

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2023.  
**DekaFonds**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Dekafonds für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023.

Nach mehr als fünfzehn Monaten seit dem russischen Einmarsch in die Ukraine ist an den Finanzplätzen eine Form von Gewöhnung an den Konflikt zu konstatieren, wenngleich die Auswirkungen auf die verschiedenen Volkswirtschaften weiterhin präsent bleiben. Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor nahmen angesichts eines milden Winters spürbar ab. Die Teuerungsraten entfernten sich im Verlauf von ihren Höchstständen. Zudem führte die abrupte Abkehr von der rigiden Null-Covid-Politik und entsprechender Lockdown-Maßnahmen in China zu einer Wiederbelebung des globalen Handels.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtshalbjahr unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,00 Prozent bis 5,25 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,00 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 3,8 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen startete mit Rückenwind in das Jahr 2023 und trotz erhöhter Anleiherenditen sowie zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren aus dem Bankensektor bestimmte eine Aufwärtsbewegung das Bild an den Aktienmärkten. Der Euro tendierte im Verhältnis zum US-Dollar seit dem Jahreswechsel in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende Juni bei 1,09 US-Dollar.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

|   |    |
|---|----|
| Anlagepolitik                               | 5  |
| Anteilklassen im Überblick                  | 6  |
| Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023        | 7  |
| Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023      | 8  |
| 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.**

# DekaFonds

## Anlagepolitik.

Anlageziel dieses Fonds ist es, einen mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachs durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Aktien zu erwirtschaften.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds hauptsächlich in Aktien von Unternehmen mit Sitz in Deutschland oder von Unternehmen, die in einem deutschen Aktienindex enthalten sind oder von Unternehmen, die nach dem Ausweis im letzten Geschäftsbericht ihre Umsatzerlöse oder Gewinne überwiegend in Deutschland erzielen, an. Daneben können Aktien von Unternehmen mit Sitz in einem anderen europäischen Land erworben werden. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, mindestens 61% in Aktien zu investieren.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Die Aktienauswahl erfolgt auf Basis einer Unternehmensanalyse. In diesem Beurteilungsverfahren werden die wirtschaftlichen Daten auf Unternehmensebene analysiert und zu einer Gesamteinschätzung zusammengeführt. Die wirtschaftlichen Daten bestehen aus Bilanzkennzahlen z.B. Eigenkapitalquote und Nettoverschuldung und Kennzahlen der Gewinn- und Verlustrechnung - z.B. Gewinn vor Steuern und Jahresüberschuss. Des Weiteren werden Kennzahlen der Kapitalfluss-Rechnung - z.B. Kapitalfluss aus laufender Geschäftstätigkeit - und Rentabilitätskennzahlen - z.B. Eigenkapitalrentabilität und Umsatzrendite - analysiert. Ergänzend fließen Bewertungskennzahlen - z.B. Kurs-Gewinn-Verhältnis, Dividendenrendite - sowie die qualitative Beurteilung der Unternehmen - z.B. der Qualität der Produkte und des Geschäftsmodells des Unternehmens - in die Bewertung ein. Darüber hinaus werden bewertungstüchtig volkswirtschaftliche Daten - z.B. Zinsen und Industrieproduktion - analysiert und Schlussfolgerungen zur Attraktivität von Aktienmärkten und Industriegruppen gezogen. Die aus den aufgeführten Kennzahlen und volkswirtschaftlichen Daten gewonnenen Erkenntnisse bilden die Grundlage für das Management dieses Aktienfonds. Um den Erfolg des Aktienauswahlprozesses zu bewerten sowie die erfolgsbezogene Vergütung für die Anteilklasse CF zu berechnen, wird der HDAX Total Return Index in EUR<sup>1)</sup> verwendet. Die initiale und kontinuierliche Wertpapierauswahl erfolgt im Rahmen des beschriebenen Investmentansatzes unabhängig von diesem Referenzwert und damit verbundenen quantitativen oder qualitativen Einschränkungen.

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.

### Wichtige Kennzahlen

#### DekaFonds

| Performance*    | 6 Monate |
|-----------------|----------|
| Anteilklasse CF | 13,0%    |
| Anteilklasse TF | 12,6%    |
| Anteilklasse AV | 13,0%    |

#### ISIN

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| Anteilklasse CF | DE0008474503 |
| Anteilklasse TF | DE000DK2D7T7 |
| Anteilklasse AV | DE000DK2J829 |

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

1) Referenzindex: 100% HDAX Total Return Index in EUR® Die Bezeichnung HDAX Total Return Index in EUR® ist eine eingetragene Marke der Deutsche Börse AG (der Lizenzgeber). Die auf dem Index basierenden Finanzinstrumente werden vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung des Index stellt keine Empfehlung des Lizenzgebers zur Kapitalanlage dar oder beinhaltet in irgendeiner Weise eine Zusicherung des Lizenzgebers hinsichtlich einer Attraktivität einer Investition in entsprechende Produkte.

# Anteilklassen im Überblick.

Für den DekaFonds können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung\*, der Vertriebsvergütung\*\*, der erfolgsabhängigen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von drei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung, der erfolgsabhängigen Vergütung und der Mindestanlagesumme sowie der Vertriebsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung CF, TF und AV. Anteile, die bis zum 15. März 2009 unter der Bezeichnung „DekaFonds“ begeben wurden, werden seit dem 16. März 2009 der Anteilklasse „CF“ zugeordnet.

Die Anteilklasse AV ist für den Einsatz in zertifizierten Altersvorsorge-Sondervermögen der Deka-Gruppe sowie in solchen allokierten Investmentvermögen (Zielfonds) vorgesehen. Die Mindestanlagesumme bei der Anlage in Anteile der Anteilklasse AV beträgt 5.000 Euro. Es steht der Gesellschaft frei, einen niedrigeren Zeichnungsbetrag zu akzeptieren.

Die Verwaltungsgesellschaft kann für die Verwaltung des Fondsvermögens, das den Anteilklassen CF und TF zuzuordnen ist, je ausgegebenem Anteil eine erfolgsabhängige Vergütung in Höhe von bis zu 25 Prozent des Anteiles der Wertentwicklung des Fonds, der über der als Vergleichsmaßstab herangezogenen Wertentwicklung des HDAX Total Return Index in EUR® liegt, erhalten. Für die Anteilklasse AV wird keine erfolgsbezogene Vergütung erhoben.

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

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

## Anteilklassen im Überblick

|                   | Verwaltungsvergütung* | Ausgabeaufschlag | Mindestanlagesumme | Ertragsverwendung |
|-------------------|-----------------------|------------------|--------------------|-------------------|
| Anteilklasse CF   | 1,25% p.a.            | 5,26%            | keine              | Ausschüttung      |
| Anteilklasse TF** | 1,97% p.a.            | keiner           | keine              | Ausschüttung      |
| Anteilklasse AV   | 1,26% p.a.            | keiner           | EUR 5.000          | Ausschüttung      |

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

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

# DekaFonds

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023.

| Gliederung nach Anlageart - Land                            | Kurswert<br>in EUR      | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|-------------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                         |                              |
| <b>1. Aktien</b>  | <b>4.844.128.908,00</b> | <b>96,29</b>                 |
| Deutschland   | 4.262.600.522,44        | 84,71                        |
| Frankreich  | 172.453.937,40          | 3,44                         |
| Irland  | 7.256.040,00            | 0,14                         |
| Italien   | 11.304.000,00           | 0,22                         |
| Luxemburg   | 13.681.024,94           | 0,28                         |
| Niederlande   | 367.389.353,12          | 7,31                         |
| Schweiz   | 9.444.030,10            | 0,19                         |
| <b>2. Derivate</b>  | <b>10.151.250,00</b>    | <b>0,20</b>                  |
| <b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>170.313.422,25</b>   | <b>3,39</b>                  |
| <b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>17.420.808,56</b>    | <b>0,35</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-11.758.840,61</b>   | <b>-0,23</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>5.030.255.548,20</b> | <b>100,00</b>                |

| Gliederung nach Anlageart - Währung                         | Kurswert<br>in EUR      | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|-------------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                         |                              |
| <b>1. Aktien</b>  | <b>4.844.128.908,00</b> | <b>96,29</b>                 |
| CHF   | 9.444.030,10            | 0,19                         |
| EUR   | 4.834.684.877,90        | 96,10                        |
| <b>2. Derivate</b>  | <b>10.151.250,00</b>    | <b>0,20</b>                  |
| <b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>170.313.422,25</b>   | <b>3,39</b>                  |
| <b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>17.420.808,56</b>    | <b>0,35</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-11.758.840,61</b>   | <b>-0,23</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>5.030.255.548,20</b> | <b>100,00</b>                |

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

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023.

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs        | Kurswert in EUR         | % des Fondsvermögens *) |
|-------------------------------------|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |  |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>4.844.128.908,00</b> | <b>96,29</b>            |
| <b>Aktien</b>                       |  |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>4.844.128.908,00</b> | <b>96,29</b>            |
| <b>EUR</b>                          |  |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>4.834.684.877,90</b> | <b>96,10</b>            |
| DE000A3CNK42                        | ABOUT YOU Holding SE Inhaber-Aktien                          | STK   |                              | 827.100            | 0                                  | 0                 | EUR 4,664   | 3.857.594,40            | 0,08                    |
| DE000A1EWWWO                        | adidas AG Namens-Aktien                                      | STK   |                              | 322.500            | 65.000                             | 0                 | EUR 177,280 | 57.172.800,00           | 1,14                    |
| FR0000120073                        | Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port.                 | STK   |                              | 264.000            | 100.000                            | 364.000           | EUR 164,980 | 43.554.720,00           | 0,87                    |
| NL0000235190                        | Airbus SE Aandelen op naam                                   | STK   |                              | 1.864.050          | 245.000                            | 415.000           | EUR 131,840 | 245.756.352,00          | 4,88                    |
| DE0008404005                        | Allianz SE vink.Namens-Aktien                                | STK   |                              | 1.538.600          | 411.000                            | 75.000            | EUR 213,850 | 329.029.610,00          | 6,53                    |
| FR0010220475                        | Alstom S.A. Actions Porteur <sup>1)</sup>                    | STK   |                              | 1.121.762          | 485.000                            | 100.000           | EUR 27,240  | 30.556.796,88           | 0,61                    |
| NL0011872643                        | ASR Nederland N.V. Aandelen op naam                          | STK   |                              | 267.710            | 75.000                             | 0                 | EUR 40,880  | 10.943.984,80           | 0,22                    |
| DE000BASF111                        | BASF SE Namens-Aktien  | STK   |                              | 315.000            | 0                                  | 1.285.000         | EUR 44,360  | 13.973.400,00           | 0,28                    |
| DE000BAY0017                        | Bayer AG Namens-Aktien                                       | STK   |                              | 3.895.000          | 860.000                            | 240.000           | EUR 50,860  | 198.099.700,00          | 3,94                    |
| DE0005190003                        | Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien                      | STK   |                              | 164.000            | 150.000                            | 125.000           | EUR 112,340 | 18.423.760,00           | 0,37                    |
| DE0005190037                        | Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien                    | STK   |                              | 280.000            | 0                                  | 0                 | EUR 103,600 | 29.008.000,00           | 0,58                    |
| DE0005158703                        | Bechtle AG Inhaber-Aktien                                    | STK   |                              | 165.000            | 165.000                            | 0                 | EUR 36,150  | 5.964.750,00            | 0,12                    |
| LU1704650164                        | BEFESA S.A. Actions  | STK   |                              | 257.591            | 0                                  | 25.000            | EUR 34,340  | 8.845.674,94            | 0,18                    |
| DE0005200000                        | Beiersdorf AG Inhaber-Aktien <sup>1)</sup>                   | STK   |                              | 265.000            | 30.000                             | 80.000            | EUR 121,000 | 32.065.000,00           | 0,64                    |
| DE000A1DAH00                        | Brenntag SE Namens-Aktien                                    | STK   |                              | 1.192.000          | 130.000                            | 80.000            | EUR 70,820  | 84.417.440,00           | 1,68                    |
| DE000CBK1001                        | Commerzbank AG Inhaber-Aktien                                | STK   |                              | 4.179.900          | 0                                  | 1.250.000         | EUR 10,160  | 42.467.784,00           | 0,84                    |
| DE000A288904                        | CompuGroup Medical SE &Co.KGaA Namens-Aktien                 | STK   |                              | 292.900            | 190.000                            | 0                 | EUR 45,160  | 13.227.364,00           | 0,26                    |
| DE0005439004                        | Continental AG Inhaber-Aktien                                | STK   |                              | 80.000             | 150.000                            | 70.000            | EUR 68,900  | 5.512.000,00            | 0,11                    |
| DE0006062144                        | Covestro AG Inhaber-Aktien <sup>1)</sup>                     | STK   |                              | 916.820            | 485.000                            | 160.000           | EUR 47,540  | 43.585.622,80           | 0,87                    |
| DE000DTR0CK8                        | Daimler Truck Holding AG Namens-Aktien                       | STK   |                              | 688.499            | 0                                  | 330.000           | EUR 33,040  | 22.748.006,96           | 0,45                    |
| DE000A2E4K43                        | Delivery Hero SE Namens-Aktien                               | STK   |                              | 677.000            | 425.000                            | 445.000           | EUR 39,120  | 26.484.240,00           | 0,53                    |
| DE0005140008                        | Deutsche Bank AG Namens-Aktien                               | STK   |                              | 7.825.400          | 3.050.000                          | 4.050.000         | EUR 9,650   | 75.515.110,00           | 1,50                    |
| DE0005810055                        | Deutsche Börse AG Namens-Aktien                              | STK   |                              | 590.050            | 70.000                             | 127.000           | EUR 168,950 | 99.688.947,50           | 1,98                    |
| DE0008232125                        | Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien                     | STK   |                              | 1.500.000          | 1.500.000                          | 0                 | EUR 9,454   | 14.181.000,00           | 0,28                    |
| DE0005552004                        | Deutsche Post AG Namens-Aktien <sup>1)</sup>                 | STK   |                              | 4.165.000          | 570.000                            | 75.000            | EUR 44,965  | 187.279.225,00          | 3,72                    |
| DE0005557508                        | Deutsche Telekom AG Namens-Aktien <sup>1)</sup>              | STK   |                              | 11.625.000         | 2.350.000                          | 960.000           | EUR 20,070  | 233.313.750,00          | 4,64                    |
| DE000PAG9113                        | Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG Inh.-Vorzugs.o.St.               | STK   |                              | 183.400            | 0                                  | 0                 | EUR 113,050 | 20.733.370,00           | 0,41                    |
| DE000ENAG999                        | E.ON SE Namens-Aktien  | STK   |                              | 11.395.500         | 1.400.000                          | 750.000           | EUR 11,665  | 132.928.507,50          | 2,64                    |
| DE000EVNK013                        | Evonik Industries AG Namens-Aktien                           | STK   |                              | 1.074.800          | 75.000                             | 375.000           | EUR 17,300  | 18.594.040,00           | 0,37                    |
| DE0005664809                        | Evotec SE Inhaber-Aktien                                     | STK   |                              | 915.000            | 0                                  | 0                 | EUR 20,460  | 18.720.900,00           | 0,37                    |
| FR0000121147                        | Forvia SE Actions Port.                                      | STK   |                              | 672.500            | 250.000                            | 0                 | EUR 21,630  | 14.546.175,00           | 0,29                    |
| DE0005773303                        | Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG Inhaber-Aktien                 | STK   |                              | 361.000            | 0                                  | 0                 | EUR 49,160  | 17.746.760,00           | 0,35                    |
| DE0005785802                        | Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien                   | STK   |                              | 990.000            | 990.000                            | 0                 | EUR 43,630  | 43.193.700,00           | 0,86                    |
| DE0005785604                        | Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien                  | STK   |                              | 700.000            | 0                                  | 370.000           | EUR 25,230  | 17.661.000,00           | 0,35                    |
| DE000A3E5D64                        | FUCHS PETROLUB SE Namens-Vorzugsakt.                         | STK   |                              | 790.815            | 0                                  | 0                 | EUR 35,740  | 28.263.728,10           | 0,56                    |
| DE0006602006                        | GEA Group AG Inhaber-Aktien                                  | STK   |                              | 1.025.000          | 1.025.000                          | 0                 | EUR 38,240  | 39.196.000,00           | 0,78                    |
| DE000A0LD6E6                        | Gerresheimer AG Inhaber-Aktien <sup>2)</sup>                 | STK   |                              | 931.400            | 50.000                             | 0                 | EUR 103,000 | 95.934.200,00           | 1,91                    |
| DE0006047004                        | Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien                       | STK   |                              | 255.000            | 255.000                            | 0                 | EUR 75,260  | 19.191.300,00           | 0,38                    |
| DE000A161408                        | HelloFresh SE Inhaber-Aktien                                 | STK   |                              | 2.410.145          | 1.280.344                          | 200.000           | EUR 22,290  | 53.722.132,05           | 1,07                    |
| DE000A1PHFF7                        | HUGO BOSS AG Namens-Aktien                                   | STK   |                              | 300.000            | 120.000                            | 0                 | EUR 70,860  | 21.258.000,00           | 0,42                    |
| DE0006231004                        | Infineon Technologies AG Namens-Aktien                       | STK   |                              | 4.474.670          | 1.000.000                          | 275.000           | EUR 37,095  | 165.987.883,65          | 3,30                    |
| DE000A2NBX80                        | Instone Real Estate Group SE Inhaber-Aktien                  | STK   |                              | 1.084.333          | 0                                  | 0                 | EUR 5,420   | 5.877.084,86            | 0,12                    |
| DE000A3E00M1                        | IONOS Group SE Namens-Aktien                                 | STK   |                              | 1.115.100          | 1.115.100                          | 0                 | EUR 13,180  | 14.697.018,00           | 0,29                    |
| DE000A2NB601                        | JENOPTIK AG Namens-Aktien                                    | STK   |                              | 355.000            | 0                                  | 0                 | EUR 31,300  | 11.111.500,00           | 0,22                    |
| DE0006219934                        | Junghheinrich AG Inhaber-Vorzugsaktien                       | STK   |                              | 150.000            | 0                                  | 0                 | EUR 33,360  | 5.004.000,00            | 0,10                    |
| DE000KSAG888                        | K+S Aktiengesellschaft Namens-Aktien                         | STK   |                              | 610.000            | 0                                  | 670.000           | EUR 15,970  | 9.741.700,00            | 0,19                    |
| DE000KGX8881                        | KION GROUP AG Inhaber-Aktien                                 | STK   |                              | 463.224            | 90.000                             | 560.000           | EUR 36,580  | 16.944.733,92           | 0,34                    |
| DE000KBX1006                        | Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien                               | STK   |                              | 452.000            | 225.000                            | 0                 | EUR 69,460  | 31.395.920,00           | 0,62                    |
| DE0005470405                        | Lanxess AG Inhaber-Aktien                                    | STK   |                              | 1.406.000          | 0                                  | 450.000           | EUR 27,880  | 39.199.280,00           | 0,78                    |
| DE000LEG1110                        | LEG Immobilien SE Namens-Aktien                              | STK   |                              | 535.000            | 535.000                            | 0                 | EUR 52,620  | 28.151.700,00           | 0,56                    |
| DE0007100000                        | Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien <sup>1)</sup>           | STK   |                              | 2.994.300          | 505.000                            | 260.700           | EUR 73,720  | 220.739.796,00          | 4,39                    |
| DE0006599905                        | Merck KGaA Inhaber-Aktien                                    | STK   |                              | 609.000            | 0                                  | 25.000            | EUR 149,650 | 91.136.850,00           | 1,81                    |
| DE0006632003                        | MorphoSys AG Inhaber-Aktien                                  | STK   |                              | 39.100             | 0                                  | 0                 | EUR 26,890  | 1.051.399,00            | 0,02                    |
| DE000A0D9PT0                        | MTU Aero Engines AG Namens-Aktien                            | STK   |                              | 275.000            | 168.000                            | 0                 | EUR 236,700 | 65.092.500,00           | 1,29                    |
| DE0008430026                        | Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien <sup>1)</sup> | STK   |                              | 541.600            | 60.000                             | 158.400           | EUR 343,800 | 186.202.080,00          | 3,70                    |
| DE000PAH0038                        | Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien           | STK   |                              | 1.225.000          | 160.000                            | 0                 | EUR 55,520  | 68.012.000,00           | 1,35                    |
| IT0004176001                        | Prisma S.p.A. Azioni nom.                                    | STK   |                              | 300.000            | 0                                  | 335.000           | EUR 37,680  | 11.304.000,00           | 0,22                    |
| DE0006969603                        | PUMA SE Inhaber-Aktien                                       | STK   |                              | 745.020            | 255.000                            | 140.000           | EUR 54,740  | 40.782.394,80           | 0,81                    |
| NL0012169213                        | Qiagen N.V. Aandelen op naam <sup>1)</sup>                   | STK   |                              | 1.794.944          | 960.000                            | 0                 | EUR 40,780  | 73.197.816,32           | 1,46                    |
| DE0007030009                        | Rheinmetall AG Inhaber-Aktien <sup>1) 2)</sup>               | STK   |                              | 184.500            | 0                                  | 55.000            | EUR 249,200 | 45.977.400,00           | 0,91                    |
| DE0007037129                        | RWE AG Inhaber-Aktien  | STK   |                              | 2.992.420          | 50.000                             | 0                 | EUR 39,920  | 119.457.406,40          | 2,37                    |
| DE0007164600                        | SAP SE Inhaber-Aktien  | STK   |                              | 3.023.000          | 437.500                            | 85.000            | EUR 123,880 | 374.489.240,00          | 7,43                    |

# DekaFonds

| ISIN   | Gattungsbezeichnung                           | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs        | Kurswert in EUR             | % des Fondsvermögens *) |              |
|--|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-------------|-----------------------------|-------------------------|--------------|
| DE0007165631   | Sartorius AG Vorzugsaktien <sup>1)</sup>      | STK   |                              | 98.500             | 0                                  | 4.000             | EUR 310,600 | 30.594.100,00               | 0,61                    |              |
| FR0010411983   | SCOR SE Actions au Porteur                    | STK   |                              | 2.440.737          | 200.000                            | 34.263            | EUR 26,960  | 65.802.269,52               | 1,31                    |              |
| DE0007236101   | Siemens AG Namens-Aktien                      | STK   |                              | 2.119.000          | 216.000                            | 170.000           | EUR 152,560 | 323.274.640,00              | 6,42                    |              |
| DE000ENER6Y0   | Siemens Energy AG Namens-Aktien <sup>1)</sup> | STK   |                              | 3.302.900          | 1.972.900                          | 0                 | EUR 16,250  | 53.672.125,00               | 1,07                    |              |
| DE000SHL1006   | Siemens Healthineers AG Namens-Aktien         | STK   |                              | 742.950            | 0                                  | 190.000           | EUR 51,940  | 38.588.823,00               | 0,77                    |              |
| DE0007231334   | Sixt SE Inhaber-Vorzugsaktien                 | STK   |                              | 132.700            | 0                                  | 0                 | EUR 70,600  | 9.368.620,00                | 0,19                    |              |
| IE00B1RR8406   | Smurfit Kappa Group PLC Reg.Shares            | STK   |                              | 239.000            | 0                                  | 0                 | EUR 30,360  | 7.256.040,00                | 0,14                    |              |
| NL00150001Q9   | Stellantis N.V Aandelen op naam               | STK   |                              | 2.320.000          | 2.320.000                          | 0                 | EUR 16,160  | 37.491.200,00               | 0,75                    |              |
| DE0007493991   | Ströer SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien           | STK   |                              | 513.364            | 0                                  | 0                 | EUR 44,640  | 22.916.568,96               | 0,46                    |              |
| LU2333210958   | SUSE S.A. Actions Nominatives                 | STK   |                              | 371.950            | 0                                  | 457.000           | EUR 13,000  | 4.835.350,00                | 0,10                    |              |
| DE000SYM9999   | Symrise AG Inhaber-Aktien                     | STK   |                              | 300.000            | 100.000                            | 95.000            | EUR 95,240  | 28.572.000,00               | 0,57                    |              |
| DE000A2TSL71   | SYNLAB AG Inhaber-Aktien                      | STK   |                              | 1.116.724          | 0                                  | 0                 | EUR 9,295   | 10.379.949,58               | 0,21                    |              |
| DE000TLX1005   | Talanx AG Namens-Aktien                       | STK   |                              | 907.666            | 0                                  | 95.000            | EUR 52,400  | 47.561.698,40               | 0,95                    |              |
| DE000A2YN900   | TeamViewer SE Inhaber-Aktien                  | STK   |                              | 2.215.000          | 0                                  | 310.000           | EUR 14,605  | 32.350.075,00               | 0,64                    |              |
| FR0013447729   | Verallia SA Actions Port. (Prom.)             | STK   |                              | 524.300            | 0                                  | 0                 | EUR 34,320  | 17.993.976,00               | 0,36                    |              |
| DE000VTSC017   | Vitesco Technologies Group AG Namens-Aktien   | STK   |                              | 224.872            | 0                                  | 12.000            | EUR 74,650  | 16.786.694,80               | 0,33                    |              |
| DE000A1ML7J1   | Vonovia SE Namens-Aktien                      | STK   |                              | 1.934.348          | 0                                  | 1.461.000         | EUR 17,870  | 34.566.798,76               | 0,69                    |              |
| DE000WCH8881   | Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien               | STK   |                              | 78.000             | 155.000                            | 77.000            | EUR 125,100 | 9.757.800,00                | 0,19                    |              |
| <b>CHF</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>9.444.030,10</b>         | <b>0,19</b>             |              |
| CH1110425654   | Montana Aerospace AG Namens-Aktien            | STK   |                              | 644.100            | 0                                  | 0                 | CHF 14,320  | 9.444.030,10                | 0,19                    |              |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 4.844.128.908,00</b> | <b>96,29</b>            |              |
| <b>Derivate</b><br>(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| <b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| <b>Wertpapier-Optionsrechte</b><br>Forderungen/ Verbindlichkeiten  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             | <b>-6.512.400,00</b>    | <b>-0,12</b> |
| <b>Optionsrechte auf Aktien</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             | <b>-6.512.400,00</b>    | <b>-0,12</b> |
| Daimler AG (MBG) Call Aug. 23 73   |   | XEUR  | STK                          | 560.000            |                                    |                   | EUR 2,985   | 1.671.600,00                | 0,03                    |              |
| Gerresheimer AG (GX1) Call Dez. 23 92  |   | XEUR  | STK                          | -300.000           |                                    |                   | EUR 17,050  | -5.115.000,00               | -0,10                   |              |
| Gerresheimer AG (GX1) Put Dez. 23 76   |   | XEUR  | STK                          | -300.000           |                                    |                   | EUR 1,850   | -555.000,00                 | -0,01                   |              |
| HelloFresh SE (HFG) Call Sep. 23 20  |   | XEUR  | STK                          | 100.000            |                                    |                   | EUR 3,625   | 362.500,00                  | 0,01                    |              |
| HelloFresh SE (HFG) Put Dez. 23 18   |   | XEUR  | STK                          | -100.000           |                                    |                   | EUR 1,525   | -152.500,00                 | 0,00                    |              |
| MorphoSys Aktiengesellschaft (MOR) Put Sep. 23 32  |   | XEUR  | STK                          | -280.000           |                                    |                   | EUR 5,700   | -1.596.000,00               | -0,03                   |              |
| Porsche Autom. (PAH3) Call Sep. 23 60  |   | XEUR  | STK                          | 150.000            |                                    |                   | EUR 0,470   | 70.500,00                   | 0,00                    |              |
| Rheinmetall AG (RHM) Call Dez. 23 320  |   | XEUR  | STK                          | -100.000           |                                    |                   | EUR 5,175   | -517.500,00                 | -0,01                   |              |
| Rheinmetall AG (RHM) Put Dez. 23 220   |   | XEUR  | STK                          | -100.000           |                                    |                   | EUR 11,500  | -1.150.000,00               | -0,02                   |              |
| SAP SE (SAP) Call Aug. 23 126  |   | XEUR  | STK                          | 200.000            |                                    |                   | EUR 2,670   | 534.000,00                  | 0,01                    |              |
| SCOR SE (SDRC) Put Dez. 23 22  |   | XEUR  | STK                          | -100.000           |                                    |                   | EUR 0,650   | -65.000,00                  | 0,00                    |              |
| <b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>13.013.650,00</b>        | <b>0,25</b>             |              |
| <b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktien</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>13.013.650,00</b>        | <b>0,25</b>             |              |
| Infineon Technologies AG Future (IFXG) Okt. 23   |   | XEUR  | EUR                          | Anzahl 10.000      |                                    |                   |             | 4.034.600,00                | 0,08                    |              |
| SAP SE Future (SAP) Nov. 23  |   | XEUR  | EUR                          | Anzahl 6.750       |                                    |                   |             | 5.215.050,00                | 0,10                    |              |
| Siemens AG Future (SIEH) Okt. 23   |   | XEUR  | EUR                          | Anzahl 4.000       |                                    |                   |             | 3.764.000,00                | 0,07                    |              |
| <b>Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 6.501.250,00</b>     | <b>0,13</b>             |              |
| <b>Aktienindex-Derivate</b><br>Forderungen/ Verbindlichkeiten  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| <b>Optionsrechte</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>3.650.000,00</b>         | <b>0,07</b>             |              |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>3.650.000,00</b>         | <b>0,07</b>             |              |
| DAX-Index (DAX) Put Sep. 23 14000  |   | XEUR  |                              | Anzahl -10.000     |                                    |                   | EUR 48,500  | -2.425.000,00               | -0,05                   |              |
| DAX-Index (DAX) Put Sep. 23 15900  |   | XEUR  |                              | Anzahl 4.500       |                                    |                   | EUR 270,000 | 6.075.000,00                | 0,12                    |              |
| <b>Summe Aktienindex-Derivate</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 3.650.000,00</b>     | <b>0,07</b>             |              |
| <b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| <b>Bankguthaben</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| <b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale   |   |       | EUR                          | 144.190.641,18     |                                    |                   | % 100,000   | 144.190.641,18              | 2,87                    |              |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale   |   |       | CHF                          | 57.457,36          |                                    |                   | % 100,000   | 58.831,07                   | 0,00                    |              |
| <b>Summe Bankguthaben</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 144.249.472,25</b>   | <b>2,87</b>             |              |
| <b>Geldmarktfonds</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| <b>Gruppeneigene Geldmarktfonds</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>26.063.950,00</b>        | <b>0,52</b>             |              |
| LU0052863874   | DekaLux-Geldmarkt: EURO                       |       | ANT                          | 550.000,00         | 600.000                            | 50.000            | EUR 47,389  | 26.063.950,00               | 0,52                    |              |
| <b>Summe Geldmarktfonds</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 26.063.950,00</b>    | <b>0,52</b>             |              |
| <b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 170.313.422,25</b>   | <b>3,39</b>             |              |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                             |                         |              |
| Dividendenansprüche  |   |       | EUR                          | 273.690,44         |                                    |                   |             | 273.690,44                  | 0,01                    |              |
| Einschüsse (Initial Margins)   |   |       | EUR                          | 15.801.364,00      |                                    |                   |             | 15.801.364,00               | 0,31                    |              |
| Forderungen aus Wertpapier-Darlehen  |   |       | EUR                          | 14.927,73          |                                    |                   |             | 14.927,73                   | 0,00                    |              |
| Forderungen aus Anteilscheingeschäften   |   |       | EUR                          | 868.299,64         |                                    |                   |             | 868.299,64                  | 0,02                    |              |
| Forderungen aus Kapitalmaßnahmen   |   |       | EUR                          | 185.234,00         |                                    |                   |             | 185.234,00                  | 0,00                    |              |
| Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung  |   |       | EUR                          | 277.292,75         |                                    |                   |             | 277.292,75                  | 0,01                    |              |
| <b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 17.420.808,56</b>    | <b>0,35</b>             |              |



# DekaFonds

| ISIN                              | Gattungsbezeichnung                           | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR         | % des Fondsvermögens *) |
|-----------------------------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b> |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                         |                         |
|                                   | Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen     |       | EUR                          | -4.926,17          |                                    |                   |            | -4.926,17               | 0,00                    |
|                                   | Verbindlichkeiten aus Anteilschneidgeschäften |       | EUR                          | -846.537,78        |                                    |                   |            | -846.537,78             | -0,02                   |
|                                   | Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften    |       | EUR                          | -4.662.315,25      |                                    |                   |            | -4.662.315,25           | -0,09                   |
|                                   | Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten  |       | EUR                          | -6.245.061,41      |                                    |                   |            | -6.245.061,41           | -0,12                   |
|                                   | <b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>       |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>-11.758.840,61</b>   | <b>-0,23</b>            |
| <b>Fondsvermögen</b>              |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                         |                         |
|                                   | <b>Umlaufende Anteile Klasse CF</b>           |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>5.030.255.548,20</b> | <b>100,00</b>           |
|                                   | <b>Umlaufende Anteile Klasse TF</b>           |       |                              |                    |                                    |                   | <b>STK</b> | <b>38.536.117,000</b>   |                         |
|                                   | <b>Umlaufende Anteile Klasse AV</b>           |       |                              |                    |                                    |                   | <b>STK</b> | <b>1.563.273,000</b>    |                         |
|                                   | <b>Anteilwert Klasse CF</b>                   |       |                              |                    |                                    |                   | <b>STK</b> | <b>100,000</b>          |                         |
|                                   | <b>Anteilwert Klasse TF</b>                   |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>118,83</b>           |                         |
|                                   | <b>Anteilwert Klasse AV</b>                   |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>288,61</b>           |                         |
|                                   |   |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>122,04</b>           |                         |

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

- <sup>1)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.  
<sup>2)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäftes in Wertpapieren.

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Nominal in Währung | Wertpapier-Darlehen in EUR |                      | gesamt               |
|--|-------------------------------|----------------------------|----------------------|----------------------|
|  |                               | befristet                  | unbefristet          |                      |
| <b>Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)</b>                        |                               |                            |                      |                      |
| Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: |                               |                            |                      |                      |
| Alstom S.A. Actions Porteur  | STK 551.214                   |                            | 15.015.069,36        |                      |
| Beiersdorf AG Inhaber-Aktien   | STK 4.000                     |                            | 484.000,00           |                      |
| Covestro AG Inhaber-Aktien   | STK 105.349                   |                            | 5.008.291,46         |                      |
| Deutsche Post AG Namens-Aktien   | STK 3.994                     |                            | 179.590,21           |                      |
| Deutsche Telekom AG Namens-Aktien  | STK 90.194                    |                            | 1.810.193,58         |                      |
| Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien   | STK 71.083                    |                            | 5.240.238,76         |                      |
| Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien                                     | STK 10.600                    |                            | 3.644.280,00         |                      |
| Qiagen N.V. Aandelen op naam   | STK 53.249                    |                            | 2.171.494,22         |                      |
| Rheinmetall AG Inhaber-Aktien  | STK 6.600                     |                            | 1.644.720,00         |                      |
| Sartorius AG Vorzugsaktien   | STK 21.810                    |                            | 6.774.186,00         |                      |
| Siemens Energy AG Namens-Aktien  | STK 708.586                   |                            | 11.514.522,50        |                      |
| <b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>          | <b>EUR</b>                    |                            | <b>53.486.586,09</b> | <b>53.486.586,09</b> |

**Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2023**  
 Schweiz, Franken (CHF) 0,97665 = 1 Euro (EUR)

**Marktschlüssel**  
**Terminbörsen**  
 XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

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

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung                        | Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|-------------------------------------|--|---|----------------|-------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |  |   |                |                   |
| <b>Aktien</b>                       |  |   |                |                   |
| <b>EUR</b>                          |  |   |                |                   |
| DE0006048432                        | Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien | STK                                     | 0              | 220.000           |
| NL0010773842                        | NN Group N.V. Aandelen aan toonder         | STK                                     | 0              | 200.000           |
| FR0000120271                        | TotalEnergies SE Actions au Porteur        | STK                                     | 550.000        | 550.000           |
| DE0007664039                        | Volkswagen AG Vorzugsaktien                | STK                                     | 300.000        | 517.000           |
| DE000ZAL1111                        | Zalando SE Inhaber-Aktien                  | STK                                     | 0              | 100.000           |
| <b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>    |  |   |                |                   |
| <b>Aktien</b>                       |  |   |                |                   |
| <b>EUR</b>                          |  |   |                |                   |
| IE00BZ12WP82                        | Linde PLC Reg.Shares                       | STK                                     | 0              | 1.096.500         |

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000 |
|--|------------------------------|------------------|
| <b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b> |                              |                  |
| <b>Terminkontrakte</b>   |                              |                  |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>   |                              |                  |
| <b>Gekaufte Kontrakte:</b>   | <b>EUR</b>                   | <b>240.525</b>   |
| (Basiswert(e): DAX Performance-Index)  |                              |                  |
| <b>Verkaufte Kontrakte:</b>  | <b>EUR</b>                   | <b>1.139.782</b> |

| Gattungsbezeichnung   | Stück bzw.<br>Anteile bzw. Whg. | Volumen<br>in 1.000 |
|---|---------------------------------|---------------------|
| (Basiswert(e): DAX Performance-Index)   |                                 |                     |
| <b>Optionsrechte</b>  |                                 |                     |
| <b>Wertpapier-Optionsrechte</b>   |                                 |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktien</b>   |                                 |                     |
| <b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b><br>(Basiswert(e): Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port., E.ON SE Namens-Aktien, Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien, Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien, SAP SE Inhaber-Aktien, Volkswagen AG Vorzugsaktien)   | <b>EUR</b>                      | <b>146.100</b>      |
| <b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b><br>(Basiswert(e): Linde PLC Reg.Shares)   | <b>EUR</b>                      | <b>60.000</b>       |
| <b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b><br>(Basiswert(e): SAP SE Inhaber-Aktien)   | <b>EUR</b>                      | <b>26.000</b>       |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>   |                                 |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>  |                                 |                     |
| <b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b><br>(Basiswert(e): DAX Performance-Index)  | <b>EUR</b>                      | <b>1.338.750</b>    |
| <b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b><br>(Basiswert(e): DAX Performance-Index)  | <b>EUR</b>                      | <b>460.000</b>      |
| <b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b><br>(Basiswert(e): DAX Performance-Index)   | <b>EUR</b>                      | <b>420.000</b>      |
| <b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>   |                                 |                     |
| <b>unbefristet</b>  | <b>EUR</b>                      | <b>2.387.078</b>    |
| (Basiswert(e): adidas AG Namens-Aktien, Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port., Airbus SE Aandelen op naam, Allianz SE vink.Namens-Aktien, Alstom S.A. Actions Porteur, ASR Nederland N.V. Aandelen op naam, BASF SE Namens-Aktien, Bayer AG Namens-Aktien, Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien, Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien, Bechtle AG Inhaber-Aktien, Beiersdorf AG Inhaber-Aktien, Brenntag SE Namens-Aktien, CompuGroup Medical SE &Co.KGaA Namens-Aktien, Covestro AG Inhaber-Aktien, Daimler Truck Holding AG Namens-Aktien, Delivery Hero SE Namens-Aktien, Deutsche Bank AG Namens-Aktien, Deutsche Börse AG Namens-Aktien, Deutsche Post AG Namens-Aktien, Deutsche Telekom AG Namens-Aktien, Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG Inh.-Vorzugs. o.St., E.ON SE Namens-Aktien, Evonik Industries AG Namens-Aktien, Evotec SE Inhaber-Aktien, Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG Inhaber-Aktien, FUCHS PETROLUB SE Namens-Vorzugsakt., Gerresheimer AG Inhaber-Aktien, Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien, HelloFresh SE Inhaber-Aktien, Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien, HUGO BOSS AG Namens-Aktien, JENOPTIK AG Namens-Aktien, Jungheinrich AG Inhaber-Vorzugsaktien, KION GROUP AG Inhaber-Aktien, Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien, Linde PLC Reg.Shares, Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien, Merck KGaA Inhaber-Aktien, MorphoSys AG Inhaber-Aktien, MTU Aero Engines AG Namens-Aktien, Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien, Prysmian S.p.A. Azioni nom., PUMA SE Inhaber-Aktien, Qiagen N.V. Aandelen op naam, Rheinmetall AG Inhaber-Aktien, SAP SE Inhaber-Aktien, Sartorius AG Vorzugsaktien, Siemens AG Namens-Aktien, Siemens Energy AG Namens-Aktien, Siemens Healthineers AG Namens-Aktien, Sixt SE Inhaber-Vorzugsaktien, Ströer SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien, Symrise AG Inhaber-Aktien, TotalEnergies SE Actions au Porteur, Vonovia SE Namens-Aktien, Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien, Zalando SE Inhaber-Aktien) |                                 |                     |

# DekaFonds

## Anhang.

|                              |     |            |
|------------------------------|-----|------------|
| Umlaufende Anteile Klasse CF | STK | 38.536.117 |
| Umlaufende Anteile Klasse TF | STK | 1.563.273  |
| Umlaufende Anteile Klasse AV | STK | 100        |
| Anteilwert Klasse CF         | EUR | 118,83     |
| Anteilwert Klasse TF         | EUR | 288,61     |
| Anteilwert Klasse AV         | EUR | 122,04     |

### 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.

### Angaben zu erfolgsbezogenen Vergütungen:

Anteilklasse CF

Dem Sondervermögen im Berichtszeitraum berechnete erfolgsbezogene Vergütungen: EUR 0,00

Dies entspricht bezogen auf den durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens: 0,00%

Anteilklasse TF

Dem Sondervermögen im Berichtszeitraum berechnete erfolgsbezogene Vergütungen: EUR 0,00

Dies entspricht bezogen auf den durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens: 0,00%

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

#### Verwendete Vermögensgegenstände

| Wertpapier-Darlehen (besichert) | Marktwert in EUR | in % des Fondsvermögens |
|---------------------------------|------------------|-------------------------|
| Aktien                          | 53.486.586,09    | 1,06                    |

#### 10 größte Gegenparteien

| Wertpapier-Darlehen (besichert) | Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR | Sitzstaat   |
|---------------------------------|---------------------------------------|-------------|
| DekaBank Deutsche Girozentrale  | 53.486.586,09                         | Deutschland |

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

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

#### Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

| Wertpapier-Darlehen (besichert) | absolute Beträge in EUR |
|---------------------------------|-------------------------|
| unbefristet                     | 53.486.586,09           |

#### 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

USD

## Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

| Wertpapier-Darlehen | absolute Beträge in EUR |
|---------------------|-------------------------|
| unbefristet         | 79.139.922,32           |

## Ertrags- und Kostenanteile

| Wertpapier-Darlehen     | absolute Beträge in EUR | in % der Bruttoerträge des Fonds |
|-------------------------|-------------------------|----------------------------------|
| Ertragsanteil des Fonds | 158.489,71              | 100,00                           |
| Kostenanteil des Fonds  | 52.301,71               | 33,00                            |
| Ertragsanteil der KVG   | 52.301,71               | 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.

## Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

1,10% (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 |
|--|---|
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM] | 30.191.708,05   |
| Siemens Financieringsmaatschappij N.V.         | 20.977.717,00   |
| Deutsche Bank AG                               | 16.937.449,20   |
| Wallonne, Région                               | 3.657.864,70  |
| Kreditanstalt für Wiederaufbau                 | 3.183.694,90  |
| Development Bank of Japan                      | 1.899.501,37  |
| NRW.BANK                                       | 1.789.041,64  |
| Mondelez International Inc.                    | 502.945,46  |

## 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          | 53.571.871,88 EUR (absolut/verwahrter Betrag) |
| Clearstream Banking Frankfurt    | 25.568.050,44 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 3. Juli 2023  
 Deka Investment GmbH  
 Die Geschäftsführung

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

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

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 2023

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



**Deka Investment GmbH**

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

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

