690.080,00	1,44
DE000A0Z1UH6	0,7500 % Bayer.Landesbodenkreditanstalt IHS 15/25		EUR	3.100.000	0	0	% 97,556	3.024.220,50	0,56
DE000BLB9P76	4,6780 % Bayerische Landesbank FLR Hyp.-Pfe. 21/24		EUR	5.500.000	0	0	% 100,325	5.517.847,50	1,03
DE000BHY0GL4	0,0100 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 19/27		EUR	3.100.000	0	0	% 90,972	2.820.132,00	0,53
DE000BHY0JS3	1,1500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 22/25		EUR	10.000.000	10.000.000	0	% 97,580	9.758.000,00	1,82
DE000102507	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30 ¹⁾		EUR	5.300.000	0	0	% 86,695	4.594.835,00	0,86
DE000BU2Z007	2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 23/33 ¹⁾		EUR	26.000.000	30.000.000	4.000.000	% 99,090	25.763.400,00	4,81
DE0001030559	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 14/30 ¹⁾		EUR	6.200.000	0	0	% 126,606	7.849.563,83	1,47
DE000DKB0432	0,5000 % Deutsche Kreditbank AG Hyp.-Pfe. 15/27		EUR	2.100.000	0	0	% 93,052	1.954.092,00	0,37
DE000A2G9HE4	0,5000 % DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1205 18/25		EUR	10.000.000	10.000.000	0	% 96,145	9.614.450,00	1,80
DE000A12UGG2	1,1250 % DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.356 14/24 [WL]		EUR	1.200.000	0	0	% 99,439	1.193.262,00	0,22
DE000A14J5J4	0,5000 % DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.361 15/27 [WL]		EUR	4.100.000	0	0	% 92,828	3.805.927,50	0,71
DE000A161ZQ3	0,7500 % DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.371 15/26 [WL]		EUR	1.400.000	0	0	% 95,919	1.342.866,00	0,25
XS1181448561	0,7500 % Erste Group Bank AG MT Hyp.-Pfe. 15/25		EUR	1.800.000	0	0	% 98,292	1.769.256,00	0,33
EU000A1ZR7H3	1,3750 % Europäische Union MTN 14/29		EUR	4.300.000	0	0	% 92,609	3.982.187,00	0,74
XS0502603136	3,9250 % European Investment Bank FLR MTN 10/25		EUR	700.000	0	0	% 100,071	700.493,50	0,13
XS1107718279	1,2500 % European Investment Bank MTN 14/26		EUR	400.000	0	0	% 96,192	384.768,00	0,07
XS1422953932	1,0000 % European Investment Bank MTN 16/32		EUR	2.100.000	0	0	% 86,713	1.820.962,50	0,34
XS2015227494	0,1250 % European Investment Bank MTN 19/29 ¹⁾		EUR	1.200.000	0	0	% 87,260	1.047.120,00	0,20
DE000A1680S7	1,0000 % Freie Hansestadt Bremen Landessch. Ausg.209 18/28		EUR	2.100.000	0	0	% 93,292	1.959.132,00	0,37
DE000A2LQPK4	0,0100 % Freie u.Hansestadt Hamburg Landessch. Ausg.4 21/31 ¹⁾		EUR	7.200.000	0	0	% 81,227	5.848.344,00	1,09
DE0001053510	0,0300 % Freistaat Bayern Schatzanw. S.132 20/28		EUR	5.200.000	0	0	% 89,717	4.665.284,00	0,87
DE000A2BPJZ8	0,2000 % Freistaat Thüringen Landessch. S.2016/01 16/26		EUR	1.000.000	0	0	% 93,616	936.155,00	0,17
DE000A2YNIC2	0,0100 % Investitionsbank Berlin IHS S.215 21/31		EUR	4.100.000	0	0	% 81,457	3.339.716,50	0,62
ES0000012I32	0,5000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/31		EUR	2.100.000	0	0	% 82,904	1.740.984,00	0,33
ES0000012L52	3,1500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33		EUR	23.700.000	0	0	% 98,982	23.458.734,00	4,38
ES0000012L78	3,5500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33		EUR	20.000.000	20.000.000	0	% 101,718	20.343.600,00	3,80
BE0000335449	1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.75 15/31		EUR	5.200.000	0	0	% 87,915	4.571.580,00	0,85
NL0010733424	2,0000 % Königreich Niederlande Anl. 14/24 ¹⁾		EUR	15.000.000	0	0	% 99,950	14.992.500,00	2,80
NL0011220108	0,2500 % Königreich Niederlande Anl. 15/25		EUR	10.000.000	0	0	% 97,074	9.707.350,00	1,81
DE000A14J421	0,5000 % Konsort. BB,HB,HH,MV,RP,SL,SH Laender. Nr.47 15/25		EUR	3.600.000	0	0	% 98,235	3.536.460,00	0,66
DE000A2LQKN9	0,3750 % Konsortium HB,HH,RP,SL,SH Laender. Nr.54 18/25		EUR	5.000.000	0	0	% 97,626	4.881.300,00	0,91
DE000A2TSTS8	0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 19/24 ¹⁾		EUR	10.000.000	0	0	% 99,980	9.998.000,00	1,87
DE000A254PM6	0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 20/25 ¹⁾		EUR	9.000.000	0	0	% 97,838	8.805.420,00	1,65
DE000A3E5XN1	0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/32		EUR	2.100.000	0	0	% 81,630	1.714.230,00	0,32
DE000A14JZP2	0,0100 % Land Baden-Württemberg Landessch. 20/30		EUR	5.200.000	0	0	% 83,788	4.356.976,00	0,81
DE000A1680I5	0,6250 % Land Berlin Landessch. Ausg.487 16/26		EUR	200.000	0	0	% 95,783	191.566,00	0,04
DE000A2E4EE4	0,6250 % Land Berlin Landessch. Ausg.509 19/29		EUR	2.800.000	0	0	% 90,159	2.524.452,00	0,47
DE000A2NB9V2	0,1000 % Land Berlin Landessch. Ausg.514 19/30		EUR	2.500.000	0	0	% 85,703	2.142.575,00	0,40
DE000A11QEX2	0,3750 % Land Brandenburg MTN Landessch. 15/25		EUR	1.700.000	0	0	% 97,658	1.660.177,50	0,31

Deka-AV Europa Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE000A11QEW4	0,6250 % Land Brandenburg Schatzanw. 15/25		EUR	1.200.000	0	0	% 98,350	1.180.200,00	0,22
DE000A1RQCY2	0,3750 % Land Hessen Schatzanw. S.1605 16/26		EUR	2.300.000	0	0	% 94,806	2.180.526,50	0,41
DE000A1RQC93	0,6250 % Land Hessen Schatzanw. S.1801 18/28		EUR	2.500.000	0	0	% 91,123	2.278.062,50	0,43
DE000A1RQD35	0,0000 % Land Hessen Schatzanw. S.2102 21/26		EUR	1.400.000	0	0	% 94,174	1.318.429,00	0,25
DE000A1RQD43	0,0100 % Land Hessen Schatzanw. S.2103 21/31		EUR	1.000.000	0	0	% 81,927	819.265,00	0,15
DE000A12T9W9	3,9470 % Land Niedersachsen FLR Landessch. Ausg.583 14/24		EUR	1.500.000	0	0	% 100,044	1.500.652,50	0,28
DE000A161HQ1	4,1140 % Land Niedersachsen FLR Landessch. Ausg.584 15/25		EUR	1.500.000	0	0	% 100,244	1.503.660,00	0,28
DE000A2AAWN1	0,5000 % Land Niedersachsen Landessch. Ausg.863 16/26		EUR	3.100.000	0	0	% 95,088	2.947.728,00	0,55
DE000A2TR8W8	0,3750 % Land Niedersachsen Landessch. Ausg.888 19/29		EUR	1.100.000	0	0	% 88,560	974.160,00	0,18
DE000NRW0GF2	3,9620 % Land Nordrhein-Westf. FLR Landessch. R.1345 15/25		EUR	7.200.000	0	0	% 100,081	7.205.832,00	1,35
DE000NRW0K03	0,9500 % Land Nordrhein-Westf. MTN Landessch. R.1456 18/28		EUR	2.700.000	0	0	% 93,050	2.512.350,00	0,47
DE000NRW0K03	0,5000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1435 17/27		EUR	1.200.000	0	0	% 93,549	1.122.588,00	0,21
DE000NRW0LF2	0,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1471 18/28		EUR	1.000.000	0	0	% 91,687	916.865,00	0,17
DE000NRW0N67	2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1561 23/33 ¹⁾		EUR	5.000.000	5.000.000	0	% 99,576	4.978.800,00	0,93
DE000RLP0645	0,5000 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 15/25		EUR	6.000.000	0	0	% 98,336	5.900.160,00	1,10
DE000RLP0942	0,7000 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 17/28		EUR	3.500.000	0	0	% 92,654	3.242.872,50	0,61
DE000RLP1171	0,0500 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 20/30		EUR	4.100.000	0	0	% 85,490	3.505.090,00	0,65
DE000A2TR208	0,7500 % Land Sachsen-Anhalt Landessch. 19/19		EUR	1.000.000	0	0	% 90,672	906.715,00	0,17
DE000A3H3D69	0,0000 % Land Sachsen-Anhalt Landessch. 21/31		EUR	1.000.000	0	0	% 82,585	825.850,00	0,15
XS1793273092	0,8750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H320 18/28		EUR	1.000.000	0	0	% 92,023	920.230,00	0,17
DE000LFA1800	0,7500 % LfA Foerderbank Bayern IHS R.1180 19/31		EUR	3.100.000	0	0	% 86,523	2.682.213,00	0,50
DE000NWB0584	0,5000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.058 16/26 ¹⁾		EUR	1.400.000	0	0	% 95,415	1.335.810,00	0,25
FR001400H7V7	3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33		EUR	25.000.000	25.000.000	0	% 98,432	24.608.000,00	4,60
FR001400L834	3,5000 % Rep. Frankreich OAT 23/33		EUR	30.000.000	30.000.000	0	% 102,020	30.606.000,00	5,73
IT0005422891	0,9000 % Republik Italien B.T.P. 20/31		EUR	2.100.000	0	0	% 83,439	1.752.219,00	0,33
IT0005518128	4,4000 % Republik Italien B.T.P. 22/33		EUR	20.000.000	20.000.000	0	% 103,701	20.740.200,00	3,87
AT0000A185T1	1,6500 % Republik Österreich Bundesanl. 14/24		EUR	10.000.000	0	0	% 99,410	9.941.000,00	1,86
FR0013524410	0,2500 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. MTN 20/35		EUR	8.000.000	8.000.000	0	% 71,797	5.743.760,00	1,07
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								9.706.404,00	1,81
Verzinsliche Wertpapiere								9.706.404,00	1,81
EUR								9.706.404,00	1,81
DE000LB387E8	2,9200 % Ldsbk Baden-Wuerttemb. Inflations-Anl. 23/25		EUR	5.000.000	0	0	% 98,940	4.947.000,00	0,92
DE000A2GSN58	0,6250 % Sparkasse Hannover Hyp.-Pfe. R.1 17/27		EUR	5.200.000	0	0	% 91,527	4.759.404,00	0,89
Wertpapier-Investmentanteile								58.843.679,36	10,99
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								3.302.608,16	0,61
EUR								3.302.608,16	0,61
DE000DK0V6V5	Deka-Prämienstrategie Select I		ANT	17,052	0	0	EUR 94,830	1.617.041,16	0,30
DE0005424568	Deka-Vega Plus I (A)		ANT	24,650	0	0	EUR 68,380	1.685.567,00	0,31
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								26.684.290,00	4,99
EUR								26.684.290,00	4,99
LU0297135294	Deka-OptiRent CF		ANT	178,600	0	0	EUR 121,580	21.714.188,00	4,06
LU0332479749	Deka-OptiRent TF		ANT	21,400	0	0	EUR 116,570	2.494.598,00	0,47
AT0000A2W9P5	IQAM OptionsprämienStrategje Protect (S)		ANT	2,400	0	0	EUR 1031,460	2.475.504,00	0,46
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								28.856.781,20	5,39
EUR								28.856.781,20	5,39
LU1681041890	AIS-Amundi MSCI Eu.Quality F. Namens-Ant. C Cap.		ANT	23,388	77,795	54,507	EUR 113,380	2.651.731,44	0,50
LU1681041460	AIS-Amundi MSCI EUR.Moment.FA. Namens-Ant. C Cap.		ANT	100	0	0	EUR 106,260	10.626,00	0,00
IE00B66F4759	iShs EO H.Yield Corp Bd U.ETF Reg.Shares		ANT	283,660	33,314	0	EUR 92,336	26.192.029,76	4,89

Deka-AV Europa Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	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	100	750.350	750.400	EUR 23,940	2.394,00	0,00
Summe Wertpapiervermögen								EUR 438.707.320,69	81,95
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								569.273,54	0,11
	DJ Stoxx 600 Future (FXXP) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 5.764				526.883,54	0,10
	STXE 600 Autom. & Par. Index Future (SXAP) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				65,00	0,00
	STXE 600 Banks Future (FSTB) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				202,50	0,00
	STXE 600 Basic Res. Index Future (FSTS) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 2				1.160,00	0,00
	STXE 600 Chemicals Index Future (FSTC) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				575,00	0,00
	STXE 600 Constr.& Mat. Index Future (FSTN) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				-235,00	0,00
	STXE 600 Financi. Ser. Index Future (FSTF) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				70,00	0,00
	STXE 600 Food & Bever. Index Future (FSTO) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				-875,00	0,00
	STXE 600 Healthcare Index Future (FSTH) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 135				47.250,00	0,01
	STXE 600 Indust. G.&S. Index Future (FSTG) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 170				-15.300,00	0,00
	STXE 600 Insurance Index Future (FSTI) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				525,00	0,00
	STXE 600 Media Index Future (FSTM) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 2				790,00	0,00
	STXE 600 Oil & Gas Index Future (FSTE) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				590,00	0,00
	STXE 600 Retail Index Future (FSTR) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				-375,00	0,00
	STXE 600 Technology Index Future (FSTY) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 179				8.055,00	0,00
	STXE 600 Travel & Lei. Index Future (FSTV) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 2				152,50	0,00
	STXE 600 Utilities Index Future (FSTU) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				70,00	0,00
	STXE Mid 200 Index Future (FMCP) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				-35,00	0,00
	STXE600 Pers. & H. G. Index Future (FSTZ) Sep. 24	XEUR	EUR	Anzahl 1				-295,00	0,00
Optionsrechte								-218.721,20	-0,04
Optionsrechte auf Aktienindizes								-218.721,20	-0,04
	DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Aug. 24 4400	XEUR		Anzahl -47			EUR 15,000	-7.050,00	0,00
	DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Dez. 25 3500	XEUR		Anzahl -47			EUR 60,500	-28.435,00	-0,01
	DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Sep. 25 3400	XEUR		Anzahl -47			EUR 41,900	-19.693,00	0,00
	OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Apr. 26 3900	OTC		Anzahl -470			EUR 118,348	-55.623,53	-0,01
	OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Jan. 26 3500	OTC		Anzahl -470			EUR 63,237	-29.721,39	-0,01
	OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Mai 25 3300	OTC		Anzahl -480			EUR 24,982	-11.991,55	0,00
	OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Mai 26 4000	OTC		Anzahl -460			EUR 143,928	-66.206,73	-0,01
Summe Aktienindex-Derivate								EUR 350.552,34	0,07
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								-1.144.736,40	-0,22
	10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 24	XEUR	EUR	11.500.000				-137.398,86	-0,03
	EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 24	XEUR	EUR	-27.600.000				-154.542,40	-0,03
	EURO Bund Future (FGBL) Sep. 24	XEUR	EUR	-55.200.000				-364.379,94	-0,07
	EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 24	XEUR	EUR	-17.400.000				-54.810,00	-0,01
	EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 24	XEUR	EUR	39.700.000				-624.005,20	-0,12
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 24	XEUR	EUR	-8.000.000				190.400,00	0,04
Summe Zins-Derivate								EUR -1.144.736,40	-0,22
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	61.926.780,22			% 100,000	61.926.780,22	11,58
EUR-Guthaben bei									
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	20.162.169,17			% 100,000	20.162.169,17	3,77
Summe Bankguthaben								EUR 82.088.949,39	15,35
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR 82.088.949,39	15,35
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	2.843.633,88				2.843.633,88	0,53
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	12.837.573,60				12.837.573,60	2,40
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	2.848,29				2.848,29	0,00
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	11.970,90				11.970,90	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 15.696.026,67	2,93
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-939,90				-939,90	0,00
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-416.166,99				-416.166,99	-0,08
Summe Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -417.106,89	-0,08
Fondsvermögen								EUR 535.281.005,80	100,00
Umlaufende Anteile								STK 10.515.350,000	
Anteilwert								EUR 50,90	

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

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

Deka-AV Europa Balance

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Wahrung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erluterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen bertragen:				
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30	EUR	5.300.000	4.594.835,00	
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 23/33	EUR	17.000.000	16.845.300,00	
0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 14/30	EUR	6.200.000	7.849.563,83	
0,1250 % European Investment Bank MTN 19/29	EUR	500.000	436.300,00	
0,0100 % Freie u.Hansestadt Hamburg Landessch. Ausg.4 21/31	EUR	400.000	324.908,00	
2,0000 % Knigreich Niederlande Anl. 14/24	EUR	10.000.000	9.995.000,00	
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 19/24	EUR	145.000	144.971,00	
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 20/25	EUR	3.000.000	2.935.140,00	
2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1561 23/33	EUR	5.000.000	4.978.800,00	
0,5000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.058 16/26	EUR	2.000	1.908,30	
Gesamtbetrag der Rckerstattungsansprche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		48.106.726,13	48.106.726,13

Marktschlssel

Terminbrsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zrich)

OTC

Over-the-Counter

Wahrend des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschafte, soweit sie nicht mehr in der Vermgenaufstellung erscheinen:

- Kufe und Verkufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stck bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Kufe/ Zugange	Verkufe/ Abgange
Brsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
FR0013448776	0,0500 % Bpifrance SACA MTN 19/29	EUR	0	9.900.000
DE0001134922	6,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 94/24	EUR	0	13.000.000
DE0001141794	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.179 19/24	EUR	0	20.000.000
FR0013459757	0,1000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 19/29	EUR	0	2.100.000
BE0000332412	2,6000 % Knigreich Belgien Obl. Lin. S.72 14/24	EUR	0	25.000.000
DE000A255D88	0,1250 % Land Niedersachsen Landessch. S.891 20/30	EUR	0	2.100.000
FR0013426731	0,3500 % Rgie Auton.Transp. Par.(RATP) MTN 19/29	EUR	0	400.000
FR0011982776	0,7000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 14/30	EUR	0	8.300.000
FR0011619436	2,2500 % Rep. Frankreich OAT 13/24	EUR	0	20.000.000
FR0011883966	2,5000 % Rep. Frankreich OAT 14/30	EUR	0	21.700.000
FR0013344751	0,0000 % Rep. Frankreich OAT 18/24	EUR	0	20.000.000
FR0013516549	0,0000 % Rep. Frankreich OAT 19/30	EUR	0	6.200.000
XS1186684137	1,1250 % SNCF Rseau S.A. MTN 15/30	EUR	0	3.600.000
Zertifikate				
EUR				
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK	171.983	278.703
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000BHY0BE0	0,3750 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. S.198 16/24	EUR	0	1.000.000
DE000A11QEJ1	1,6250 % Land Berlin Landessch. Ausg.435 14/24	EUR	0	5.000.000
DE000RLP1346	0,0100 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 22/24	EUR	0	6.200.000
DE000HLB4JM3	4,0020 % Lb.Hessen-Thr. GZ FLR ff.-Pfe. S.0513B/012 14/24	EUR	0	2.300.000

Gattungsbezeichnung	Stck bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionspramien bzw. Volumen der Optionsgeschafte, bei Optionsscheinen Angabe der Kufe und Verkufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
	EUR	468.385
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), STXE 600 Automobiles & Parts Index (Price) (EUR), STXE 600 Banks Index (Price) (EUR), STXE 600 Basic Resources Index (Price) (EUR), STXE 600 Chemicals Index (Price) (EUR), STXE 600 Constr. & Materials Index (Price) (EUR), STXE 600 Financial Services Index (Price) (EUR), STXE 600 Food & Beverage Index (Price) (EUR), STXE 600 Health Care Index (Price) (EUR), STXE 600 Index (Price) (EUR), STXE 600 Industrial G&S Index (Price) (EUR), STXE 600 Insurance Index (Price) (EUR), STXE 600 Media 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), STXE 600 Utilities Index (Price) (EUR), STXE Mid 200 Index (Price) (EUR))		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
	EUR	239.082
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO-BTP Future (FBTP), Long Term EURO OAT Future (FOAT))		
Verkaufte Kontrakte:		
	EUR	504.543
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), Long Term EURO OAT Future (FOAT))		
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		

Deka-AV Europa Balance

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), STXE 600 Utilities Index (Price) (EUR))	EUR	151.829
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), STXE 600 Index (Price) (EUR))	EUR	354.625
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))	EUR	38.570
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), STXE 600 Basic Resources Index (Price) (EUR))	EUR	17.837
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	199.430
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	96.200
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
befristet (Basiswert(e): 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30)	EUR	553
unbefristet (Basiswert(e): 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30, 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.179 19/24, 0,0000 % Rep. Frankreich OAT 18/24, 0,0000 % Rep. Frankreich OAT 19/30, 0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/32, 0,2500 % Königreich Niederlande Anl. 15/25, 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 14/30, 0,5000 % DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1205 18/25, 0,6250 % Land Berlin Landessch. Ausg.509 19/29, 0,6250 % Land Brandenburg Schatzanw. 15/25, 0,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1471 18/28, 1,6500 % Republik Österreich Bundesanl. 14/24, 2,0000 % Königreich Niederlande Anl. 14/24, 2,2500 % Rep. Frankreich OAT 13/24, 2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 23/33, 2,6000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.72 14/24, 3,0000 % Agence Française Développement MTN 24/34, 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33, 3,5000 % Rep. Frankreich OAT 23/33, 4,4000 % Republik Italien B.T.P. 22/33)	EUR	463.896

Deka-AV Europa Balance

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	10.515.350
Anteilwert	EUR	50,90

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

Investmentanteile

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

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR

48.106.726,13

in % des Fondsvermögens

8,99

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

48.106.726,13

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

48.106.726,13

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

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

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR

GBP

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

54.735.032,06

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

Kostenanteil des Fonds

Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

in % der Bruttoerträge des Fonds

16.733,00

5.521,85

5.521,85

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.

Deka-AV Europa Balance

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.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

10,97% (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
LfA Förderbank Bayern	19.214.632,72
Siemens AG	9.950.507,88
Fresenius SE & Co. KGaA	8.476.664,38
NRW.BANK	7.618.402,84
HSBC Holdings PLC	3.994.668,47
Hamburger Sparkasse AG	3.094.836,74
Berlin Hyp AG	2.057.152,46
Kreditanstalt für Wiederaufbau	328.166,58

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 Frankfurt	12.471.332,85 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt	42.263.699,22 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. Juli 2024

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2023

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 112,7 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 Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 2024

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

