

Jahresbericht
zum 30. September 2023.

Deka-Wandelanleihen

Ein Investmentfonds gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom
17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame
Anlagen (OGAW).



.Deka
Investments

Bericht des Vorstands.

30. September 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Wandelanleihen für den Zeitraum vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor dämpften im Herbst 2022 die Börsenstimmung in Europa, diese nahmen allerdings angesichts eines milden Winters im Verlauf spürbar ab. Damit sank auch der Einfluss des russischen Angriffskriegs auf die Kapitalmarktentwicklung. Die rigide Null-Covid-Politik in China führte in den ersten Monaten noch zu deutlichen Beeinträchtigungen im globalen Handel, die sich nach dem Paradigmenwechsel in der Corona-Politik im Dezember sukzessive reduzierten. In Deutschland und dem Euroraum hat sich die Konjunktur dennoch merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Wesentlicher Faktor war hierbei die Geldpolitik der führenden Notenbanken. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtsjahr die Inflationsentwicklung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten zwang. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt war, erhöhte die EZB die Leitzinsen bis auf 4,50 Prozent. An den Rentenmärkten zogen die Renditen zunächst kräftig an, ehe eine Seitwärtstendenz einsetzte und erst im letzten Monat erneut deutliche Anstiege zu konstatieren waren. Im Betrachtungszeitraum erhöhte sich die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen auf 2,8 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen Ende September bei 4,6 Prozent.

Angesichts zahlreicher Belastungsfaktoren wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode einige Schwankungen auf. Bis zum Sommer überwogen hierbei die positiven Vorzeichen, ehe zuletzt wieder belastende Faktoren zunahmen. Stark unter Druck stand anfangs der Euro, der vorübergehend unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, sich jedoch anschließend wieder erholte. Der Ölpreis zeigte ebenfalls eine hohe Volatilität und tendierte zuletzt bei 95,3 US-Dollar pro Barrel (Brent Future).

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka International S.A.
Der Vorstand



Holger Hildebrandt



Eugen Lehnertz

Inhalt.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensaufstellung zum 30. September 2023	8
Anhang	27
BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE	32
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	34

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

Jahresbericht 01.10.2022 bis 30.09.2023

Deka-Wandelanleihen

Tätigkeitsbericht.

Anlageziel des Fonds Deka-Wandelanleihen ist es, auf den in- und ausländischen Kapitalmärkten durch langfristiges Kapitalwachstum eine angemessene Rendite in Euro zu erwirtschaften.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds hauptsächlich in so genannte Wandelschuldverschreibungen - diese besitzen ein Wandlungsrecht der Anleihe in Aktien desselben Ausstellers - an. Daneben dürfen auch so genannte Optionsanleihen - diese beinhalten ein Bezugsrecht auf Aktien desselben Ausstellers - und andere fest- oder variabel verzinsliche Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, Aktien sowie Partizipations- und Genuss-Scheine erworben werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental orientierte Investmentansatz kombiniert gezielt „Top-Down“ sowie „Bottom-Up“-Elemente. Die Basis stellt die Analyse makroökonomischer sowie (geo)politischer Parameter dar, ergänzt durch qualitative sowie quantitative fundamentale Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände, z.B. Bonitätsanalyse der Emittenten, relativer Vergleich der Wertpapiere mit anderen korrespondierenden Ausstellern. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/ Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z.B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Die Verwaltungsgesellschaft hat auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

Positive Fondsentwicklung

Die internationalen Währungshüter sahen sich angesichts der weltweit stark gestiegenen Inflationsraten gezwungen, ein ambitioniertes geldpolitisches Straffungsprogramm rasch voranzutreiben. Die US-Notenbank Federal Reserve erhöhte die US-Leitzinsen im Berichtszeitraum signifikant auf die Spanne von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent, während die Europäische Zentralbank etwas später und moderater agierte und die Zinsen auf 4,50 Prozent anhob. In Europa rückt in den Diskussionen über die weitere Geldpolitik die schwache konjunkturelle Entwicklung stärker in den Fokus. An den Rentenmärkten zogen die Renditen angesichts vorsichtiger Töne von den Notenbanken zuletzt erneut merklich an. Insgesamt sind die Renditen in der Berichtsperiode deutlich gestiegen und belasteten damit das Rentenmarktumfeld.

Wichtige Kennzahlen Deka-Wandelanleihen

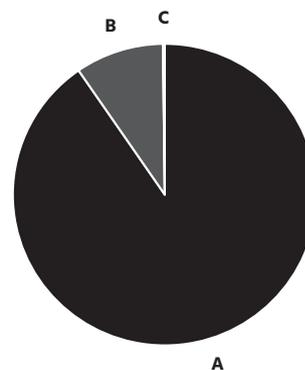
Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
Anteilklasse CF	8,0%	0,4%	0,8%
Anteilklasse TF	7,4%	-0,1%	0,3%

ISIN

Anteilklasse CF	LU0158528447
Anteilklasse TF	LU0158529254

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

Fondsstruktur Deka-Wandelanleihen



A Renten	90,4%
B Aktien	9,4%
C Barreserve, Sonstiges	0,2%

Geringfügige Abweichungen zur Vermögensaufstellung des Berichts resultieren aus der Zuordnung von Zins- und Dividendenansprüchen zu den jeweiligen Wertpapieren sowie aus rundungsbedingten Differenzen.

Die Aktienmärkte in Europa und den USA entwickelten sich insgesamt erfreulich. Waren die ersten Monate der Berichtsperiode noch von Kursrückgängen geprägt, so überwogen seit Jahresbeginn 2023 die positiven Monate, trotz der restriktiven Geldpolitik der Zentralbanken und anhaltender geopolitischer Risiken (wie Krieg in der Ukraine, Spannungen zwischen den USA und China). Die Volatilität an den Aktienmärkten ist seit ihrem Höchststand im Oktober sukzessive zurückgegangen, wobei die Unsicherheiten im US-Bankensektor im März zwischenzeitlich für eine erneute Verschärfung sorgten.

Der europäische Primärmarkt für Wandelanleihen zeigte sich mit einem Emissionsvolumen von nominal rund 11,5 Mrd. Euro an Wandel- und Umtauschanleihen seit Oktober 2022 moderat aktiv. Das ausstehende Volumen europäischer Wandelanleihen lag im Berichtszeitraum mit umgerechnet 59,8 Mrd. US-Dollar auf einem historisch niedrigen Niveau, im Vergleich zum Vorjahr jedoch um 2,1 Mrd. US-Dollar höher. Die Neuemissionen waren unterschied-

Deka-Wandelanleihen

lich ausgestattet und dienen in erster Linie der Refinanzierung bestehender Fälligkeiten und der Optimierung der Kreditstruktur.

Die implizite Volatilität europäischer Wandelanleihen ist nach kurzem Anstieg zum Jahresende 2022 kräftig gefallen und lag auch zum Ende des Berichtszeitraums nahe ihres Tiefpunkts. Dieses niedrige Niveau wurde seit 2010 nicht mehr erreicht. Die implizite Volatilität von Optionen auf Aktienindizes ist ebenfalls stark zurückgegangen, liegt aber immer noch über der impliziten Volatilität von Wandelanleihen. Die Laufzeit der in einer Wandelanleihe eingebetteten Option beträgt im Durchschnitt vier Jahre, während die Laufzeit der üblichen Optionen auf Aktienindizes maximal neun Monate beträgt. Die implizite Volatilität von Wandelanleihen ist daher in der Regel höher.

In einem von steigenden Aktienkursen und sinkenden Aktienvolatilitäten geprägten Anlageumfeld wurde die Aktiensensitivität (Delta) des Fonds reduziert. Attraktive Neuemissionen von Unternehmensanleihen wie z.B. Rheinmetall, Cellnex, Saipem, SGL Carbon u.a. wurden im Berichtszeitraum selektiv zur Portfoliodiversifikation genutzt.

Zur Steuerung des Portfolios kamen darüber hinaus Derivate (Zinsterminkontrakte und CDS) zum Einsatz. Fremdwährungspositionen wurden über Devisenterminkontrakte partiell abgesichert.

Die Anteilklasse CF des Deka-Wandelanleihen verzeichnete im Berichtsjahr ein Plus von 8,0 Prozent, die Anteilklasse TF verbuchte einen Anstieg um 7,4 Prozent. Das Fondsvolumen belief sich zum Stichtag auf 440,9 Mio. Euro.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten (Angaben gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852).

PAI-Berücksichtigung

Bei den Anlageentscheidungen dieses Finanzproduktes in Wertpapieren und Geldmarktinstrumente wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (nachfolgend auch Principal Adverse Impacts oder PAI) berücksichtigt. PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-) Tätigkeiten von Unternehmen und Staaten in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Dazu wurden auch systematische Verfahrensweisen zur Messung und Bewertung, sowie Maßnahmen zum Umgang mit den PAI in den Investitionsprozessen angewendet. Diese beinhalteten einen Steuerungsmechanismus, der bei schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen keine Investition in Emittenten erlaubte, sofern dazu aussagekräftige Daten herangezogen werden konnten.

Wertentwicklung im Berichtszeitraum Deka-Wandelanleihen

Index: 30.09.2022 = 100



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

Bei weniger schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen konnten Investitionen nur begründet erfolgen. Im Ergebnis hielt der Fonds seit dem 01.09.2022 keine Anlagen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Unternehmen und Staaten mit schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen. Es wurde somit nicht in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen investiert, die an der Herstellung oder dem Verkauf von kontroversen Waffen beteiligt waren, denen Menschenrechtsverletzungen vorgeworfen wurden oder die einen Schwellenwert bei ihrer Treibhausgasemissionsintensität oder Energieverbrauchsintensität überschritten haben. Darüber hinaus wurde seit dem 01.09.2022 auch nicht in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten investiert, deren Treibhausgasemissionsintensität einen Schwellenwert überschritten hat. Bei Unternehmen und Staaten mit weniger schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen erfolgte bei den zuvor genannten Indikatoren eine Investition nur in begründeten Fällen. Zudem erfolgten nur begründete Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen haben und nur begründete Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen haben. Zielfonds, bei denen festgelegte Schwellenwerte für bestimmte PAI überstritten wurden, konnten seit dem 01.12.2022 nicht mehr für das Sondervermögen erworben werden, vorausgesetzt einer ausreichenden Datenverfügbarkeit bei den PAI-Indikatoren. Bereits vor dem 01.12.2022 gehaltene Zielfonds, bei denen die festgelegten Schwellenwerte überschritten wurden, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger bis zum 31.12.2022 veräußert.

Deka-Wandelanleihen

Durch das systematische, abgestufte Vorgehen wurden die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen, die mit den Investitionen des Fonds verbunden waren, begrenzt. Die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen von Unternehmen wurden auch im Rahmen der Mitwirkungspolitik der Verwaltungsgesellschaft berücksichtigt mit der Absicht auf eine Reduzierung der PAI der Emittenten im Anlageuniversum hinzuwirken. Die Ergebnisse der Mitwirkungspolitik sind im aktuellen Engagement-Bericht zu finden <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.

Deka-Wandelanleihen

Vermögensaufstellung zum 30. September 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								181.583.402,61	41,21
Aktien								41.233.662,66	9,35
EUR								13.166.324,65	2,99
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK		50.000	0	0	EUR 38,655	1.932.750,00	0,44
DE0006095003	ENCAVIS AG Inhaber-Aktien	STK		50.000	0	0	EUR 13,355	667.750,00	0,15
AT000000ETS9	Euro TeleSites AG Inhaber-Aktien	STK		111.655	111.654	0	EUR 4,300	480.114,35	0,11
FR0011726835	Gaztransport Technigaz Actions Nom.	STK		12.000	25.842	13.842	EUR 117,100	1.405.200,00	0,32
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port.	STK		2.500	2.500	0	EUR 434,450	1.086.125,00	0,25
FR0000130395	Rémy Cointreau S.A. Actions au Porteur	STK		5.090	5.090	0	EUR 115,850	589.676,50	0,13
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK		6.500	0	0	EUR 136,620	888.030,00	0,20
FR0013227113	Soitec S.A. Actions au Porteur	STK		20.000	0	0	EUR 158,450	3.169.000,00	0,72
AT0000720008	Telekom Austria AG Inhaber-Aktien	STK		446.618	446.618	0	EUR 6,600	2.947.678,80	0,67
CHF								1.116.871,81	0,25
CH0023405456	Dufry AG Namens-Aktien	STK		30.303	0	0	CHF 35,560	1.116.871,81	0,25
USD								26.950.466,20	6,11
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares	STK		2.700	0	0	USD 504,670	1.284.631,85	0,29
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares	STK		30.000	0	0	USD 447,280	12.650.513,81	2,86
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares	STK		15.354	0	4.646	USD 156,880	2.270.892,35	0,52
US4917711025	Kenvue Inc. Reg.Shares	STK		37.318	37.319	1	USD 20,110	707.518,60	0,16
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares	STK		14.000	0	1.000	USD 627,520	8.282.530,40	1,88
US7237871071	Pioneer Natural Resources Co. Reg.Shares	STK		3.000	0	1.000	USD 234,190	662.364,48	0,15
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares CIA	STK		5.000	0	0	USD 231,660	1.092.014,71	0,25
Verzinsliche Wertpapiere								140.349.739,95	31,86
EUR								96.689.111,68	21,96
FR0014006ND8	2,3750 % ACCOR S.A. Bonds 21/28	EUR		400.000	0	0	% 89,500	358.000,00	0,08
FR001400F2Q0	7,2500 % Air France-KLM S.A. MTN 23/26 ¹⁾	EUR		1.200.000	1.200.000	0	% 102,555	1.230.660,00	0,28
FR001400F2R8	8,1250 % Air France-KLM S.A. MTN 23/28 ¹⁾	EUR		700.000	700.000	0	% 104,451	731.157,00	0,17
XS2615937187	7,2500 % Allwyn Entertainm.Fin.(UK) PLC Notes 23/30 Reg.S	EUR		450.000	450.000	0	% 101,375	456.187,50	0,10
XS2113253210	3,8750 % Allwyn International AS Bonds 20/27 Reg.S	EUR		1.000.000	0	0	% 93,881	938.810,00	0,21
DE000A19W2L5	0,0000 % ams-OSRAM AG Zero Conv. Bonds 18/25	EUR		6.400.000	0	600.000	% 88,750	5.680.000,00	1,29
XS2089160506	0,0000 % ANLIAN Capital Ltd. Zero Conv. Bonds 20/25	EUR		1.500.000	0	0	% 106,700	1.600.500,00	0,36
XS2637969341	8,5870 % Apollo Swedish Bidco AB FLR Notes 23/29 Reg.S	EUR		500.000	500.000	0	% 100,000	500.000,00	0,11
XS1980255936	6,3750 % Arabische Republik Ägypten MTN 19/31 Reg.S	EUR		400.000	0	200.000	% 56,479	225.916,00	0,05
XS2434701616	1,6250 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN 22/28	EUR		775.000	0	0	% 88,056	682.430,13	0,15
XS2434702853	2,2500 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN 22/32	EUR		650.000	0	0	% 80,214	521.387,75	0,12
XS2648489388	7,2500 % Avis Budget Finance PLC Notes 23/30 Reg.S	EUR		650.000	650.000	0	% 99,625	647.562,50	0,15
XS2535283548	8,0000 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 22/26	EUR		700.000	0	600.000	% 102,224	715.568,00	0,16
XS1731596257	0,5000 % BE Semiconductor Inds N.V. Conv. Bonds 17/24	EUR		800.000	0	2.200.000	% 204,500	1.636.000,00	0,37
XS2338167104	5,2500 % BK LC Lux Finco 1 S.à r.l. Notes 21/29 Reg.S	EUR		350.000	0	0	% 98,750	345.625,00	0,08
XS2367164576	2,4500 % Bulgarian Energy Holding EAD Bonds 21/28	EUR		600.000	0	0	% 83,995	503.970,00	0,11
XS2294186965	3,3750 % CAB SELAS Notes 21/28 Reg.S	EUR		425.000	0	0	% 83,625	355.406,25	0,08
XS2497520705	4,7770 % Celanese US Holdings LLC Notes 22/26	EUR		700.000	0	0	% 99,460	696.220,00	0,16
XS2257580857	0,7500 % Cellnex Telecom S.A. Conv. MT Bds 20/31	EUR		4.500.000	1.200.000	0	% 77,355	3.480.975,00	0,79
XS2338545655	5,7500 % Compact Bidco B.V. Bonds 21/26 Reg.S	EUR		475.000	0	0	% 64,039	304.182,88	0,07
XS2274815369	2,7500 % ContourGlobal Power Hldgs S.A. Notes 20/26 Reg.S	EUR		1.000.000	0	0	% 92,050	920.500,00	0,21
XS2274816177	3,1250 % ContourGlobal Power Hldgs S.A. Notes 20/28 Reg.S	EUR		675.000	0	0	% 82,462	556.615,13	0,13
XS2354326410	3,8750 % Coty Inc. Notes 21/26 Reg.S	EUR		300.000	0	0	% 97,625	292.875,00	0,07
FR001400F067	7,2500 % Crédit Agricole S.A. FLR MTN 23/Und.	EUR		500.000	500.000	0	% 98,125	490.625,00	0,11
XS2397354015	8,4130 % Cullinan Holdco SCSp FLR Notes 21/26 Reg.S	EUR		1.500.000	0	0	% 81,525	1.222.867,50	0,28
XS2397354528	4,6250 % Cullinan Holdco SCSp Notes 21/26 Reg.S	EUR		900.000	0	0	% 73,864	664.776,00	0,15
DE000A254Y92	1,0000 % Delivery Hero SE Wandelanl. Tr.B 20/27	EUR		3.000.000	1.500.000	0	% 78,375	2.351.250,00	0,53
DE000A3H2WQ0	1,5000 % Delivery Hero SE Wandelanl. Tr.B 20/28	EUR		5.000.000	1.000.000	0	% 72,550	3.627.500,00	0,82
XS2265369657	3,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN 20/26	EUR		600.000	0	0	% 93,840	563.040,00	0,13
XS2296201424	2,8750 % Deutsche Lufthansa AG MTN 21/25	EUR		1.300.000	0	0	% 96,688	1.256.937,50	0,29
XS2408458730	2,8750 % Deutsche Lufthansa AG MTN 21/27	EUR		700.000	0	0	% 91,125	637.875,00	0,14

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE000A3H2UK7	2,0000 % Deutsche Lufthansa AG Wandelanl. 20/25		EUR	1.500.000	500.000	300.000	% 102,625	1.539.375,00	0,35
DE000A2G87D4	0,0500 % Deutsche Post AG Wandelschuldv.17/25		EUR	4.000.000	0	0	% 94,225	3.769.000,00	0,85
XS2391403354	2,0000 % Dometic Group AB MTN 21/28		EUR	475.000	0	0	% 80,140	380.665,00	0,09
XS2079388828	2,0000 % Dufry One B.V. Notes 19/27 ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 88,500	265.500,00	0,06
XS2333564503	3,3750 % Dufry One B.V. Notes 21/28		EUR	650.000	0	0	% 89,625	582.562,50	0,13
PTEDP4OM0025	5,9430 % EDP - Energias de Portugal SA FLR MTN 23/83		EUR	300.000	300.000	0	% 98,750	296.250,00	0,07
XS1991034825	3,5000 % eircom Finance DAC Notes 19/26 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 94,245	471.225,00	0,11
FR001400EFQ6	7,5000 % Electricité de France (E.D.F.) FLR MTN 22/Und.		EUR	800.000	800.000	0	% 101,600	812.800,00	0,18
FR001400AK26	4,1250 % Elis S.A. MTN 22/27		EUR	300.000	0	0	% 98,125	294.375,00	0,07
XS2334857138	2,7500 % ENI S.p.A. FLR Nts 21/Und.		EUR	400.000	0	0	% 78,875	315.500,00	0,07
FR001400HZE3	7,0000 % Eramet S.A. Obl. 23/28		EUR	400.000	400.000	0	% 98,000	392.000,00	0,09
FI4000507132	4,2500 % Finnair Oyj Notes 21/25		EUR	800.000	0	200.000	% 95,875	767.000,00	0,17
XS2432286974	5,5000 % Food Service Project S.A. Notes 22/27 Reg.S		EUR	1.450.000	0	0	% 95,250	1.381.125,00	0,31
XS2623496085	6,1250 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 23/28 ¹⁾		EUR	525.000	525.000	0	% 103,350	542.587,50	0,12
XS1933947951	0,0000 % Geely Sweden Finance AB (publ) Zero Exch.Bds 19/24		EUR	1.000.000	0	0	% 146,525	1.465.250,00	0,33
XS2587352340	4,3000 % General Motors Financial Co. MTN 23/29		EUR	400.000	400.000	0	% 96,580	386.318,00	0,09
NO0010912801	9,9340 % Global Agrajes S.L. FLR Bonds 20/25		EUR	600.000	0	0	% 102,250	613.500,00	0,14
DE000A289DA3	0,7500 % HelloFresh SE Wandelanl. 20/25		EUR	1.500.000	0	0	% 93,875	1.408.125,00	0,32
XS2541618299	9,0000 % House of HR Group B.V. Notes 22/29 Reg.S		EUR	300.000	300.000	0	% 97,875	293.625,00	0,07
FI4000523550	4,2500 % Huhtamaeki Oyj Notes 22/27		EUR	500.000	0	0	% 97,806	489.027,50	0,11
XS2397781357	5,1250 % Iliad Holding S.A.S. Notes 21/26 Reg.S		EUR	625.000	0	0	% 95,375	596.093,75	0,14
XS2397781944	5,6250 % Iliad Holding S.A.S. Notes 21/28 Reg.S ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 93,250	559.500,00	0,13
FR001400EJ15	5,3750 % Iliad S.A. Obl. 22/27		EUR	600.000	1.000.000	400.000	% 97,419	584.514,00	0,13
XS2322423455	2,7500 % Internat. Cons. Airl. Group SA Bonds S.A 21/25		EUR	800.000	0	0	% 96,535	772.280,00	0,18
XS1908248963	6,5000 % International Design Group SpA Notes 18/25 Reg.S		EUR	525.000	0	0	% 97,105	509.801,25	0,12
XS2303829308	0,0000 % JPMorgan Chase Bank N.A. Zero Exch. Bonds 21/24		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 100,755	1.007.550,00	0,23
XS2296021798	0,6250 % Just Eat Takeaway.com N.V. Conv. Bonds Tr.B 21/28		EUR	1.600.000	0	0	% 69,650	1.114.400,00	0,25
XS2296019891	0,0000 % Just Eat Takeaway.com N.V. Zero Con.Bds Tr.A 21/25		EUR	3.200.000	1.400.000	0	% 88,950	2.846.400,00	0,65
DE000A2GSDH2	0,8750 % LEG Immobilien SE Wandelschuldv. 17/25		EUR	600.000	0	0	% 93,030	558.180,00	0,13
DE000A289T23	0,4000 % LEG Immobilien SE Wandelschuldv. 20/28		EUR	3.000.000	0	0	% 78,850	2.365.500,00	0,54
XS2361343697	7,8450 % Lion/Polaris Lux 4 S.A. FLR Notes 21/26 Reg.S		EUR	300.000	0	0	% 99,750	299.250,00	0,07
NO0010894850	11,0330 % LR Global Holding GMBH FLR Notes 21/25		EUR	225.000	0	0	% 97,500	219.375,00	0,05
XS2406727151	5,6250 % Lune Holdings S.à r.l. Notes 21/28 Reg.S		EUR	1.300.000	0	0	% 83,195	1.081.535,00	0,25
DE000A3H2XW6	0,6250 % MorphoSys AG Wandelanl. 20/25		EUR	1.200.000	0	800.000	% 74,000	888.000,00	0,20
FR001400H0F5	5,5000 % Nexans S.A. Obl. 23/28		EUR	300.000	300.000	0	% 102,100	306.300,00	0,07
XS2550063478	7,5000 % Nidda Healthcare Holding GmbH Anleihe 22/26 Reg.S		EUR	1.100.000	1.100.000	0	% 100,938	1.110.312,50	0,25
XS1713466222	5,0000 % Novafives S.A.S. Notes 18/25 Reg.S		EUR	525.000	0	0	% 97,276	510.699,00	0,12
XS2240512124	0,0000 % Oliver Capital S.à r.l. Zero Exch. Bonds 20/23		EUR	2.000.000	0	0	% 98,900	1.978.000,00	0,45
XS2337349265	8,0310 % Oriiflame Investment Hold. PLC FLR Notes 21/26 R.S		EUR	450.000	0	0	% 38,500	173.250,00	0,04
XS2349786835	3,5000 % Paprec Holding S.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	300.000	0	0	% 89,656	268.966,50	0,06
XS2370814043	5,7500 % PeopleCert Wisdom Issuer PLC Notes 21/26 Reg.S		EUR	475.000	0	0	% 96,500	458.375,00	0,10
FI4000507876	4,7500 % PHM Group Holding Oy Notes 21/26		EUR	375.000	0	0	% 91,312	342.418,13	0,08
XS2361342889	3,8750 % Picard Groupe S.A.S. Notes 21/26 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 92,625	463.125,00	0,11
XS2276552598	0,0000 % Pirelli & C. S.p.A. Zero Exch. MT Bonds 20/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 95,505	955.050,00	0,22
XS2353073161	2,6250 % Poste Italiane S.p.A. FLR MTN 21/Und.		EUR	825.000	0	0	% 77,000	635.250,00	0,14
DE000A2LQRA1	0,0000 % RAG-Stiftung Umtauschanl. 18/24		EUR	600.000	0	0	% 95,600	573.600,00	0,13

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2332889778	4,2500 % Rakuten Group Inc. FLR Notes 21/Und. Reg.S		EUR	575.000	0	0	% 55,500	319.125,00	0,07
XS2107451069	2,5000 % RCS & RDS SA Bonds 20/25 Reg.S		EUR	1.000.000	0	0	% 96,490	964.900,00	0,22
XS2107452620	3,2500 % RCS & RDS SA Bonds 20/28 Reg.S		EUR	600.000	0	0	% 82,500	495.000,00	0,11
XS2200244072	0,5000 % Rep. Argentinien Bonds 20/29 ²⁾		EUR	11.073	0	0	% 26,089	2.888,78	0,00
XS2360598630	5,9500 % Republik Kamerun Notes 21/32 Reg.S ³⁾		EUR	800.000	0	0	% 66,750	534.000,00	0,12
XS1811792792	3,5000 % Samsonite Finco S.à r.l. Notes 18/26 Reg.S		EUR	200.000	0	0	% 95,375	190.750,00	0,04
BE6318634548	5,7500 % Sarens Finance Company N.V. Notes 20/27		EUR	1.000.000	0	0	% 88,024	880.240,00	0,20
XS2644942737	9,5000 % SCIL IV LLC Notes 23/28 Reg.S		EUR	450.000	450.000	0	% 102,250	460.125,00	0,10
XS2489775580	3,5000 % SES S.A. MTN 22/29		EUR	500.000	0	0	% 93,608	468.040,00	0,11
XS2404291010	5,2500 % Sig PLC Notes 21/26 Reg.S		EUR	1.000.000	0	0	% 83,955	839.550,00	0,19
DE000A351WB9	5,1250 % Sixt SE MTN 23/27		EUR	800.000	1.350.000	550.000	% 102,375	819.000,00	0,19
NO0012826033	10,5450 % Skill BidCo ApS FLR Bonds 23/28		EUR	876.000	876.000	0	% 100,125	877.095,00	0,20
XS2339015047	6,2500 % Standard ProfilAutomotive GmbH Anl. 21/26 Reg.S		EUR	1.200.000	0	0	% 77,716	932.592,00	0,21
XS2634690114	4,2500 % Stellantis N.V. MTN 23/31 ¹⁾		EUR	1.925.000	1.925.000	0	% 95,732	1.842.841,00	0,42
XS2111948126	9,0000 % Sumner BidCo B.V. Nts Tr.2 19/25 Reg.S		EUR	1.250.000	0	0	% 115,925	1.449.068,25	0,33
XS2582501925	5,6180 % TDC Net A/S MTN 23/30		EUR	400.000	400.000	0	% 97,625	390.500,00	0,09
FR001400J861	5,6250 % TDF Infrastructure SAS Obl. 23/28		EUR	300.000	300.000	0	% 100,172	300.514,50	0,07
XS2288109676	1,6250 % Telecom Italia S.p.A. MTN 21/29		EUR	400.000	0	0	% 78,125	312.500,00	0,07
XS2293060658	2,3760 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 21/Und.		EUR	600.000	0	300.000	% 78,563	471.375,00	0,11
XS2244837162	7,5000 % Tereos Finance Groupe I Notes 20/25 Reg.S		EUR	1.550.000	0	0	% 101,875	1.579.062,50	0,36
XS2413862108	4,7500 % Tereos Finance Groupe I Notes 22/27 Reg.S		EUR	600.000	0	0	% 96,255	577.530,00	0,13
XS2532478430	7,2500 % Tereos Finance Groupe I Notes 23/28 Reg.S		EUR	525.000	525.000	0	% 102,438	537.796,88	0,12
XS2414835921	2,5000 % UGI International LLC Notes 21/29 Reg.S		EUR	700.000	0	0	% 82,715	579.005,00	0,13
BE6322623669	0,0000 % Umicore S.A. Zero Conv. Obl. 20/25		EUR	700.000	700.000	0	% 90,750	635.250,00	0,14
XS2010027881	4,6250 % United Group B.V. Bonds 21/28 Reg.S		EUR	300.000	0	0	% 85,876	257.628,00	0,06
XS2111947318	7,0310 % United Group B.V. FLR Notes 20/26 Reg.S		EUR	450.000	0	0	% 98,750	444.375,00	0,10
FR001400EA16	5,3750 % Valéo S.E. MTN 22/27 ¹⁾		EUR	700.000	700.000	0	% 99,975	699.825,00	0,16
XS2307567086	3,6250 % Victoria PLC Notes 21/26 Reg.S ¹⁾		EUR	450.000	0	0	% 79,000	355.500,00	0,08
XS2630490717	6,5000 % Vodafone Group PLC FLR MTN 23/84		EUR	300.000	300.000	0	% 100,925	302.775,00	0,07
XS1707063589	1,7500 % Webuild S.p.A. Notes 17/24 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 97,750	488.750,00	0,11
XS2417090789	3,7500 % WP/AP Telecom Holdings IV B.V. Notes 21/29 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 86,250	431.250,00	0,10
DE000A3E4589	0,0500 % Zalando SE Wandelanl. Tr.A 20/25		EUR	2.000.000	500.000	0	% 90,510	1.810.200,00	0,41
DE000A3E4597	0,6250 % Zalando SE Wandelanl. Tr.B 20/27		EUR	1.000.000	0	0	% 82,500	825.000,00	0,19
XS2681541327	6,1250 % ZF Europe Finance B.V. MTN 23/29		EUR	400.000	400.000	0	% 100,125	400.500,00	0,09
XS2231715322	3,0000 % ZF Finance GmbH MTN 20/25		EUR	700.000	0	0	% 95,750	670.250,00	0,15
XS2262961076	2,7500 % ZF Finance GmbH MTN 20/27		EUR	300.000	0	0	% 89,500	268.500,00	0,06
XS2231331260	3,7500 % ZF Finance GmbH MTN 20/28 ¹⁾		EUR	700.000	0	0	% 89,750	628.250,00	0,14
XS2399851901	2,2500 % ZF Finance GmbH MTN 21/28 ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 84,750	508.500,00	0,12
XS2582404724	5,7500 % ZF Finance GmbH MTN 23/26		EUR	300.000	300.000	0	% 100,035	300.105,00	0,07
CHF								16.336.664,29	3,69
CH0554992062	3,2500 % Basilea Pharmaceutica AG Wandelanl. 20/27		CHF	1.165.000	0	0	% 99,200	1.197.825,49	0,27
CH1105195684	0,7500 % Dufry One B.V. Conv. Bonds 21/26		CHF	1.000.000	200.000	0	% 90,700	940.076,59	0,21
XS2333565815	3,6250 % Dufry One B.V. Notes 21/26		CHF	850.000	0	150.000	% 98,098	864.236,93	0,20
CH0426820350	0,7500 % Idorsia AG Wdl.-Anl. 18/24		CHF	1.000.000	0	0	% 67,410	698.683,17	0,16
CH1128004079	2,1250 % Idorsia AG Wdl.-Anl. 18/28		CHF	1.600.000	0	0	% 37,500	621.880,88	0,14
CH0413990240	0,1500 % Sika AG Wdl.-Anl. 18/25		CHF	7.500.000	0	1.500.000	% 125,450	9.751.869,53	2,20
CH0397642775	0,3250 % Swiss Prime Site AG Wandelanl. 18/25		CHF	2.250.000	0	0	% 97,000	2.262.091,70	0,51
GBP								1.761.637,10	0,40
XS2270378149	0,5000 % IWG International Holdings Conv. Notes 20/27		GBP	800.000	0	0	% 82,350	760.379,04	0,17
XS2284240137	1,0000 % Trainline PLC Conv. Bonds 21/26		GBP	1.000.000	0	0	% 86,750	1.001.258,06	0,23
SEK								466.040,45	0,11
NO0010968563	0,0000 % Scandic Hotels Group AB Zero Conv. Notes 21/24		SEK	5.500.000	0	0	% 97,380	466.040,45	0,11

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
USD								25.096.286,43	5,70
XS2384701020	7,3750 % Bundesrepublik Nigeria MTN 21/33 Reg.S	USD		300.000	0	0	% 74,257	210.024,04	0,05
USU13518AC64	5,7500 % Canacol Energy Ltd. Notes 21/28 Reg.S	USD		600.000	0	0	% 81,250	459.602,15	0,10
USP28768AC69	4,9500 % Colombia Telecom. S.A. E.S.P. Notes 20/30 Reg.S	USD		525.000	0	0	% 74,250	367.504,95	0,08
USG2583XAB76	6,7500 % CSN Inova Ventures Notes 20/28 Reg.S	USD		300.000	0	0	% 92,910	262.780,71	0,06
USL21779AJ97	4,6250 % CSN Resources S.A. Notes 21/31 Reg.S	USD		600.000	0	0	% 76,644	433.547,66	0,10
XS2348420303	8,7500 % Ecobank Transnational Inc. FLR Notes 21/31 Reg.S	USD		200.000	0	0	% 87,500	164.985,39	0,04
XS1592282740	3,2500 % ELM B.V. Exch. MTN 18/24	USD		1.600.000	0	0	% 112,000	1.689.450,36	0,38
US345397C437	6,9500 % Ford Motor Credit Co. LLC Notes 23/26	USD		250.000	250.000	0	% 100,125	235.988,03	0,05
XS1799614232	0,0000 % Glencore Funding LLC Zero Exch. Bonds 18/25	USD		6.000.000	1.000.000	0	% 109,675	6.203.921,94	1,41
USV3855MAA54	4,3000 % Greenko Power II Ltd. Notes 21/28 Reg.S ²⁾	USD		325.000	0	0	% 79,533	243.690,64	0,06
XS2413632360	5,6250 % IHS Holding Ltd Notes 21/26 Reg.S	USD		375.000	0	0	% 82,921	293.159,00	0,07
XS2051106073	8,0000 % IHS Netherlands Holdco B.V. Notes 19/27 Reg.S	USD		500.000	0	0	% 84,438	398.027,25	0,09
XS2260457754	5,5000 % Ipoteka-Bank JSCMB Notes 20/25	USD		300.000	0	0	% 91,380	258.451,97	0,06
USY5257YAL12	5,8310 % Lenovo Group Ltd. Notes 22/28 Reg.S	USD		500.000	0	0	% 98,230	463.040,92	0,11
USY56607AA51	6,3750 % Medco Bell Pte Ltd. Notes 20/27 Reg.S	USD		200.000	0	200.000	% 94,375	177.948,52	0,04
XS2333568751	0,0000 % Meituan Zero Conv. Bonds 21/27	USD		700.000	0	800.000	% 88,645	585.005,19	0,13
XS2333569056	0,0000 % Meituan Zero Conv. Bonds 21/28	USD		1.000.000	0	700.000	% 82,675	779.438,11	0,18
USV6703DAA29	5,6500 % Network i2i Ltd. FLR Secs 19/Und. Reg.S	USD		600.000	0	0	% 97,250	550.108,42	0,12
US71647NBJ72	5,5000 % Petrobras Global Finance B.V. Notes 21/51	USD		100.000	0	0	% 76,250	71.886,49	0,02
USP7922DAB03	7,5000 % Prumo Participac.Invest.S.A. Notes 19/31 Reg.S ²⁾	USD		800.000	0	0	% 76,216	574.837,46	0,13
XS1908221507	1,0000 % Qiagen N.V. Exchangeable Notes 18/24	USD		1.600.000	0	0	% 101,375	1.529.178,84	0,35
DE000A286LP0	0,0000 % Qiagen N.V. Zero Exch. Bonds 20/27	USD		2.000.000	400.000	0	% 88,505	1.668.803,62	0,38
US80386WAD74	5,5000 % Sasol Financing USA LLC Notes 21/31	USD		675.000	0	0	% 77,880	495.606,67	0,11
US03217KAB44	5,3750 % Sitios Latinoamérica SAB de CV Notes 22/32 144A	USD		500.000	0	0	% 85,857	404.717,64	0,09
XS2098881654	5,7000 % SMC Global Power Hldgs Corp. FLR Notes 20/Und.	USD		400.000	0	400.000	% 72,298	272.644,48	0,06
XS2211997155	0,0000 % STMicroelectronics N.V. Zero Exch. Bds Tr.A 20/25	USD		4.400.000	2.400.000	0	% 111,765	4.636.240,22	1,05
XS2265528120	5,5000 % TML Holdings Pte Ltd. Bonds 20/24	USD		525.000	0	0	% 98,750	488.769,21	0,11
XS2350621517	4,3500 % TML Holdings Pte Ltd. Bonds 21/26	USD		500.000	0	0	% 91,500	431.318,94	0,10
XS2125139464	5,2500 % UPL Corporation Ltd. FLR Notes 20/Und.	USD		400.000	0	300.000	% 76,500	288.488,73	0,07
XS2010026727	4,7500 % Uzbekneftegaz JSC Notes 21/28 Reg.S	USD		600.000	0	0	% 80,811	457.118,88	0,10
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								231.246.222,83	52,41
Verzinsliche Wertpapiere								231.246.222,83	52,41
EUR								180.443.940,41	40,88
FR0013521085	0,7000 % ACCOR S.A. Conv. Bonds 20/27	STK		16.625	0	0	EUR 45,629	758.587,72	0,17
XS1468662801	3,5000 % Adient Global Holdings Ltd. Notes 16/24 Reg.S ²⁾	EUR		500.000	0	0	% 14,721	73.605,71	0,02
XS2623604233	9,5000 % Adler Pelzer Holding GmbH Notes 23/27 Reg.S	EUR		325.000	325.000	0	% 93,375	303.468,75	0,07
XS2342910689	4,2500 % Affelou S.A.S. Notes 21/26 Reg.S	EUR		525.000	0	0	% 94,938	498.421,88	0,11
XS2319950130	3,6250 % Ahlstrom-Munksjoe Holding 3 Oy Notes 21/28 Reg.S	EUR		200.000	0	0	% 84,275	168.550,00	0,04
FR0013410628	0,1250 % Air France-KLM S.A. Obl. Conv. 19/26	STK		150.000	150.000	0	EUR 17,483	2.622.519,37	0,59
XS2399700959	5,2500 % Albion Fing 1 Sarl/Agg.H.Inc. Notes 21/26 Reg.S	EUR		850.000	0	0	% 94,550	803.675,00	0,18
XS2403514479	4,8750 % AlmavivA S.p.A. Notes 21/26 Reg.S	EUR		1.100.000	0	0	% 97,000	1.067.000,00	0,24
XS2388162385	2,1250 % Almirall S.A. Notes 21/26 Reg.S	EUR		150.000	0	0	% 93,370	140.055,00	0,03
XS2102489353	2,2500 % Altice Financing S.A. Notes 20/25 Reg.S	EUR		600.000	0	0	% 98,563	591.375,00	0,13

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2102493389	3,0000 % Altice Financing S.A. Notes 20/28 Reg.S		EUR	1.375.000	0	0	% 84,750	1.165.312,50	0,26
XS2373430425	4,2500 % Altice Financing S.A. Notes 21/29 Reg.S		EUR	600.000	0	0	% 83,750	502.500,00	0,11
XS1859337419	5,8750 % Altice France S.A. Notes 18/27 Reg.S		EUR	1.500.000	1.200.000	0	% 86,250	1.293.750,00	0,29
XS2053846262	3,3750 % Altice France S.A. Notes 19/28 Reg.S		EUR	600.000	0	275.000	% 74,500	447.000,00	0,10
XS2308171383	0,0000 % América Móvil B.V. Zero Exch. Bonds 21/24		EUR	8.000.000	2.000.000	0	% 102,145	8.171.600,00	1,85
DE000A283WZ3	2,1250 % ams-OSRAM AG Conv. Bonds 20/27		EUR	1.700.000	0	0	% 75,002	1.275.034,00	0,29
XS2310511717	3,0000 % Ardagh Metal Packaging Fin.PLC Notes 21/29 Reg.S ¹⁾		EUR	650.000	0	0	% 76,075	494.487,50	0,11
FR0013457942	0,0000 % Atos SE Zero Exch. Bonds 19/24		EUR	1.500.000	500.000	0	% 85,250	1.278.750,00	0,29
XS2278566299	2,0000 % Autostrade per L'Italia S.p.A. Notes 21/30		EUR	500.000	0	0	% 83,764	418.817,50	0,09
BE6342263157	5,7500 % Azelis Finance N.V. Bonds 23/28 Reg.S		EUR	200.000	200.000	0	% 100,375	200.750,00	0,05
XS1864418857	8,3750 % Banff Merger Sub Inc. Notes 18/26 Reg.S		EUR	170.000	0	0	% 99,000	168.300,00	0,04
XS2690055996	7,0000 % Banijay Entertainment S.A.S. Notes 23/29 Reg.S		EUR	650.000	650.000	0	% 99,313	645.531,25	0,15
XS2341843006	0,0000 % Barclays Bank PLC Zero Exchang. MTN 22/25		EUR	1.000.000	0	0	% 100,125	1.001.250,00	0,23
XS2684846806	7,0000 % Bayer AG FLR Sub. Anl. 23/83		EUR	300.000	300.000	0	% 99,000	297.000,00	0,07
XS2465773070	1,8750 % BE Semiconductor Inds N.V. Conv. Bonds 22/29		EUR	2.200.000	1.200.000	0	% 110,500	2.431.000,00	0,55
XS2616351867	9,2810 % Bormioli Pharma S.p.A. FLR Nts 23/28 Reg.S		EUR	625.000	625.000	0	% 100,519	628.243,75	0,14
XS2403031912	8,4750 % BURGER KING France SAS FLR Notes 21/26 Reg.S		EUR	425.000	0	0	% 100,320	426.360,00	0,10
XS2264155305	7,6250 % Carnival Corp. Notes 20/26 Reg.S		EUR	225.000	0	0	% 98,625	221.906,25	0,05
XS2597741102	2,1250 % Cellnex Telecom S.A. Conv. MT Bds 23/30		EUR	5.000.000	5.000.000	0	% 95,160	4.758.000,00	1,08
XS2241097687	5,8750 % Centurion Bidco S.p.A. Bonds 20/26 Reg.S		EUR	600.000	0	0	% 90,125	540.750,00	0,12
XS2468979302	3,1250 % CETIN Group N.V. MTN 22/27		EUR	675.000	0	0	% 92,837	626.646,38	0,14
XS2243548273	4,3750 % Cheplapharm Arzneimittel GmbH Anl. 20/28 Reg.S		EUR	800.000	0	0	% 91,588	732.700,00	0,17
XS2618867159	7,5000 % Cheplapharm Arzneimittel GmbH Anl. 23/30 Reg.S		EUR	450.000	450.000	0	% 100,497	452.234,25	0,10
XS2695600960	7,5000 % Cheplapharm Arzneimittel GmbH Anl. 23/30 Reg.S		EUR	275.000	275.000	0	% 100,325	275.893,75	0,06
XS2112973107	3,5000 % Cheplapharm Arzneimittel GmbH Anleihe 20/27 Reg.S		EUR	400.000	0	0	% 91,250	365.000,00	0,08
XS2618840974	8,5310 % Cheplapharm Arzneimittel GmbH FLR Anl. 23/30 Reg.S		EUR	325.000	325.000	0	% 101,425	329.631,25	0,07
XS2325699994	5,0000 % Cidron Aida Finco S.à r.l. Notes 21/28 Reg.S		EUR	800.000	0	225.000	% 90,900	727.200,00	0,16
XS1990952779	4,7500 % Cirsia Finance International Notes 19/25 Reg.S		EUR	250.000	0	0	% 99,080	247.700,00	0,06
XS2388186996	4,5000 % Cirsia Finance International Notes 21/27 Reg.S		EUR	500.000	0	300.000	% 92,550	462.750,00	0,10
XS2550380104	10,3750 % Cirsia Finance International Notes 22/27 Reg.S		EUR	300.000	300.000	0	% 108,063	324.187,50	0,07
XS2649695736	7,8750 % Cirsia Finance International Notes 23/28 Reg.S		EUR	525.000	525.000	0	% 100,690	528.622,50	0,12
FR0013489739	0,8750 % Clariane SE Conv. Bonds 20/27	STK		20.000	0	0	EUR 43,000	860.000,00	0,20
FR0014005AO4	1,8750 % Clariane SE FLR Conv. Nts 21/Und.	STK		33.875	0	0	EUR 29,558	1.001.279,58	0,23
XS2389334124	8,0980 % Conceria Pasubio S.p.A. FLR Notes 21/28 Reg.S ¹⁾	EUR		600.000	0	225.000	% 97,613	585.675,00	0,13
XS1918761997	2,5000 % Cosmo Pharmaceuticals N.V. Conv. Bonds 18/23		EUR	3.000.000	0	0	% 99,375	2.981.250,00	0,68
XS2688529135	5,7500 % Coty Inc. Notes 23/28 Reg.S		EUR	550.000	550.000	0	% 100,500	552.750,00	0,13
XS2356306642	0,0000 % Criteria Caixa S.A.U. Zero Exch. Bonds 21/25		EUR	2.500.000	0	0	% 93,255	2.331.375,00	0,53
XS2623222978	5,0000 % Crown European Holdings S.A. Notes 23/28 Reg.S		EUR	375.000	375.000	0	% 99,760	374.100,00	0,08
XS2336345140	5,5000 % CT Investment GmbH Anl. 21/26 Reg.S		EUR	250.000	0	0	% 94,550	236.375,00	0,05
XS2351382473	2,2500 % Derichebourg S.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	400.000	0	0	% 87,250	349.000,00	0,08
XS2388910270	2,2500 % DIC Asset AG Anl. 21/26		EUR	1.000.000	0	0	% 55,000	550.000,00	0,12
AT0000A2N7T2	1,7500 % DO & CO AG Conv. Bonds 21/26		EUR	500.000	0	0	% 128,813	644.062,50	0,15
DE000A3H2XR6	0,7500 % Duerr AG Wandelanl. 20/26		EUR	2.000.000	0	0	% 98,250	1.965.000,00	0,45
FR0013444395	0,0000 % Edenred SE Zero Conv. Bonds 19/24	STK		86.908	76.000	0	EUR 63,520	5.520.396,16	1,25
FR0014003YP6	0,0000 % Edenred SE Zero Conv. Bonds 21/28	STK		16.600	0	76.000	EUR 66,775	1.108.465,00	0,25

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2065633203	6,2500 % EG Global Finance PLC Notes 19/25 Reg.S ²⁾		EUR	525.000	0	0	% 89,928	472.124,44	0,11
XS2360381730	3,7500 % Elixir Group SA Notes 21/26		EUR	575.000	0	0	% 79,106	454.859,50	0,10
FR001400AFJ9	2,2500 % Elis S.A. Conv. Bonds 22/29		EUR	1.100.000	0	0	% 118,295	1.301.245,00	0,30
FR0013285707	0,0000 % Elis S.A. Zero Conv. Bonds 17/23		STK	4.187	0	0	EUR 31,835	133.293,15	0,03
DE000A3MQE86	1,8750 % Encavis Finance B.V. FLR Conv. Nts 21/Und.		EUR	1.000.000	0	0	% 84,380	843.800,00	0,19
XS2656464844	6,8750 % Energia Group Roi Holdings DAC Notes 23/28 Reg.S		EUR	950.000	950.000	0	% 98,125	932.187,50	0,21
XS2069326861	7,9750 % EVOCA S.p.A. FLR Notes 19/26 Reg.S ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 98,775	296.325,00	0,07
XS2591236315	3,5000 % Fastighets AB Balder Exch. Bonds 23/28		EUR	800.000	800.000	0	% 94,750	758.000,00	0,17
XS2548508451	9,5980 % Fiber BidCo S.p.A. FLR Nts 22/27 Reg.S		EUR	200.000	200.000	0	% 100,912	201.824,00	0,05
XS2548508881	11,0000 % Fiber BidCo S.p.A. Notes 22/27 Reg.S		EUR	275.000	275.000	0	% 107,010	294.277,50	0,07
FR0014002JO2	0,2500 % Fnac Darty Conv. Obl. 21/27		STK	12.667	0	0	EUR 67,395	853.690,41	0,19
XS2590764127	2,6250 % Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV Exch. Notes 23/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 99,305	993.050,00	0,23
XS2229875989	3,2500 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 20/25		EUR	800.000	0	0	% 96,750	774.000,00	0,18
XS2586123965	4,8670 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 23/27		EUR	675.000	675.000	0	% 98,750	666.562,50	0,15
XS2209344543	3,7500 % Forvia SE Notes 20/28 ¹⁾		EUR	500.000	0	0	% 89,835	449.172,50	0,10
XS2405483301	2,7500 % Forvia SE Notes 21/27		EUR	675.000	0	0	% 89,938	607.078,13	0,14
XS2553825949	7,2500 % Forvia SE Notes 22/26		EUR	825.000	825.000	0	% 103,250	851.812,50	0,19
XS2247623643	3,5000 % Getlink SE Notes 20/25 Reg.S		EUR	275.000	0	0	% 97,520	268.180,00	0,06
XS1965536656	0,0000 % GN Store Nord AS Zero Bonds 19/24 wW		EUR	2.000.000	500.000	0	% 96,500	1.930.000,00	0,44
XS2294854232	9,3030 % Goldstory S.A.S. FLR Nts 21/26 Reg.S		EUR	100.000	0	0	% 101,259	101.258,50	0,02
XS2294854745	5,3750 % Goldstory S.A.S. Notes 21/26 Reg.S ¹⁾		EUR	125.000	0	0	% 97,640	122.050,00	0,03
XS2390510142	2,7500 % Goodyear Europe B.V. Notes 21/28 Reg.S ¹⁾		EUR	575.000	0	0	% 82,950	476.962,50	0,11
XS2407520936	2,6250 % Graphic Packaging Intl LLC Notes 21/29 Reg.S		EUR	300.000	0	0	% 87,050	261.150,00	0,06
XS2393001891	3,8750 % Grifols Escrow Issuer S.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	350.000	0	0	% 85,188	298.156,25	0,07
XS2076836555	1,6250 % Grifols S.A. Notes 19/25 Reg.S		EUR	650.000	0	0	% 96,635	628.127,50	0,14
BE6339419812	2,1250 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Exch. Bds 22/25 R.S		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 96,130	2.403.250,00	0,55
XS2615562274	6,7500 % Gruenthal GmbH Anl. 23/30 Reg.S		EUR	250.000	250.000	0	% 101,750	254.375,00	0,06
XS1812087598	3,3750 % Grupo Antolin Irausa S.A. Notes 18/26 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 82,125	410.625,00	0,09
XS2355632584	3,5000 % Grupo Antolin Irausa S.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	600.000	0	0	% 69,094	414.564,00	0,09
XS2357812556	3,2500 % Guala Closures S.p.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	425.000	0	0	% 86,725	368.581,25	0,08
XS2337308741	9,5310 % HSE Finance Sarl FLR Notes 21/26 Reg.S		EUR	300.000	0	0	% 54,500	163.500,00	0,04
XS2337308238	5,6250 % HSE Finance Sarl Notes 21/26 Reg.S		EUR	400.000	0	0	% 52,580	210.320,00	0,05
XS2649707846	9,3750 % HT Troplast GmbH Anl. 23/28 Reg.S		EUR	1.275.000	1.275.000	0	% 101,000	1.287.750,00	0,29
XS2557565830	0,8000 % Iberdrola Finanzas S.A. Exch. MT Bds 22/27		EUR	500.000	500.000	0	% 96,505	482.525,00	0,11
XS2606019383	8,7500 % IHO Verwaltungs GmbH Anl. 23/28 Reg.S		EUR	600.000	600.000	0	% 103,370	620.220,00	0,14
XS2587558474	6,6250 % INEOS Finance PLC Notes 23/28 Reg.S ¹⁾		EUR	225.000	225.000	0	% 98,250	221.062,50	0,05
XS2291928849	3,7500 % INEOS Quattro Finance 1 PLC Notes 21/26 Reg.S ¹⁾		EUR	200.000	0	0	% 89,375	178.750,00	0,04
XS2291929573	2,5000 % INEOS Quattro Finance 2 PLC Notes 21/26 Reg.S		EUR	400.000	0	0	% 91,323	365.292,00	0,08
XS2010028004	2,2500 % InPost S.A. Notes 21/27 Reg.S		EUR	700.000	0	0	% 86,509	605.559,50	0,14
XS2343113101	1,1250 % Internat. Cons. Airl. Group SA Exch. Notes 21/28		EUR	3.600.000	800.000	0	% 82,700	2.977.200,00	0,68
XS2344474320	8,0310 % International Design Group SpA FLR Nts 21/26 Reg.S		EUR	125.000	0	0	% 100,000	125.000,00	0,03
XS2631198863	8,0000 % IPD 3 B.V. Notes 23/28 Reg.S		EUR	175.000	175.000	0	% 101,198	177.096,50	0,04
XS2582796541	9,0980 % Italmatch Chemicals S.p.A. FLR Notes 23/28 Reg.S		EUR	100.000	100.000	0	% 96,103	96.103,00	0,02
XS2582788100	10,0000 % Italmatch Chemicals S.p.A. Notes 23/28 Reg.S		EUR	100.000	100.000	0	% 97,800	97.800,00	0,02
XS2389112736	4,6250 % Itelyum Regeneration S.p.A. Notes 21/26 Reg.S		EUR	350.000	0	0	% 93,500	327.250,00	0,07
XS1881005976	4,5000 % Jaguar Land Rover Automotive Notes 18/26 Reg.S ¹⁾		EUR	700.000	0	0	% 95,950	671.650,00	0,15

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2364593579	4,5000 % Jaguar Land Rover Automotive Notes 21/28 Reg.S ¹⁾		EUR	400.000	0	0	% 87,975	351.900,00	0,08
XS2470870366	0,0000 % JPMorgan Chase Finl Co. LLC Zero Exch. MTN 22/25		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 104,910	2.098.200,00	0,48
XS2486270858	6,0000 % Kon. KPN N.V. FLR Notes 22/Und.		EUR	975.000	0	0	% 101,747	992.028,38	0,22
XS2250987356	5,7500 % Lenzing AG FLR Notes 20/Und.		EUR	600.000	0	0	% 88,500	531.000,00	0,12
XS2059777594	7,2500 % LHMC Finco 2 S.ä.r.l. Notes 19/25 Reg.S		EUR	933.804	35.915	0	% 98,000	915.127,92	0,21
XS2339830049	5,0000 % Libra Groupco S.p.A. Notes 21/27 Reg.S		EUR	250.000	0	0	% 90,625	226.562,50	0,05
XS2240463674	4,0000 % Lorca Telecom Bondco S.A. Notes 20/27 Reg.S		EUR	900.000	0	0	% 93,000	837.000,00	0,19
XS2536848448	9,7500 % Lottomatica S.p.A. Bonds 22/27 Reg.S		EUR	800.000	0	0	% 108,000	864.000,00	0,20
XS2628390366	7,1300 % Lottomatica S.p.A. Bonds 23/28 Reg.S		EUR	250.000	250.000	0	% 102,500	256.250,00	0,06
XS2628487956	7,9280 % Lottomatica S.p.A. FLR Nts 23/28 Reg.S		EUR	275.000	275.000	0	% 101,125	278.093,75	0,06
XS2031871069	3,7500 % Loxam S.A.S. Notes 19/26 Reg.S		EUR	550.000	0	0	% 93,871	516.290,50	0,12
XS2031871143	5,7500 % Loxam S.A.S. Notes 19/27 Reg.S ¹⁾		EUR	700.000	0	0	% 93,125	651.875,00	0,15
XS2401886788	4,5000 % Loxam S.A.S. Notes 22/27 Reg.S		EUR	650.000	0	0	% 94,875	616.687,50	0,14
XS2618428077	6,3750 % Loxam S.A.S. Notes 23/28 Reg.S		EUR	450.000	450.000	0	% 98,290	442.305,00	0,10
XS2341724172	2,3750 % MAHLE GmbH MTN 21/28		EUR	500.000	0	0	% 76,625	383.125,00	0,09
FR0013300381	0,1250 % Maisons du Monde S.A. Obl. Convert. 17/23		STK	28.000	0	0	EUR 47,975	1.343.296,77	0,30
BE6325746855	4,2500 % Mithra Pharmaceuticals S.A. Obl.Conv. Bonds 20/25		EUR	1.000.000	0	0	% 38,125	381.250,00	0,09
XS2388456456	0,0000 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV Zero Exch.Bds 21/24		EUR	4.600.000	2.600.000	0	% 96,220	4.426.120,00	1,00
XS2615006983	9,0950 % Monitchem Holdco 3 S.A. FLR Nts 23/28 Reg.S ¹⁾		EUR	350.000	350.000	0	% 99,650	348.775,00	0,08
XS2615006470	8,7500 % Monitchem Holdco 3 S.A. Notes 23/28 Reg.S		EUR	475.000	475.000	0	% 98,125	466.093,75	0,11
XS2092610141	7,7420 % Mooney Group S.p.A. FLR Bonds 19/26 Reg.S		EUR	475.000	0	0	% 100,000	475.000,00	0,11
XS2623257503	7,3750 % Motion Finco S.ä.r.l. Notes 23/30 Reg.S		EUR	500.000	500.000	0	% 98,500	492.500,00	0,11
DE000A2YPE76	0,0500 % MTU Aero Engines AG Wandelschuldv. 19/27		EUR	1.700.000	0	0	% 85,750	1.457.750,00	0,33
FR0013515707	2,0000 % NEOEN S.A. Conv. Bonds 20/25		STK	45.000	25.000	0	EUR 44,372	1.996.720,82	0,45
FR001400CMS2	2,8750 % NEOEN S.A. Conv. Bonds 22/27		EUR	300.000	0	0	% 91,935	275.805,00	0,06
FR0013321429	0,2500 % Nexity Obl. échangeables 18/25		STK	15.000	0	0	EUR 59,960	899.401,19	0,20
XS2355604880	2,5000 % Nomad Foods BondCo PLC Notes 21/28 Reg.S		EUR	625.000	0	0	% 87,750	548.437,50	0,12
XS2326493728	3,3750 % Novelis Sheet Ingot GmbH Anleihe 21/29 Reg.S ¹⁾		EUR	250.000	0	0	% 86,478	216.193,75	0,05
XS2624554320	6,2500 % OI European Group B.V. Notes 23/28 Reg.S		EUR	100.000	100.000	0	% 101,750	101.750,00	0,02
BE6329443962	3,5000 % Ontex Group N.V. Bonds 21/26		EUR	800.000	0	300.000	% 88,845	710.760,00	0,16
XS2332250708	2,8750 % Organon/Org.For.De.Co-Issuer Notes 21/28 Reg.S		EUR	325.000	0	0	% 86,175	280.068,75	0,06
FR0013246147	0,0000 % Orpar S.A. Zero Exch.Bonds 17/24		EUR	1.200.000	0	0	% 99,255	1.191.060,00	0,27
XS2200501653	5,0000 % Outokumpu Oyj Conv. Bonds 20/25		EUR	1.000.000	0	0	% 147,250	1.472.500,00	0,33
XS2401961078	7,9640 % Paganini BidCo S.p.A. FLR Notes 21/28 Reg.S		EUR	250.000	0	0	% 100,125	250.312,50	0,06
XS1794209459	4,0000 % Paprec Holding S.A. Notes 18/25 Reg.S		EUR	600.000	0	0	% 98,375	590.250,00	0,13
XS1172951508	2,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 15/27		EUR	500.000	0	0	% 77,224	386.117,50	0,09
XS2641928036	5,8750 % Playtech PLC Notes 23/28		EUR	450.000	450.000	0	% 98,750	444.375,00	0,10
XS2238777374	3,2500 % PPF Telecom Group B.V. MTN 20/27		EUR	400.000	0	0	% 94,375	377.500,00	0,09
XS2499278724	9,6630 % PrestigeBidCo GmbH FLR Notes 22/27 Reg.S		EUR	625.000	0	0	% 101,201	632.506,25	0,14
XS2314265237	4,3750 % Public Power Corporation S.A. Notes 21/26 Reg.S		EUR	475.000	0	0	% 97,500	463.125,00	0,11
XS2359929812	3,3750 % Public Power Corporation S.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	325.000	0	0	% 92,500	300.625,00	0,07
XS2115190295	5,8030 % Q-Park Holding I B.V. FLR Nts 20/26 Reg.S		EUR	250.000	0	0	% 99,175	247.937,50	0,06
XS2115190451	2,0000 % Q-Park Holding I B.V. Notes 20/27 Reg.S ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 86,500	259.500,00	0,06
DE000A3E44N7	0,0000 % RAG-Stiftung Umtauschanl. 20/26		EUR	2.000.000	0	0	% 91,195	1.823.890,00	0,41
DE000A30VPN9	1,8750 % RAG-Stiftung Umtauschanl. 22/29		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 100,300	1.203.600,00	0,27
DE000A287RE9	0,0000 % Redcare Pharmacy N.V. Zero Conv. Notes 21/28		EUR	700.000	0	0	% 87,050	609.350,00	0,14
XS2291911282	7,2500 % Rekeep S.p.A. Notes 21/26 Reg.S		EUR	400.000	0	0	% 90,975	363.900,00	0,08

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2439087367	8,1000 % Ren10 Holding AB FLR Notes 22/27 Reg.S ¹⁾		EUR	450.000	0	0	% 100,250	451.125,00	0,10
XS2199445193	5,7500 % RENK GmbH Anl. 20/25 Reg.S		EUR	700.000	0	0	% 99,725	698.075,00	0,16
XS2177363665	0,1250 % Rep. Argentinien Notes 20/30 ²⁾		EUR	359.621	0	0	% 26,250	94.400,51	0,02
XS2619991883	6,5000 % Republik San Marino Obbl. 23/27		EUR	700.000	1.000.000	300.000	% 99,154	694.078,00	0,16
XS2655993033	5,2500 % Rexel S.A. Notes 23/30		EUR	400.000	400.000	0	% 98,875	395.500,00	0,09
DE000A30V8S3	1,8750 % Rheinmetall AG Wandelschuldv. S.A 23/28		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 102,380	1.228.560,00	0,28
DE000A30V8T1	2,2500 % Rheinmetall AG Wandelschuldv. S.B 23/30		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 103,640	1.243.680,00	0,28
XS2417486771	9,0950 % Rimini BidCo S.p.A. FLR Notes 21/26 Reg.S ¹⁾		EUR	2.000.000	0	0	% 100,611	2.012.220,00	0,46
XS2066721965	7,5890 % Rossini S.à r.l. FLR Notes 19/25 Reg.S		EUR	250.000	0	0	% 100,245	250.612,50	0,06
XS1982682673	3,7500 % Sacyr S.A. Exchangeable Notes 19/24		EUR	800.000	0	0	% 122,755	982.040,00	0,22
FR0013513041	0,8750 % SAFRAN Conv. Bonds 20/27		STK	12.000	0	0	EUR 155,069	1.860.822,21	0,42
FR0014003232	0,0000 % SAFRAN Zero Conv. Bonds 21/28		STK	30.000	0	0	EUR 177,950	5.338.500,00	1,21
BE6327660591	0,0000 % Sagerpar S.A. Zero Conv. Obl. 21/26		EUR	1.500.000	0	0	% 90,000	1.350.000,00	0,31
XS2325696628	3,1250 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 21/28 ¹⁾		EUR	400.000	0	0	% 91,000	364.000,00	0,08
XS2677538493	2,8750 % Saipem S.p.A. Conv. Bonds 23/29		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 103,050	1.339.650,00	0,30
FR0014000OG2	0,0000 % Schneider Electric SE Zero Sust.Lkd Conv.MTB 20/26		STK	10.000	10.000	0	EUR 180,500	1.805.000,00	0,41
XS2401851485	8,1000 % SCIL IV LLC FLR Nts 21/26 Reg.S		EUR	225.000	0	0	% 100,056	225.126,00	0,05
XS2401849315	4,3750 % SCIL IV LLC Notes 21/26 Reg.S		EUR	300.000	0	0	% 93,250	279.750,00	0,06
XS2399981435	2,2500 % Séché Environnement S.A. Notes 21/28		EUR	850.000	0	0	% 85,250	724.625,00	0,16
DE000A30VKB5	5,7500 % SGL CARBON SE Wandelschuldv. 22/27		EUR	600.000	0	0	% 103,700	622.200,00	0,14
DE000A351SD3	5,7500 % SGL CARBON SE Wandelschuldv. 23/28		EUR	800.000	800.000	0	% 98,000	784.000,00	0,18
FR0014000105	0,0000 % Soitec S.A. Zero Conv. Obl. 20/25		STK	8.000	3.000	0	EUR 188,752	1.510.012,00	0,34
FR001400F2K3	2,0000 % Spie S.A. Exch. Bonds 23/28		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 102,060	1.020.600,00	0,23
DE000A3E46Y9	0,6250 % TAG Immobilien AG Wandelschuldv. 20/26		EUR	1.800.000	0	1.000.000	% 83,021	1.494.378,00	0,34
XS1859258383	6,0000 % Techem Verwaltungsges.674 mbH Sen. Notes 18/26 R.S ²⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 85,810	858.097,13	0,19
XS2090816526	2,0000 % Techem Verwaltungsges.674 mbH Sen. Notes 20/25 R.S		EUR	600.000	0	0	% 96,485	578.910,00	0,13
XS2581393134	6,8750 % Telecom Italia Sp.A. MTN 23/28		EUR	550.000	550.000	0	% 100,375	552.062,50	0,13
XS2646608401	6,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 23/Und. ¹⁾		EUR	500.000	500.000	0	% 98,900	494.500,00	0,11
XS2462605671	7,1250 % Telefónica Europe B.V. FLR Notes 22/Und.		EUR	600.000	600.000	0	% 102,655	615.930,00	0,14
XS2582389156	6,1350 % Telefónica Europe B.V. FLR Notes 23/Und.		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 96,500	1.447.500,00	0,33
XS2537462389	11,2140 % Tendam Brands S.A.U. FLR Notes 22/28 Reg.S		EUR	700.000	700.000	0	% 101,625	711.375,00	0,16
XS2406607098	3,7500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 21/27 ¹⁾		EUR	1.250.000	0	0	% 90,500	1.131.250,00	0,26
XS2406607171	4,3750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 21/30		EUR	1.375.000	0	0	% 85,725	1.178.718,75	0,27
XS2592804434	7,3750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 23/29		EUR	350.000	350.000	0	% 101,989	356.961,50	0,08
XS2592804194	7,8750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 23/31		EUR	125.000	125.000	0	% 103,879	129.848,13	0,03
XS2331728126	3,7500 % TI Automotive Finance PLC Notes 21/29 Reg.S ¹⁾		EUR	325.000	0	0	% 81,950	266.337,50	0,06
XS2436579978	1,8750 % Tirlan Co-operative Soc. Ltd. Exch. Bonds 22/27		EUR	1.800.000	800.000	0	% 102,350	1.842.300,00	0,42
XS2198191962	6,6250 % TK Elevator Holdco GmbH Anl. 20/28 Reg.S ^{1) 2)}		EUR	175.000	0	0	% 78,975	138.206,25	0,03
XS2199597456	4,3750 % TK Elevator Midco GmbH Anl. 20/27 Reg.S		EUR	250.000	0	0	% 90,750	226.875,00	0,05
XS2034069836	7,5310 % Trivium Packaging Finance B.V. FLR Bds 19/26 Reg.S		EUR	100.000	0	0	% 98,775	98.775,00	0,02
DE000A3E5KG2	5,0000 % TUI AG Wandelanl. 21/28		EUR	6.000.000	0	0	% 91,250	5.475.000,00	1,24
FR001400DV38	2,3750 % Ubisoft Entertainment S.A. Conv. Bonds 22/28		EUR	800.000	800.000	0	% 108,005	864.040,00	0,20
FR0013448412	0,0000 % Ubisoft Entertainment S.A. Zero Conv. Bonds 19/24		STK	10.000	10.000	0	EUR 109,058	1.090.575,00	0,25
XS211946930	3,1250 % United Group B.V. Bonds 20/26 ¹⁾		EUR	1.275.000	0	0	% 91,500	1.166.625,00	0,26
XS211947748	3,6250 % United Group B.V. Bonds 20/28 Reg.S ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 83,503	501.018,00	0,11
FR0013444148	0,0000 % Veolia Environnement S.A. Zero Conv. Bonds 19/25		STK	45.000	0	0	EUR 31,010	1.395.450,00	0,32
XS2289588837	3,2500 % Verisure Holding AB Notes 21/27 Reg.S		EUR	150.000	0	0	% 90,125	135.187,50	0,03

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2541437583	9,2500 % Verisure Holding AB Notes 22/27 Reg.S		EUR	125.000	125.000	0	% 106,318	132.896,88	0,03
XS2581647091	7,1250 % Verisure Holding AB Notes 23/28 Reg.S		EUR	325.000	325.000	0	% 101,250	329.062,50	0,07
XS2287912450	5,2500 % Verisure Midholding AB Notes 21/29 Reg.S ¹⁾		EUR	875.000	0	0	% 87,750	767.812,50	0,17
XS2189766970	3,7500 % Virgin Media Finance PLC Notes 20/30 Reg.S ¹⁾		EUR	425.000	0	0	% 79,375	337.343,75	0,08
AT0000A33R11	2,7500 % voestalpine AG Wandelschuldv. 23/28		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 94,700	1.420.500,00	0,32
FR00140001X1	1,0000 % Voltalia Conv. Obl. 21/25		STK	40.000	0	0	EUR 28,674	1.146.945,51	0,26
XS2486825669	4,2500 % Volvo Car AB MTN 22/28 ¹⁾		EUR	450.000	0	0	% 95,750	430.875,00	0,10
XS2431015655	3,5000 % VZ Secured Financing B.V. Notes 22/32 Reg.S ¹⁾		EUR	775.000	0	0	% 76,995	596.711,25	0,14
XS2272845798	2,8750 % VZ Vendor Financing II B.V. Notes 20/29 Reg.S		EUR	1.300.000	0	0	% 77,500	1.007.500,00	0,23
XS2271356201	5,8750 % Webuild S.p.A. Notes 20/25		EUR	425.000	0	0	% 99,963	424.840,63	0,10
XS2437324333	3,8750 % Webuild S.p.A. Notes 22/26 ¹⁾		EUR	775.000	0	0	% 93,250	722.687,50	0,16
FR001400GVB0	2,6250 % Wendel SE Exchangeable Bonds 23/26		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 97,000	1.455.000,00	0,33
XS2367081523	2,2500 % WMG Acquisition Corp. Notes 21/31 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 78,000	390.000,00	0,09
FR0013439304	0,0000 % Worldline S.A. Zero Conv. Bonds 19/26		STK	21.534	0	0	EUR 89,850	1.934.829,90	0,44
FR0013526803	0,0000 % Worldline S.A. Zero Conv. Bonds 20/25		STK	8.000	0	0	EUR 109,152	873.216,00	0,20
XS2394823418	4,8750 % Zoncolan Bidco S.p.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	750.000	0	0	% 66,500	498.750,00	0,11
CHF								1.075.853,92	0,24
XS2627116176	1,6250 % Swiss Prime Site AG Exch. Notes 23/30		CHF	1.000.000	1.400.000	400.000	% 103,800	1.075.853,92	0,24
GBP								6.737.886,07	1,53
XS2088760157	6,5000 % Brait SE Conv. Notes 19/24		GBP	1.500.000	0	0	% 92,500	1.601.435,81	0,36
XS2332692719	0,7500 % Cornwall (Jersey) Ltd. Conv. Notes 21/26		GBP	1.000.000	0	0	% 68,400	789.464,57	0,18
XS2010324585	1,5000 % Derwent Ldn Cap.No.3 (JE) Ltd. Conv. Notes 19/25		GBP	500.000	0	0	% 92,380	533.119,42	0,12
XS2090948279	0,8750 % Ocado Group PLC Conv. Bonds 19/25		GBP	1.000.000	0	0	% 86,370	996.872,15	0,23
XS2393761692	3,8750 % Ocado Group PLC Notes 21/26 Reg.S		GBP	775.000	0	0	% 83,313	745.226,72	0,17
XS2016141637	2,8750 % PHP Finance (Jersey No.2) Ltd. Exch. Bonds 19/25		GBP	1.000.000	0	0	% 92,000	1.061.852,93	0,24
XS2339232147	1,6250 % WH Smith PLC Conv. Bonds 21/26		GBP	1.000.000	0	0	% 87,500	1.009.914,47	0,23
USD								42.988.542,43	9,76
XS2326545204	8,4500 % Aragvi Finance Intl DAC Nts 21/26 Reg.S		USD	250.000	0	0	% 68,375	161.155,37	0,04
US09857LAN82	0,7500 % Booking Holdings Inc. Conv. Notes 20/25		USD	1.300.000	0	0	% 167,951	2.058.410,96	0,47
NO0012828187	5,0000 % Borr Drilling Ltd Conv. Bonds 23/28		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 122,300	1.153.012,16	0,26
NO0010867948	2,5000 % BW Offshore Ltd. Conv. Bonds 19/24		USD	1.000.000	0	0	% 93,630	882.718,96	0,20
USG3165UAA90	6,8750 % C&W Senior Financing DAC Notes 17/27 Reg.S		USD	550.000	0	0	% 87,800	455.265,39	0,10
US143658BL56	7,6250 % Carnival Corp. Notes 20/26 144A		USD	300.000	0	0	% 97,871	276.810,60	0,06
USP2121VAL82	5,7500 % Carnival Corp. Notes 21/27 Reg.S		USD	175.000	0	0	% 91,057	150.230,74	0,03
USP2253TJR16	3,8750 % Cemex S.A.B. de C.V. Notes 21/31 Reg.S ¹⁾		USD	400.000	0	0	% 83,706	315.663,24	0,07
US29786AAJ51	0,1250 % Etsy Inc. Conv. Notes 19/26		USD	2.000.000	0	0	% 101,145	1.907.136,80	0,43
US29786AAL08	0,1250 % Etsy Inc. Conv. Notes 20/27		USD	1.000.000	0	0	% 79,630	750.730,65	0,17
US298736AL30	0,7500 % Euronet Worldwide Inc. Exch. Notes 19/49		USD	4.500.000	0	0	% 92,400	3.920.052,80	0,89
US345397B850	2,3000 % Ford Motor Credit Co. LLC Notes 22/25		USD	1.075.000	0	0	% 93,637	948.988,76	0,22
XS2189784957	7,0000 % HTA Group Ltd. Notes 20/25 Reg.S		USD	700.000	0	0	% 96,583	637.391,35	0,14
XS2333664717	8,3750 % Interpipe Holdings PLC Notes 21/26 Reg.S		USD	625.000	0	0	% 73,500	433.086,64	0,10
USP59699AB77	4,6250 % Itau Unibanco Holding S.A. Notes 20/Und. Reg.S		USD	300.000	0	0	% 82,091	232.178,28	0,05
US46590XAU00	3,6250 % JBS USA Lux SA/Food Co./F.Inc. Notes 21/32		USD	350.000	350.000	0	% 79,840	263.448,67	0,06
USP6638MAB74	3,7500 % Metalsa S.A. de C.V. Notes 21/31 Reg.S		USD	1.000.000	0	0	% 73,874	696.469,31	0,16
US63845RAB33	2,5000 % National Vision Holdings Inc. Conv. Nts 20/25		USD	100.000	0	0	% 95,860	90.374,28	0,02
USU63768AA01	7,0000 % NBM US Holdings Inc. Notes 19/26 Reg.S ¹⁾		USD	500.000	0	0	% 98,946	466.418,40	0,11
US679295AF24	0,3750 % Okta Inc. Conv. Nts 20/26		USD	1.000.000	0	0	% 87,610	825.963,99	0,19

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US71654QDH20	6,8750 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) Notes 20/25		USD	450.000	0	0	% 95,935	407.002,45	0,09
US723787AP23	0,2500 % Pioneer Natural Resources Co. Exch. Notes 20/25		USD	3.000.000	0	0	% 250,540	7.086.075,23	1,61
US74348TAT97	6,3750 % Prospect Capital Corp. Conv. Notes 19/25		USD	2.000.000	0	0	% 99,668	1.879.287,26	0,43
XS2385150334	6,3750 % Province of Buenos Aires Bonds 21/37 Reg.S ²⁾		USD	505.010	0	0	% 33,500	159.496,89	0,04
US78409VAR50	2,3000 % S&P Global Inc. Notes 20/60		USD	300.000	0	0	% 49,115	138.911,57	0,03
XS2546248373	4,5000 % Sasol Financing USA LLC Exch. Bonds 22/27		USD	1.400.000	2.600.000	1.200.000	% 98,983	1306.466,48	0,30
US844741BG22	1,2500 % Southwest Airlines Co. Exch. Notes 20/25		USD	8.200.000	0	0	% 100,265	7.751.230,32	1,76
USU85969AE07	4,0000 % Stillwater Mining Co. Notes 21/26 Reg.S ¹⁾		USD	800.000	0	200.000	% 86,865	655.152,26	0,15
USU85969AF71	4,5000 % Stillwater Mining Co. Notes 21/29 Reg.S		USD	500.000	0	300.000	% 76,906	362.524,75	0,08
US88167AAN19	7,1250 % Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. Notes 19/25		USD	250.000	0	0	% 100,391	236.614,97	0,05
US92214XAB29	4,0000 % Varex Imaging Corp Exch. Notes 20/25		USD	200.000	0	0	% 113,641	214.275,48	0,05
US92826CAQ50	2,0000 % VISA Inc. Notes 20/50		USD	350.000	0	0	% 54,950	181.318,94	0,04
US958102AP07	1,5000 % Western Digital Corp. Conv. Notes 18/24		USD	5.500.000	0	0	% 97,955	5.079.216,56	1,15
US92940WAD11	0,0000 % Wix.com Ltd. Zero Exch. Nts 20/25		USD	250.000	0	0	% 88,885	209.496,09	0,05
US98877DAD75	6,8750 % ZF North America Capital Inc. Notes 23/28 144A		USD	150.000	150.000	0	% 97,632	138.067,74	0,03
US98980GAB86	0,1250 % Zscaler Inc. Exch. Notes 20/25		USD	500.000	0	0	% 118,353	557.898,09	0,13
XS2239639433	1,6250 % VK Co. Ltd. Exch. Bonds 20/25		USD	2.600.000	0	0	% 0,000	0,00	0,00
Neuemissionen								4.084.561,80	0,92
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen								783.061,80	0,17
Verzinsliche Wertpapiere								783.061,80	0,17
EUR								589.500,00	0,13
XS2681940297	7,0000 % Webuild S.p.A. Notes 23/28		EUR	600.000	600.000	0	% 98,250	589.500,00	0,13
USD								193.561,80	0,04
NO0012829755	9,5000 % Borr Drilling Ltd Bonds 23/26		USD	200.000	200.000	0	% 102,656	193.561,80	0,04
Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen								3.301.500,00	0,75
Verzinsliche Wertpapiere								3.301.500,00	0,75
EUR								3.301.500,00	0,75
CH1239464675	3,7500 % MBT Systems GmbH Umtausch-Anl. M6YA 23/29		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 88,500	1.327.500,00	0,30
XS2693301124	3,2500 % Snam S.p.A. Exchangeable Notes 23/28		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 98,700	1.974.000,00	0,45
Nichtnotierte Wertpapiere								19.613.241,34	4,45
Verzinsliche Wertpapiere								19.613.241,34	4,45
EUR								16.801.047,50	3,81
XS1964638107	4,3750 % Clarios GI LP/Clar.US F.C.Inc Notes 19/26 Reg.S		EUR	525.000	0	0	% 96,250	505.312,50	0,11
XS2339426004	0,0000 % Diasorin S.p.A. Zero Conv. Bonds 21/28		EUR	2.000.000	0	0	% 77,545	1.550.900,00	0,35
XS2637952610	2,9500 % ENI S.p.A. Conv. Bonds 23/30		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 101,335	2.533.375,00	0,57
XS2630795404	3,5000 % Lagfin S.C.A. Exch. Bonds 23/28		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 96,750	2.902.500,00	0,66
CH1118223390	3,5000 % MBT Systems GmbH Umtausch-Anl. M6YA 21/27		EUR	2.300.000	0	0	% 98,880	2.274.240,00	0,52
XS2161819722	1,7500 % Nexi S.p.A. Exchangeable Notes 20/27		EUR	2.000.000	0	0	% 86,420	1.728.400,00	0,39
XS2305842903	0,0000 % Nexi S.p.A. Zero Exch. Bonds 21/28		EUR	5.000.000	0	0	% 76,375	3.818.750,00	0,87
XS2294704007	0,0000 % Prysmian S.p.A. Zero Conv. Bonds 21/26		EUR	1.400.000	0	0	% 106,255	1.487.570,00	0,34
USD								2.812.193,84	0,64
XS2348411062	0,7000 % Abu Dhabi National Oil Co. Exch. Bonds 21/24		USD	3.000.000	0	0	% 96,250	2.722.258,89	0,62
USL01801AA41	6,0000 % Altice France Holding S.A. Notes 20/28 Reg.S		USD	200.000	0	0	% 47,697	89.934,95	0,02
Summe Wertpapiervermögen								EUR 436.527.428,58	98,99
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								82.987,65	0,02
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Dez. 23		XCME	USD	Anzahl -10				82.987,65	0,02
Summe der Aktienindex-Derivate								EUR 82.987,65	0,02

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
	EURO Bund Future (FGBL) Dez. 23	XEUR	EUR	8.000.000				-95.453,57	-0,03
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Dez. 23	XCBT	USD	1.000.000				-73.210,00	-0,02
								-22.243,57	-0,01
	Summe der Zins-Derivate						EUR	-95.453,57	-0,03
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
	CHF/EUR 18.300.000,00	OTC						146.801,47	0,03
	GBP/EUR 7.360.000,00	OTC						24.700,01	0,01
	SEK/EUR 5.400.000,00	OTC						-14.935,13	0,00
	USD/EUR 47.000.000,00	OTC						-371.900,67	-0,08
	Summe der Devisen-Derivate						EUR	-215.334,32	-0,04
Swaps									
Credit Default Swaps (CDS)									
Protection Buyer									
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V2 5Y / CITIGLMD_FRA 20.12.2027	OTC	EUR	5.000.000				-490.919,49	-0,11
								-490.919,49	-0,11
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S39 V2 5Y / BOFA5CEUR 20.06.2028	OTC	EUR	5.000.000				-226.538,96	-0,05
	Summe der Swaps						EUR	-490.919,49	-0,11
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.318.941,81			% 100,000	1.318.941,81	0,30
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	24.139,18			% 100,000	2.142,58	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	2.899,55			% 100,000	252,30	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	4.025,13			% 100,000	4.171,92	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	1.878,70			% 100,000	2.168,37	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	638,55			% 100,000	76,89	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	243.333,00			% 100,000	1.542,03	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SGD	411,34			% 100,000	284,78	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	210.465,61			% 100,000	198.421,43	0,04
	Summe der Bankguthaben¹⁾						EUR	1.528.002,11	0,34
	Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR	1.528.002,11	0,34
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	3.154.207,74				3.154.207,74	0,72
	Dividendenansprüche		EUR	29.930,86				29.930,86	0,01
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	212.182,80				212.182,80	0,05
	Einschüsse (Initial Margins)		USD	132.000,00				124.446,12	0,03
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	20.368,50				20.368,50	0,00
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	2.860,17				2.860,17	0,00
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	500.000,00				500.000,00	0,11
	Sonstige Forderungen		EUR	32.519,96				32.519,96	0,01
	Summe der sonstigen Vermögensgegenstände						EUR	4.076.516,15	0,93
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verwaltungsvergütung		EUR	-318.002,52				-318.002,52	-0,07
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-108.823,07				-108.823,07	-0,02
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-943,83				-943,83	0,00
	Kostenpauschale		EUR	-42.400,39				-42.400,39	-0,01
	Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-1.222,50				-1.222,50	0,00
	Summe der sonstigen Verbindlichkeiten						EUR	-471.392,31	-0,10
Fondsvermögen									
	Umlaufende Anteile Klasse CF						EUR	440.941.834,80	100,00
	Umlaufende Anteile Klasse TF						STK	4.172.537,000	
	Anteilwert Klasse CF						STK	1.928.431,000	
	Anteilwert Klasse TF						EUR	73,47	
	Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)						EUR	69,68	
	Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								98,99
									-0,16

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

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

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

³⁾ In dieser Position enthalten sind die für sonstige Derivate hinterlegten Sicherheiten.

Zusätzliche Angaben zu den Derivaten

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure in EUR

92.551.803,52

Deka-Wandelanleihen

Vertragspartner der derivativen Geschäfte

Barclays Bank Ireland PLC
 BofA Securities Europe S.A.
 Citigroup Global Markets Europe AG
 DekaBank Deutsche Girozentrale
 DekaBank Deutsche Girozentrale - Niederlassung Luxemburg
 J.P. Morgan SE

Gesamtbetrag der bei Derivaten hinterlegten Sicherheiten

Euro-Guthaben bei:

BofA Securities Europe S.A.	260.000,00
Citigroup Global Markets Europe AG	240.000,00

Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen

Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
7,2500 % Air France-KLM S.A. MTN 23/26	EUR 600.000		615.330,00	
8,1250 % Air France-KLM S.A. MTN 23/28	EUR 700.000		731.157,00	
3,0000 % Ardagh Metal Packaging Fin.PLC Notes 21/29 Reg.S	EUR 450.000		342.337,50	
3,8750 % Cemex S.A.B. de C.V. Notes 21/31 Reg.S	USD 400.000		315.663,24	
8,0980 % Conceria Pasubio S.p.A. FLR Notes 21/28 Reg.S	EUR 553.000		539.797,13	
2,0000 % Duffry One B.V. Notes 19/27	EUR 300.000		265.500,00	
7,9750 % EVOCA S.p.A. FLR Notes 19/26 Reg.S	EUR 300.000		296.325,00	
6,1250 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 23/28	EUR 525.000		542.587,50	
3,7500 % Forvia SE Notes 20/28	EUR 500.000		449.172,50	
5,3750 % Goldstory S.A.S. Notes 21/26 Reg.S	EUR 100.000		97.640,00	
2,7500 % Goodyear Europe B.V. Notes 21/28 Reg.S	EUR 400.000		331.800,00	
5,6250 % Iliad Holding S.A.S. Notes 21/28 Reg.S	EUR 600.000		559.500,00	
6,6250 % INEOS Finance PLC Notes 23/28 Reg.S	EUR 225.000		221.062,50	
3,7500 % INEOS Quattro Finance 1 PLC Notes 21/26 Reg.S	EUR 125.000		111.718,75	
4,5000 % Jaguar Land Rover Automotive Notes 18/26 Reg.S	EUR 700.000		671.650,00	
4,5000 % Jaguar Land Rover Automotive Notes 21/28 Reg.S	EUR 400.000		351.900,00	
5,7500 % Loxam S.A.S. Notes 19/27 Reg.S	EUR 500.000		465.625,00	
9,0950 % Monitchem Holdco 3 S.A. FLR Nts 23/28 Reg.S	EUR 350.000		348.775,00	
7,0000 % NBM US Holdings Inc. Notes 19/26 Reg.S	USD 400.000		373.134,72	
3,3750 % Novelis Sheet Ingot GmbH Anleihe 21/29 Reg.S	EUR 250.000		216.193,75	
2,0000 % Q-Park Holding I B.V. Notes 20/27 Reg.S	EUR 100.000		86.500,00	
8,1000 % Ren10 Holding AB FLR Notes 22/27 Reg.S	EUR 383.000		383.957,50	
9,0950 % Rimini BidCo S.p.A. FLR Notes 21/26 Reg.S	EUR 1.950.000		1.961.914,50	
3,1250 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 21/28	EUR 400.000		364.000,00	
4,2500 % Stellantis N.V. MTN 23/31	EUR 1.925.000		1.842.841,00	
4,0000 % Stillwater Mining Co. Notes 21/26 Reg.S	USD 720.000		589.637,03	
6,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 23/Und.	EUR 300.000		296.700,00	
3,7500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 21/27	EUR 900.000		814.500,00	
3,7500 % TI Automotive Finance PLC Notes 21/29 Reg.S	EUR 311.000		254.864,50	
3,1250 % United Group B.V. Bonds 20/26	EUR 500.000		457.500,00	
3,6250 % United Group B.V. Bonds 20/28 Reg.S	EUR 50.000		41.751,50	
5,3750 % Valéo S.E. MTN 22/27	EUR 700.000		699.825,00	
5,2500 % Verisure Midholding AB Notes 21/29 Reg.S	EUR 875.000		767.812,50	
3,6250 % Victoria PLC Notes 21/26 Reg.S	EUR 450.000		355.500,00	
3,7500 % Virgin Media Finance PLC Notes 20/30 Reg.S	EUR 400.000		317.500,00	
4,2500 % Volvo Car AB MTN 22/28	EUR 450.000		430.875,00	
3,5000 % VZ Secured Financing B.V. Notes 22/32 Reg.S	EUR 600.000		461.970,00	
3,8750 % Webuild S.p.A. Notes 22/26	EUR 775.000		722.687,50	
3,7500 % ZF Finance GmbH MTN 20/28	EUR 700.000		628.250,00	
2,2500 % ZF Finance GmbH MTN 21/28	EUR 200.000		169.500,00	
6,6250 % TK Elevator Holdco GmbH Anl. 20/28 Reg.S	EUR 175.000		138.206,25	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:			19.633.161,87	19.633.161,87

Kontrahenten bei Wertpapier-Darlehen:

DekaBank Deutsche Girozentrale 19.633.161,87 EUR

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen empfangenen Sicherheiten:

Renten und rentenähnliche Wertpapiere 28.100.425,60 EUR

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Aktien, Renten und Derivate per: 28./29.09.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 29.09.2023

Deka-Wandelanleihen

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.09.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,86641	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,26640	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,49235	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,96482	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06070	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,44440	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	157,80000	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,30440	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

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

OTC

Over-the-Counter

Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 30.09.2023 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Devisentermingeschäfte (Verkauf)	CHF/EUR	18,3 Mio.	EUR	19.029.463,72
	GBP/EUR	7,4 Mio.	EUR	8.479.432,35
	SEK/EUR	5,4 Mio.	EUR	469.777,73
	USD/EUR	47,0 Mio.	EUR	44.215.552,34
			EUR	72.194.226,14
Finanztermingeschäfte				
- gekaufte Terminkontrakte auf Renten			EUR	11.288.869,76
- verkaufte Terminkontrakte auf Indices			EUR	2.044.640,33

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	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
	19.633.161,87	4,45

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	19.633.161,87	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	absolute Beträge in EUR
unbefristet	19.633.161,87

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.

Von den Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten sowie ggf. nach Restlaufzeit variieren. Die Haircuts fallen für die aufgeführten Wertpapierkategorien wie folgt aus:

- Bankguthaben 0%
- Aktien 5% - 40%
- Renten 0,5% - 30%

Darüber hinaus kann für Sicherheiten in einer anderen Währung als der Fondswährung ein zusätzlicher Wertabschlag von bis zu 10%-Punkten angewandt werden. In besonderen Marktsituationen (z.B. Marktturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindex (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX 50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder des GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter www.eurexrepo.com entnommen werden.

Von dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag in Höhe von 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

Deka-Wandelanleihen

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR
GBP

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

unbefristet

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

28.100.425,60

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds
Kostenanteil des Fonds
Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

30.723,53
10.138,76
10.138,76

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00
33,00
33,00

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften gerechnet.

Der Ertragsanteil der KVG entspricht maximal dem Kostenanteil des Fonds. Der Kostenanteil der KVG ist auf Ebene des Sondervermögens im Einzelnen nicht bestimmbar.

Geschäftsbedingt gibt es bei Principalgeschäften keine expliziten Kosten durch Dritte. Sofern diese Geschäfte getätigt werden, sind Ertrags- und Kostenanteile Dritter über die in den Wertpapierleihesätzen enthaltenen Margen abgedeckt und damit bereits im Ertragsanteil des Fonds berücksichtigt. Bei Agencygeschäften werden Erträge und Kosten Dritter über eine Gebührenaufteilung (Fee split) definiert. Hier beträgt der Ertragsanteil des Agenten zwischen 20% und 35% vom Bruttoleihesatz.

Kosten Dritter als Agent der KVG werden nicht auf Ebene des Sondervermögens offengelegt.

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

4,50% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen

Wells Fargo & Co.
Deutsche Bank AG
HSBC Holdings PLC
KBC Bank N.V.
AstraZeneca PLC
Toyota Motor Credit Corp.
BNP Paribas S.A.
The Bank of Nova Scotia
Münchener Hypothekbank eG
NRW.BANK

absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR

10.631.230,04
8.733.332,85
2.430.801,36
1.753.073,00
1.279.185,51
1.147.707,75
770.389,04
517.938,12
448.525,41
218.877,31

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

Clearstream Banking Frankfurt 11.153.808,57 EUR
J.P.Morgan AG Frankfurt 16.946.617,03 EUR

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.

Deka-Wandelanleihen

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
EUR				
NL0000235190	Airbus SE Aandelen aan toonder	STK	0	4.000
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG Namens-Aktien	STK	0	3.250
USD				
LR0008862868	Royal Caribbean Cruises Ltd. Reg.Shares	STK	535	535
Verzinsliche Wertpapiere				
CHF				
CH0536893594	2,7500 % Zur Rose Finance B.V. Wandelanleihe 20/25	CHF	0	1.000.000
EUR				
XS2657613720	3,7500 % American Honda Finance Corp. MTN S.A 23/27	EUR	550.000	550.000
XS2085860844	8,5260 % Asseblin Financing AB (Publ) FLR Notes 19/25 R.S	EUR	0	525.000
XS2112340679	3,5000 % Banijay Entertainment S.A.S. Notes 20/25 Reg.S	EUR	0	150.000
FR001400D0F9	4,1250 % Carrefour S.A. MTN 22/28	EUR	600.000	600.000
XS2497520887	5,3370 % Celanese US Holdings LLC Notes 22/29	EUR	0	1.275.000
XS1750026186	1,5000 % Cellnex Telecom S.A. Conv. MT Bds 18/26	EUR	3.000.000	5.000.000
DE000A254Y84	0,2500 % Delivery Hero SE Wandelanl. Tr.A 20/24	EUR	0	1.500.000
DE000A3H2WP2	0,8750 % Delivery Hero SE Wandelanl. Tr.A 20/25	EUR	0	3.000.000
AT0000A208R5	4,8750 % Egger Holzwerkstoffe GmbH Var. Schuldv. 18/Und.	EUR	0	1.000.000
XS1940192039	2,2500 % Just Eat Takeaway.com N.V. Exchangeable Bds 19/24	EUR	0	1.600.000
XS2656537664	4,5000 % Leasys S.p.A. MTN 23/26	EUR	250.000	250.000
XS2528347166	3,9490 % Nat.Gr.Elec.Distr.(East M.)PLC MTN 22/32	EUR	0	600.000
XS2121408996	5,5000 % Piraeus Financial Holdings SA FLR MTN 20/30	EUR	0	200.000
XS2577396430	4,2500 % Pirelli & C. S.p.A. MTN 23/28	EUR	275.000	275.000
XS2615940215	4,5000 % Porsche Automobil Holding SE MTN 23/28	EUR	450.000	450.000
XS2582358789	5,6250 % Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski FLR Pref. MTN 23/26	EUR	375.000	375.000
SE0013101219	10,0240 % SGL International A/S FLR Bonds 19/24	EUR	0	800.000
FR0013183571	4,1250 % Tereos Finance Groupe I Obl. 16/23	EUR	0	300.000
FR0014003G27	1,6250 % Verallia SA Notes 21/28	EUR	0	1.000.000
XS2675884733	7,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. FLR Notes 23/Und.	EUR	300.000	300.000
USD				
XS2220527001	0,0000 % ADM AG Holding Ltd. Zero Conv. Notes 20/23	USD	0	600.000
XS2331967112	7,3750 % BIM Land JSC Bonds 21/26	USD	0	700.000
USV3855GAB69	5,9500 % Greenko Solar (Mauritius) Ltd. Notes 19/26 Reg.S	USD	0	500.000
USP5875NAB93	5,1250 % Latin America Power Ltda. Notes 21/33 Reg.S	USD	0	625.000
USY7758EEF44	5,1000 % Shriram Finance Ltd. MTN 20/23 Reg.S	USD	0	350.000
XS2211997239	0,0000 % STMicroelectronics N.V. Zero Exch. Bds Tr.B 20/27	USD	600.000	2.000.000
USY8190DAA55	2,8750 % Summit Digital Infrastructure Notes 21/31 Reg.S	USD	0	500.000
XS1750996206	5,5000 % Turkiye Sinai Kalkinma Bank.AS MTN 18/23	USD	0	575.000
USG9T27HAB07	8,0000 % Vedanta Resources Fin. II PLC Notes 19/23 Reg.S	USD	0	500.000
USG9T27HAA24	9,2500 % Vedanta Resources Fin. II PLC Notes 19/26 Reg.S	USD	0	600.000
USV9667MAA00	13,8750 % Vedanta Resources Fin. II PLC Notes 20/24 Reg.S	USD	0	300.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS2644414125	5,2500 % A1 Towers Holding GmbH Notes 23/28	EUR	500.000	500.000
XS2249892535	2,6250 % Adevinata ASA Notes 20/25 Reg.S	EUR	0	425.000
XS1533914591	4,1250 % Adler Pelzer Holding GmbH Notes 17/24 Reg.S	EUR	0	700.000
FR001400DU47	6,5000 % Air France-KLM S.A. FLR Conv. Bds 22/Und.	EUR	500.000	500.000
XS2054539627	2,5000 % Altice France S.A. Notes 19/25 Reg.S	EUR	0	700.000
XS2110799751	2,1250 % Altice France S.A. Notes 20/25 Reg.S	EUR	0	575.000
FR0013284130	0,0000 % Archer Obligations S.A. Zero Exch.Bonds 17/23	EUR	0	1.000.000
XS2037757684	5,1250 % ASR Media and Sponsorship SpA Notes 19/24 Reg.S	EUR	0	500.000
XS2619047728	9,3750 % Benteler International AG Notes 23/28 Reg.S	EUR	175.000	175.000
XS2125168729	2,3750 % Catalent Pharma Solutions Inc. Notes 20/28 Reg.S	EUR	0	700.000
XS2356316872	1,7500 % CECONOMY AG Anl. 21/26	EUR	0	800.000
XS2021212332	0,5000 % Cellnex Telecom S.A. Conv. MT Bds 19/28	EUR	0	5.000.000
XS2033245023	7,1970 % Cirsia Finance International FLR Notes 19/25 Reg.S	EUR	0	675.000
XS1466161350	0,5000 % Citigroup Gl.M.Fdg Lux. S.C.A. Exch. MTN 16/23	EUR	400.000	3.000.000
XS1841967356	7,0000 % DKT Finance ApS Bonds 18/23 Reg.S	EUR	0	500.000
XS1816296062	4,5000 % ENERGO-PRO a.s. Notes 18/24	EUR	0	300.000
FR0014003RF1	0,0000 % Engie S.A. Zero Exch. MTN 21/24	STK	0	25.559
XS2407361109	8,1250 % Gamma Bondco S.à.r.l. Notes 21/26 Reg.S	EUR	0	1.000.000
XS2198388592	9,2500 % HT Troplast GmbH Anl. 20/25 Reg.S	EUR	0	900.000
XS1500463358	1,2500 % Indra Sistemas S.A. Conv. Bonds 16/23 Reg.S	EUR	0	2.200.000
XS2262838381	5,5000 % IPD 3 B.V. Notes 20/25 Reg.S	EUR	0	500.000
XS2463546007	9,1720 % Kapla Holding S.A.S FLR Nts 23/27 Reg.S	EUR	200.000	200.000
XS2208646690	6,2500 % Lottomatica S.p.A. Bonds 20/25 Reg.S	EUR	0	1.000.000
XS2321537255	5,1250 % Lottomatica S.p.A. Bonds 21/25 Reg.S	EUR	0	625.000
XS2057884921	5,2500 % Monitchem Holdco 3 S.A. Notes 19/25 Reg.S	EUR	0	400.000
XS1690644668	3,5000 % Nidda Healthcare Holding GmbH Anl. 17/24 Reg.S	EUR	0	900.000
XS217173799	3,5000 % Nidda Healthcare Holding GmbH Anleihe 20/24 Reg.S	EUR	0	200.000
XS1811852521	7,0000 % Nitrogenmuvек Vegyipari Zrt. Notes 18/25 Reg.S	EUR	0	400.000
XS1577963058	4,5000 % Norican A/S Bonds 17/23	EUR	0	600.000
FR0013418795	0,3750 % Orpea Conv. Bonds 19/27	STK	0	8.000
XS1849464323	3,7500 % Playtech PLC Notes 18/23	EUR	0	500.000

Deka-Wandelanleihen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2176872849	3,5000 % PPF Telecom Group B.V. MTN 20/24	EUR	0	550.000
XS2552369469	4,6250 % Redeia Corporacion S.A. FLR Notes 23/Und.	EUR	500.000	500.000
FR0013200995	0,1250 % Rémy Cointreau S.A. Obl. Conv. 16/26	STK	0	5.000
XS2239061927	3,2500 % Republik San Marino Obbl. 21/24	EUR	0	700.000
XS2679898184	4,8750 % REWE International Finance BV Notes 23/30	EUR	500.000	500.000
XS2310951103	3,6250 % Sappi Papier Holding GmbH Notes 21/28 Reg.S	EUR	0	400.000
XS2010038904	4,1250 % SAZKA Group AS Notes 19/24	EUR	0	800.000
XS2070055095	6,3750 % Schoeller Packaging B.V. Notes 19/24 Reg.S	EUR	0	1.200.000
DE000A3KS5R1	5,5000 % SIGNA Development Fin.S.C.S. Notes 21/26 Reg.S	EUR	0	500.000
XS2010025836	7,2500 % Stena International S.A. Notes 23/28 Reg.S	EUR	250.000	250.000
XS1681774888	5,5170 % Tendam Brands S.A.U. FLR Notes 17/24 Reg.S	EUR	0	300.000
BE6315129419	4,3750 % The House of Finance Notes 19/26	EUR	0	300.000
XS2286041947	3,0000 % Wintershall Dea Finance 2 B.V. FLR Bonds 21/Und.	EUR	0	700.000
USD				
USP2253TJP59	7,3750 % Cemex S.A.B. de C.V. Notes 20/27 Reg.S	USD	0	625.000
USC35898AB82	7,8750 % Frontera Energy Corp. Notes 21/28 Reg.S	USD	0	600.000
US452327AK54	0,0000 % Illumina Inc. Zero Conv. Nts 18/23	USD	0	5.600.000
USL56608AP43	3,6250 % JBS USA Lux SA/Food Co./F.Inc. Notes 21/32 Reg.S	USD	0	350.000
US50202MAB81	0,2500 % Li Auto Inc. Exch. Notes 21/28	USD	0	800.000
US530307AA53	2,7500 % Liberty Broadband Corp. Exch. Debts 20/50 144A	USD	0	250.000
US95017AF11	1,6250 % Microchip Technology Inc. Conv. Notes 17/27	USD	0	1.000.000
USG7052TAF87	9,7500 % Petrofac Ltd. Notes 21/26 Reg.S	USD	0	325.000
US718286CY18	4,6250 % Philippinen Bonds 23/28	USD	200.000	200.000
US718286CW51	5,0000 % Philippinen Bonds 23/33	USD	650.000	650.000
US718286CX35	5,5000 % Philippinen Bonds 23/48	USD	225.000	225.000
US780153BB73	4,2500 % Royal Caribbean Cruises Ltd. Conv. Nts 20/23	USD	0	500.000
US98877DAE58	7,1250 % ZF North America Capital Inc. Notes 23/30 144A	USD	150.000	150.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000A2LQRW5	0,0500 % adidas AG Wandelschuldv. 18/23	EUR	0	3.000.000
XS1783932863	1,2500 % Ence Energia y Celulosa S.A. Conv. Bds 18/23 Reg.S	EUR	0	2.500.000
XS1321004118	0,0000 % Iberdrola International B.V. Conv. MTN 15/22	EUR	0	5.500.000
FR0013450483	0,0000 % Kering S.A. Zero Exchang. MTN 19/22	EUR	0	2.500.000
DE000A185XT1	2,0000 % Klöckner & Co Fin. Serv. S.A. Wandelanl. 16/23	EUR	0	2.000.000
XS2198575271	2,0000 % Lagfin S.C.A. Exch. Bonds 20/25	EUR	200.000	800.000
XS2208645882	9,1770 % Lottomatica S.p.A. FLR Nts 20/25 Reg.S	EUR	0	700.000
NO0012847831	9,4940 % Skill BidCo ApS FLR Bonds 23/28	EUR	876.000	876.000
USD				
FR0013261062	0,0000 % Carrefour S.A. Zero Exch. Bonds 17/23	USD	1.600.000	6.000.000
XS1327914062	0,5000 % TotalEnergies SE Conv. Obl. 15/22	USD	0	4.600.000
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
DE000DK2EAN3	Deka-Globale Renten High Inco. Inh.-Anteile S(A)	ANT	0	50.000

Deka-Wandelanleihen

Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Geschäftsjahres		EUR
Mittelzuflüsse	26.466.416,42	439.094.690,50
Mittelrückflüsse	-54.402.601,52	
Mittelzuflüsse /-rückflüsse (netto)		-27.936.185,10
Ertragsausschüttung		-3.954.608,92
Ertragsausgleich		394.208,59
Ordentlicher Ertragsüberschuss		5.615.047,74
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich) ¹⁾		3.106.172,04
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses ²⁾		24.622.509,95
Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		440.941.834,80

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse CF am Beginn des Geschäftsjahres	4.467.722,000
Anzahl der ausgegebenen Anteile der Klasse CF	187.145,000
Anzahl der zurückgezahlten Anteile der Klasse CF	482.330,000
Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse CF am Ende des Geschäftsjahres	4.172.537,000

Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse TF am Beginn des Geschäftsjahres	2.023.276,000
Anzahl der ausgegebenen Anteile der Klasse TF	187.765,000
Anzahl der zurückgezahlten Anteile der Klasse TF	282.610,000
Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse TF am Ende des Geschäftsjahres	1.928.431,000

Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich

Anteilklasse CF

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR	Anteilumlauf Stück
2020	330.369.783,97	75,22	4.391.957,000
2021	394.011.649,63	83,30	4.730.153,000
2022	307.203.427,45	68,76	4.467.722,000
2023	306.559.135,55	73,47	4.172.537,000

Vergangenheitsbezogene Werte gewähren keine Rückschlüsse für die Zukunft.

Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich

Anteilklasse TF

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR	Anteilumlauf Stück
2020	123.098.732,70	71,36	1.725.149,000
2021	153.154.061,22	78,99	1.938.787,000
2022	131.891.263,05	65,19	2.023.276,000
2023	134.382.699,25	69,68	1.928.431,000

Vergangenheitsbezogene Werte gewähren keine Rückschlüsse für die Zukunft.

Deka-Wandelanleihen

Ertrags- und Aufwandsrechnung

für den Zeitraum vom 01.10.2022 bis 30.09.2023 (inkl. Ertragsausgleich)

	EUR
Erträge	
Dividenden	514.219,03
Wertpapierzinsen	9.578.963,61
Zinsen aus Liquiditätsanlagen	68.052,34
davon aus negativen Einlagezinsen	-17.284,96
davon aus positiven Einlagezinsen	169.221,12
Erträge aus Investmentanteilen	183.000,00
Erträge aus Wertpapierleihe	30.723,53
Sonstige Erträge ^{***)}	920.953,60
Ordentlicher Ertragsausgleich	-361.362,99
Erträge insgesamt	10.934.549,12
Aufwendungen	
Verwaltungsvergütung	4.041.988,18
Vertriebsprovision	659.106,80
Taxe d'Abonnement	223.583,77
Zinsen aus Kreditaufnahmen	17.048,21
Aufwendungen aus Wertpapierleihe	10.138,76
Kostenpauschale ^{*)}	538.931,87
Sonstige Aufwendungen ^{****)}	10.031,32
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	10.031,32
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-181.327,53
Aufwendungen insgesamt	5.319.501,38
Ordentlicher Ertragsüberschuss	5.615.047,74
Netto realisiertes Ergebnis ^{*) ****)}	3.320.345,17
Außerordentlicher Ertragsausgleich	-214.173,13
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)	3.106.172,04
Ertragsüberschuss	8.721.219,78
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses ^{*)}	24.622.509,95
Ergebnis des Geschäftsjahres	33.343.729,73

Gemäß Art. 15 Grundreglement in Verbindung mit Art. 7 Sonderreglement beträgt die Ausschüttung für die Anteilklasse CF EUR 1,27 je Anteil und für die Anteilklasse TF EUR 1,21 je Anteil. Die Ausschüttungen werden per 24. November 2023 mit Beschlussfassung vom 14. November 2023 vorgenommen.

Die vorgenannten Aufwendungen der Anteilklasse CF betragen bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen (Gesamtkostenquote / laufende Kosten (Ongoing Charges)) 1,07%.

Die vorgenannten Aufwendungen der Anteilklasse TF betragen bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen (Gesamtkostenquote / laufende Kosten (Ongoing Charges)) 1,55%.

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt: 55.966,04 EUR
- davon aus EMIR-Kosten: 18.891,02 EUR

Die Ausgabe von Anteilen der Anteilklasse CF erfolgt zum Anteilwert zuzüglich eines Ausgabeaufschlages.

Die Ausgabe von Anteilen der Anteilklasse TF erfolgt zum Anteilwert. Ein Ausgabeaufschlag wird nicht erhoben. Die Vertriebsstellen erhalten aus dem Fondsvermögen der Anteilklasse TF eine Vertriebsprovision.

*) Ergebnis-Zusammensetzung:
Netto realisiertes Ergebnis aus: Wertpapier-, Devisen-, Devisentermin-, Finanztermin- und Swapgeschäften
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses aus: Wertpapier-, Devisen-, Devisentermin-, Finanztermin- und Swapgeschäften

**) Für das Sondervermögen ist gemäß den Vertragsbedingungen eine an die Verwaltungsgesellschaft abzuführende Kostenpauschale von 0,12 % p.a. vereinbart. Davon entfallen bis zu 0,10 % p.a. auf die Verwahrstelle und bis zu 0,06 % p.a. auf Dritte (Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten sowie Sonstige).

***) In dieser Position enthalten sind im Wesentlichen Ersatzleistungen aus Zinsen.

****) In dieser Position enthalten sind ausschließlich Researchkosten.

*****) In diesem Betrag enthalten sind Schadensersatzzahlungen (abzüglich einer marktüblichen Gebühr) aus de2 Class-Action-Verfahren gegen Ageas SA/NV (Fortis) und FX-Benchmark Rates.

Deka-Wandelanleihen

Absoluter VaR

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Verwaltungsgesellschaft den **absoluten Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an. Die Limitauslastung berechnet sich als Verhältnis des VaR des Fonds zum Nettofondsvermögen.

Maximalgrenze: 20,00%

Limitauslastung für das Marktrisiko

minimale Auslastung:	1,50%
maximale Auslastung:	5,86%
durchschnittliche Auslastung:	2,69%

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 01.10.2022 bis 30.09.2023 auf Basis der Methode einer Monte Carlo Simulation berechnet. Der VaR wird mit einem Konfidenzintervall von 99%, einer Haltedauer von 20 Tagen sowie einer Zeitreihe von einem Jahr berechnet.

Die Verwaltungsgesellschaft berechnet die Hebelwirkung in Übereinstimmung mit der Pressemitteilung 12/29 der CSSF v. 31.07.2012 sowohl nach dem Ansatz der Summe der Nominalen („Bruttomethode“) als auch auf Grundlage des Commitment-Ansatzes („Nettomethode“). Anteilinhaber sollten beachten, dass Derivate für verschiedene Zwecke eingesetzt werden können, insbesondere für Absicherungs- und Investmentzwecke. Die Berechnung der Hebelwirkung nach der Bruttomethode unterscheidet nicht zwischen den unterschiedlichen Zielsetzungen des Derivateinsatzes und liefert daher keine Indikation über den Risikogehalt des Fonds. Eine Indikation des Risikogehaltes des Fonds wird dagegen durch die Nettomethode gegeben, da sie auch den Einsatz von Derivaten zu Absicherungszwecken angemessen berücksichtigt.

Hebelwirkung im Geschäftsjahr

(Nettomethode)	(Bruttomethode)
0,6	0,8

Anhang.

Angaben zu Bewertungsverfahren

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

Investmentanteile

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

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen für die Tätigkeit als Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf die Hauptverwaltung und die Anlagenverwaltung ein Entgelt („Verwaltungsvergütung“), das anteilig monatlich nachträglich auf das durchschnittliche Netto-Fondsvermögen während des betreffenden Monats zu berechnen und auszuzahlen ist.

Die Verwaltungsgesellschaft kann dem Fondsvermögen bis zur Höhe von jährlich 0,10% des durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens die an Dritte gezahlten Vergütungen und Entgelte belasten für

- die Verwaltung von Sicherheiten für Derivate-Geschäfte (sog. Collateral-Management), sowie
- Leistungen im Rahmen der Erfüllung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (europäische Marktinfrastrukturverordnung – sog. EMIR), unter anderem für das zentrale Clearing von OTC-Derivaten und Meldungen an Transaktionsregister einschließlich Kosten für Rechtsträger-Kennungen.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen eine jährliche Kostenpauschale, die anteilig auf das durchschnittliche Netto-Fondsvermögen des betreffenden Monats zu berechnen und zum betreffenden Monatsende auszuzahlen ist. Für die Berechnung werden die Tageswerte zugrunde gelegt. Die Kostenpauschale umfasst die folgenden Vergütungen und Kosten, die dem Fonds nicht separat belastet werden:

- Vergütung der Verwahrstelle;
- Kosten von Artikel 17 Absatz 1 Buchstabe b) bis i) des Grundreglements;

- Kosten, die im Zusammenhang mit der Verwendung eines Vergleichsmaßstabes entstehen können;
- Kosten und Auslagen, die der Verwahrstelle aufgrund einer zulässigen und marktüblichen Beauftragung Dritter gemäß Artikel 4 Absatz 3 des Grundreglements mit der Verwahrung von Vermögenswerten des Fonds entstehen.

Die Verwahrstelle erhält aus dem Fondsvermögen:

- eine bankübliche Bearbeitungsgebühr für Geschäfte für Rechnung des Fonds.

Die Steuer auf das Fondsvermögen („Taxe d’abonnement“, derzeit 0,05% p.a.) ist vierteljährlich nachträglich auf das Fondsvermögen (soweit es nicht in Luxemburger Investmentfonds, die der „Taxe d’abonnement“ unterliegen, angelegt ist) zu berechnen und auszuführen.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen des jeweiligen Fonds eine Vergütung zugunsten der Vertriebsstellen

(„Vertriebsprovision“), die anteilig monatlich nachträglich auf das Netto-Fondsvermögen zu berechnen und auszuzahlen ist.

Die Verwaltungsgesellschaft kann dem Fondsvermögen die Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte in Bezug auf ein oder mehrere Finanzinstrumente oder sonstige Vermögenswerte oder in Bezug auf die Emittenten oder potenziellen Emittenten von Finanzinstrumenten oder in engem Zusammenhang mit einer bestimmten Branche oder einen bestimmten Markt bis zu einer Höhe von 0,10% p.a. des jährlichen durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens, der aus den Tageswerten errechnet wird, belasten.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für die Anbahnung, Vorbereitung und Durchführung von Wertpapierdarlehensgeschäften, Wertpapierpensions-geschäften und diesen vergleichbaren zulässigen Geschäften für Rechnung des Fonds eine pauschale Vergütung in Höhe von bis zu 49 Prozent der Erträge aus diesen Geschäften.

Die Ertragsverwendung sowie weitere Modalitäten entnehmen Sie bitte der nachfolgenden Tabelle.

Deka-Wandelanleihen

	Verwaltungsvergütung	Vertriebsprovision	Kostenpauschale	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	bis zu 2,50% p.a., derzeit 0,90% p.a.	keine	bis zu 0,18% p.a., derzeit 0,12% p.a.	Ausschüttung
Anteilklasse TF	bis zu 2,50% p.a., derzeit 0,90% p.a.	bis zu 1,00% p.a., derzeit 0,48% p.a.	bis zu 0,18% p.a., derzeit 0,12% p.a.	Ausschüttung

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka International S.A. unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme. Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung“ (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft.

Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka International S.A. umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeitenden und den Vorstand der Deka International S.A. findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlageerfolgsprämien, werden bei der Deka International S.A. nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka International S.A. - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Deka International S.A. bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeitenden werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt.

Für Mitarbeitende im Unternehmenserfolgsmodell wird zur Bemessung der variablen Vergütung ausschließlich der Unterneh-

menserfolg der Deka-Gruppe (ohne individuelle Zielvorgaben) herangezogen.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeitenden erfolgt durch den Vorstand. Die Vergütung des Vorstands wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitenden

Die variable Vergütung des Vorstands der Kapitalverwaltungsgesellschaft und von Mitarbeitenden, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitenden (zusammen als **„risikorelevante Mitarbeitende“**) unterliegt folgenden Regelungen:

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeitenden ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeitenden sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für den Vorstand der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitenden unterhalb der Vorstandsebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeitenden, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
- Risikorelevante Mitarbeitende, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 100

TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka International S.A. war im Geschäftsjahr 2022 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2022 fand im

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka International S.A.* gezahlten Mitarbeitervergütung	2.164.770,73 EUR
davon feste Vergütung	1.840.811,25 EUR
davon variable Vergütung	323.959,48 EUR
Zahl der Mitarbeiter der KVG	26
Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka International S.A.* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**	< 550.000,00 EUR
davon Vorstand	< 550.000,00 EUR
davon weitere Risktaker	0 EUR
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktion	0 EUR
davon Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Vorstand und Risktaker	0 EUR
* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt	
** weitere Risktaker: alle sonstigen Risktaker, die nicht Vorstand oder Risktaker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risktaker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risktaker oder Vorstand befinden	

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall

Das Auslagerungsunternehmen (Deka Investment GmbH) hat folgende Informationen veröffentlicht:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	57.636.189,51 EUR
davon feste Vergütung	43.854.381,97 EUR
davon variable Vergütung	13.781.807,54 EUR
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens	461

Deka-Wandelanleihen

Luxemburg, den 12. Dezember 2023
Deka International S.A.
Der Vorstand

BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE.

An die Anteilhaber des
Deka-Wandelanleihen

BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Deka-Wandelanleihen (der "Fonds") - bestehend aus der Vermögensaufstellung, die die Aufstellung des Wertpapierbestands sowie der sonstigen Vermögensgegenstände und Verbindlichkeiten beinhaltet, zum 30. September 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen zum Jahresabschluss, mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Deka-Wandelanleihen zum 30. September 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISA) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt „Verantwortung des „réviseur d'entreprises agréé“ für die Jahresabschlussprüfung“ weitergehend beschrieben. Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ (IESBA Code) und für Luxemburg von der CSSF angenommen, zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft des Fonds für den Jahresabschluss

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und - sofern einschlägig - Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Verantwortung des "réviseur d'entreprises agréé" für die Jahresabschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des "réviseur d'entreprises agréé", welcher unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentlich falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.

- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und der entsprechenden Erläuterungen.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Vorstand der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des "réviseur d'entreprises agréé" auf die dazugehörigen Erläuterungen zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des "réviseur d'entreprises agréé" erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Erläuterungen, und beurteilen ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Luxemburg, 14. Dezember 2023

Deloitte Audit, Société à responsabilité limitée

Cabinet de revision agréé
20, Boulevard de Kockelscheuer
1821 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Rainer Mahnkopf, Réviseur d'entreprises agréé
Managing Director

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

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

Eigenmittel zum 31. Dezember 2022

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

Vorstand

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

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

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretender Vorsitzender

Holger Knüppe
Leiter Beteiligungen der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main

Unabhängiges Mitglied

Marie-Anne van den Berg, Luxemburg

Verwahr- und Zahlstelle

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

Cabinet de révision agréé für den Fonds und die Verwaltungsgesellschaft

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

Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Stand: 30. September 2023

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



Deka International S.A.

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

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