Halbjahresbericht
zum 29. Februar 2024.

Deka-Commodities

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

Deka Investments

Deka International S.A.

Finanzgruppe

Bericht des Vorstands.

29. Februar 2024

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Commodities für den Zeitraum vom 1. September 2023 bis zum 29. Februar 2024.

Der Rückgang der Teuerungsraten im Berichtszeitraum sorgte für eine deutliche Entlastung an den Finanzmärkten. Dennoch hat sich in Deutschland die Wirtschaftsdynamik merklich abgekühlt, was sich in einer Schrumpfung des Bruttoinlandsprodukts in 2023 niederschlug. Auch die Konjunktur in Euroland findet nur schwer aus ihrer leichten Schwächephase heraus. Nicht zuletzt die zurückhaltende Auslandsnachfrage macht der europäischen Wirtschaft zu schaffen. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin die Wirtschaftslage in den USA. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik konzentrierte sich weiterhin auf die Inflations-Bekämpfung, wobei sich die Tonlage zum Jahresende 2023 spürbar abmilderte. Während die Fed das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent beibehielt, erhöhte die EZB im September den Hauptrefinanzierungssatz auf 4,50 Prozent. An den Rentenmärkten entfernten sich die Renditen ab November aufgrund des absehbaren Endes des Zinserhöhungs-Zyklus merklich von ihren zuvor erreichten Höchstständen. Zehnjährige Euroland-Staatsanleihen rentierten Ende Februar mit 2,4 Prozent, die Rendite laufzeitgleicher US-Treasuries lag zuletzt bei 4,3 Prozent.

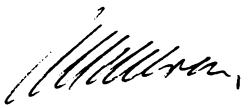
An den Aktienmärkten spiegelten sich ab November die Zinssenkungserwartungen in merklich steigenden Kursen wider, sodass die wichtigsten Aktienindizes im Berichtszeitraum mehrheitlich erfreuliche Steigerungen verzeichneten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten auf ein neues Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Lediglich der chinesische Aktienmarkt litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka International S.A.
Der Vorstand



Holger Hildebrandt

Eugen Lehnertz

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensaufstellung zum 29. Februar 2024	6
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	11

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

Deka-Commodities Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist es, einen mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch eine indirekte Beteiligung an der Entwicklung der internationalen Rohstoff- und Warenterminmärkte zu erwirtschaften.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Fonds investiert in Rohstoffe aus verschiedenen Rohstoffkategorien. Die Vorauswahl findet aufgrund eines Ansatzes statt, bei dem die Rohstoffe mit den höchsten Rollgewinnen am Terminmarkt ausgewählt werden (Backwardation). Abweichende Gewichtungen werden aufgrund der fundamentalen Markteinschätzung des Fondsmanagements bzgl. der Angebots- und Nachfragesituation einzelner Rohstoffe umgesetzt. Die Implementierung erfolgt auf Basis von Total Return Swaps. Der Investition in Rohstoffe mittels Rohstoffindizes liegt im Wesentlichen der CS Backwardation F3 ex Grains and Livestock Index (CSCU012)[1)] zu Grunde. Der Index kann durch ausschließlich einen einzigen Rohstoff bis zur Obergrenze von 35 Prozent bestimmt werden, alle anderen Index Diversifizierungsgrenzen sind auf 20 Prozent angehoben. Die Zusammensetzung des Index wird durch einen sich vierteljährlich wiederholenden Auswahlprozess dynamisch angepasst (Rebalancing).

Um dies zu erreichen, legt der Fonds hauptsächlich über abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) indirekt in ausgewählte Rohstoffe an, um so an den Entwicklungen der jeweiligen internationalen Rohstoff- und Warenterminmärkte teilzuhaben. Den Derivaten liegen dabei nicht die Rohstoffe direkt, sondern Rohstoffindizes zu Grunde. Derart kann der Fonds in die Bereiche Energie, Landwirtschaft (außer Grundnahrungsmitteln) sowie Industrie- und Edelmetalle investieren. Zur Anlage in den Rohstoffmärkten über Derivate benötigt der Fonds jedoch nur einen Teilbetrag seines Vermögens, der verbleibende Teil wird in auf Euro lautende Geldmarkt- und Rentenpapiere bzw. in Tages-/Termingeld angelegt.

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

Wichtige Kennzahlen Deka-Commodities

Performance*	**6 Monate**
Anteilklasse CF (A)	6,4%
Anteilklasse TF (A)	6,0%
Anteilklasse I (A)	6,7%
Anteilklasse I (T)	6,6%

ISIN	
Anteilklasse CF (A)	LU0263138306
Anteilklasse TF (A)	LU0263138561
Anteilklasse I (A)	LU0263139023
Anteilklasse I (T)	LU0263139296

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

1) Referenzindex: Credit Suisse Group AG, Credit Suisse International und/oder seine oder ihre Tochtergesellschaften haben dieses Dokument nicht veröffentlicht oder genehmigt und übernehmen keinerlei Verantwortung für den Inhalt oder die Nutzung. "Credit Suisse" und "CS Backwardation F3 ex Grains and Livestock Index" (CSCU012) sind Dienstleistungsmarken von Credit Suisse Group AG oder einer ihrer Tochtergesellschaften (zusammen "Credit Suisse"). Credit Suisse hat keine Beziehung zu Deka-Commodities außer der Bereitstellung des CS Backwardation F3 ex Grains and Livestock Index (CSCU012) (der "Index") für den Einsatz in Verbindung mit den Produkten und ist nicht Partei irgendeiner darauf bezogenen Transaktion. Der Index ist Eigentum der Credit Suisse International ("CSI") und/oder einer ihrer Tochtergesellschaften. Deka-Commodities und diese Materialien werden in keiner Weise von CSi und/oder einer ihrer Tochtergesellschaften gefördert, unterstützt, genehmigt, verkauft oder beworben. Weder CSi noch ein mit ihr verbundenes Unternehmen ist verpflichtet, die Bedürfnisse Dritter bei der Festlegung oder Änderung der Regeln oder der Zusammenstellung oder Berechnung des Index zu berücksichtigen. Darüber hinaus übernimmt CSi und irgendeine ihrer Tochtergesellschaften keine Gewährleistung oder Zusicherungen, weder ausdrücklich noch stillschweigend, für die Ergebnisse, die aus der Nutzung des Index und/oder der Höhe des Index zu einem bestimmten Zeitpunkt oder an einem bestimmten Tag, resultieren. CSi und ihre Tochtergesellschaften haften nicht für etwaige Fehler des Index oder in der Berechnung des Index und ist nicht verpflichtet, über etwaige Fehler aufzuklären.

Deka-Commodities
Vermögensaufstellung zum 29. Februar 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 29.02.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere									**95.191.563,42**	**65,73**
Verzinsliche Wertpapiere									**74.906.840,00**	**51,72**
EUR									**74.906.840,00**	**51,72**
DE0001104875	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 22/24		EUR	10.500.000	0	0	%	99,885	10.487.925,00	7,24
DE0001104909	2,2000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 22/24		EUR	8.000.000	0	0	%	98,959	7.916.720,00	5,47
ES0000012K38	0,0000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/25		EUR	10.000.000	10.000.000	0	%	95,906	9.590.600,00	6,62
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25		EUR	10.000.000	0	0	%	96,785	9.678.500,00	6,68
NL0010733424	2,0000 % Königreich Niederlande Anl. 14/24		EUR	10.000.000	0	0	%	99,365	9.936.500,00	6,86
NL0011220108	0,2500 % Königreich Niederlande Anl. 15/25		EUR	8.000.000	8.000.000	0	%	96,044	7.683.480,00	5,31
FR0013344751	0,0000 % Rep. Frankreich OAT 18/24		EUR	7.000.000	0	0	%	99,776	6.984.285,00	4,82
FR0014007TY9	0,0000 % Rep. Frankreich OAT 21/25		EUR	8.000.000	0	0	%	96,661	7.732.880,00	5,34
IT0005408502	1,8500 % Republik Italien B.T.P. 20/25		EUR	5.000.000	5.000.000	0	%	97,919	4.895.950,00	3,38
Zertifikate									**20.284.723,42**	**14,01**
EUR									**2.745.600,00**	**1,90**
DE000A1EK0J7	DB ETC PLC Rohst-Zert. XTR Phy Silver E 10/60		STK	22.000	83.000	61.000	EUR	124,800	2.745.600,00	1,90
USD									**17.539.123,42**	**12,11**
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00		STK	50.000	77.000	57.000	USD	195,950	9.040.369,09	6,24
IE00B4LJS984	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XPD 11/00		STK	35.000	35.000	0	USD	88,415	2.855.386,39	1,97
CH0384593999	UBS AG O.E. ETC-Zert. 17/Und.		STK	80.000	80.000	0	USD	76,450	5.643.367,94	3,90
Wertpapier-Investmentanteile									**367.680,00**	**0,25**
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile									**367.680,00**	**0,25**
EUR									**367.680,00**	**0,25**
IE00BN940Z87	UBS IFS-CMCI Com.C.X-Ag.SF ETF Reg.Shs. Acc.		ANT	3.000	45.000	47.000	EUR	122,560	367.680,00	0,25
Summe Wertpapiervermögen							**EUR**		**95.559.243,42**	**65,98**
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um **verkaufte** Positionen.)										
Devisen-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Kauf)									**-34.467,98**	**-0,02**
Offene Positionen										
USD/EUR 8.000.000,00		OTC							-34.467,98	-0,02
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									**67.436,78**	**0,05**
Offene Positionen										
USD/EUR 25.550.000,00		OTC							67.436,78	0,05
Summe der Devisen-Derivate							**EUR**		**32.968,80**	**0,03**
Swaps										
Total Return Swap									**2.886.369,19**	**1,99**
TRS long exp CSCU012E Index / JPMORGAN_FRA 29.02.2024		OTC	STK	80.000.000					1.324.340,12	0,91
TRS long exp CSCU012E Index / GOLDMANS_FRA 07.03.2024		OTC	STK	75.000.000					1.596.874,05	1,10
TRS long exp CSCU012E Index / GOLDMANS_FRA 07.03.2024		OTC	STK	12.500.000					-34.844,98	-0,02
Summe der Swaps							**EUR**		**2.886.369,19**	**1,99**
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds										
Bankguthaben										
EUR-Guthaben bei										
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	10.788.558,24			%	100,000	10.788.558,24	7,45
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	104.422,85			%	100,000	96.353,26	0,07
Tagesgelder										
3,71 % Landesbank Baden-Württemberg			EUR	2.000.000,00			%	100,000	2.000.000,00	1,38
3,80 % Bayerische Landesbank			EUR	2.000.000,00			%	100,000	2.000.000,00	1,38
3,80 % Landesbank Berlin AG			EUR	5.000.000,00			%	100,000	5.000.000,00	3,45
3,82 % Landesbank Saar			EUR	27.000.000,00			%	100,000	27.000.000,00	18,65
Summe der Bankguthaben[1)]							**EUR**		**46.884.911,50**	**32,38**
Geldmarktfonds										
KVG-eigene Geldmarktfonds									**4.752.600,00**	**3,28**
EUR									**4.752.600,00**	**3,28**
LU0052863874	DekaLux-Geldmarkt: EURO Inhaber-Anteile		ANT	100.000,00	0	0	EUR	47,526	4.752.600,00	3,28
Summe der Geldmarktfonds							**EUR**		**4.752.600,00**	**3,28**
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							**EUR**		**51.637.511,50**	**35,66**

Deka-Commodities

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 29.02.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	251.079,12				251.079,12	0,17
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	4.606,27				4.606,27	0,00
Summe der sonstigen Vermögensgegenstände							**EUR**	**255.685,39**	**0,17**
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verwaltungsvergütung		EUR	-152.360,34				-152.360,34	-0,11
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-93.413,73				-93.413,73	-0,06
	Kostenpauschale		EUR	-17.348,92				-17.348,92	-0,01
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-5.290.000,00				-5.290.000,00	-3,65
	Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-1.707,80				-1.707,80	0,00
Summe der sonstigen Verbindlichkeiten							**EUR**	**-5.554.830,79**	**-3,83**
Fondsvermögen							**EUR**	**144.816.947,51**	**100,00**
Umlaufende Anteile Klasse CF (A)							**STK**	**1.335.252,000**	
Umlaufende Anteile Klasse TF (A)							**STK**	**852.379,000**	
Umlaufende Anteile Klasse I (A)							**STK**	**1.183,000**	
Umlaufende Anteile Klasse I (T)							**STK**	**551.426,000**	
Anteilwert Klasse CF (A)							**EUR**	**52,82**	
Anteilwert Klasse TF (A)							**EUR**	**47,34**	
Anteilwert Klasse I (A)							**EUR**	**57,12**	
Anteilwert Klasse I (T)							**EUR**	**61,42**	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									**65,98**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									**2,02**

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

[1)] In dieser Position enthalten sind die für sonstige Derivate hinterlegten Sicherheiten.

Gesamtbetrag der bei Derivaten hinterlegten Sicherheiten
Euro-Guthaben von:

Goldman Sachs Bank Europe SE	2.820.000,00
J.P. Morgan SE	2.470.000,00

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze
Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
In-/ ausländische Renten, Zertifikate, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 28./29.02.2024
Alle anderen Vermögenswerte per: 29.02.2024

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.02.2024

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08375	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

OTC Over-the-Counter

Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 29.02.2024 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Devisentermingeschäfte (Kauf)	USD/EUR	8,0 Mio.	**EUR**	**7.374.784,88**
Devisentermingeschäfte (Verkauf)	USD/EUR	25,6 Mio.	**EUR**	**23.553.107,79**

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

Verwendete Vermögensgegenstände

	Marktwert in EUR	**in % des Fondsvermögens**
Total Return Swaps	2.886.369,19	1,99

10 größte Gegenparteien

Total Return Swaps	**Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR**	**Sitzstaat**
Goldman Sachs Bank Europe SE	1.562.029,07	Deutschland
J.P. Morgan SE	1.324.340,12	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)

Total Return Swaps	**absolute Beträge in EUR**
Restlaufzeit unter 1 Tag	1.324.340,12
Restlaufzeit 1-7 Tage	1.562.029,07

Deka-Commodities

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 Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindizes (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 den 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.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten
Total Return Swaps
Ausgetauschte Sicherheiten mit den Kontrahenten beziehen sich nicht auf Einzelgeschäfte, so dass eine direkte Zuordnung der Sicherheit zu dem Geschäft nicht möglich ist. Für die Einzel-Besicherung von Total Return Swaps kann demzufolge keine spezifische Währung angegeben werden. Die Gesamtbesicherung der einzelnen Kontrahenten erfolgt in EUR.

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Total Return Swaps[2]	**Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR**
Restlaufzeit 1-7 Tage	2.900.000,00

Ertrags- und Kostenanteile

Total Return Swaps[3]	**absolute Beträge in EUR**	**in % der Bruttoerträge des Fonds**
Ertragsanteil des Fonds	10.557.058,80	100,00
Kostenanteil des Fonds	6.032.390,71	57,14
Ertragsanteil der KVG	0,00	0,00

Beim Handel von Total Return Swaps ist neben den Transaktionskosten eine marktübliche Geld-/Briefmarge enthalten die i.d.R. nicht über 50 Basispunkte hinausgeht und den Ertragsanteil des Dritten enthält und zur Deckung seiner Kosten dient. Außergewöhnliche Marktsituationen (z.B. bezüglich des Basisgeschäftes/Underlyings, der Assetklasse, Volatilitäten oder Geldmarktzinsen) können hierbei zeitweise zu einer Ausdehnung der üblichen Spannen führen.

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.

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps
Total Return Swaps
Die hereingenommenen Sicherheiten sind Euro-Barsicherheiten. Hierfür erfolgt keine Emittenten-Angabe.

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	**1**
DekaBank Deutsche Girozentrale Frankfurt, Niederlassung Luxemburg	2.900.000,00 EUR

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

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

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

[2] Ausgetauschte Sicherheiten mit den Kontrahenten beziehen sich nicht auf Einzelgeschäfte, so dass eine direkte Zuordnung der Sicherheit zu dem Geschäft nicht möglich ist. Für die Besicherung von Total Return Swaps kann demzufolge keine spezifische Restlaufzeit angegeben werden, sondern per Kontrahent. Die bereitgestellten Sicherheiten auf Kontrahentenebene werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.
[3] Ausweis realisierter Total Return Swaps exklusive offene Geschäfte

Deka-Commodities

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE0001104867	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 21/23	EUR	0	10.000.000
Zertifikate				
USD				
GB00B15KXV33	WisdomTr Comm.Sec.Ltd. RI-Zert. WTI Cru. 06/Und.	STK	300.000	800.000

Deka-Commodities

Luxemburg, den 1. März 2024
Deka International S.A.
Der Vorstand

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

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

Eigenmittel zum 31. Dezember 2023

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 Luxembourg

Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Stand: 29. Februar 2024

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
Luxemburg

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

Finanzgruppe

Stand 02.24