

Jahresbericht
zum 30. Juni 2017.

Deka-BasisStrategie Flexibel

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



„Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

Juli 2017

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-BasisStrategie Flexibel für den Zeitraum vom 1. Juli 2016 bis zum 30. Juni 2017.

In den vergangenen zwölf Monaten gaben trotz zahlreicher politischer und wirtschaftlicher Belastungsfaktoren die Optimisten den Ton an. Sowohl in den USA als auch in Europa nahm die konjunkturelle Erholung Fahrt auf. Die US-Notenbank schwenkte in diesem Umfeld mit drei behutsamen Leitzinserhöhungen auf einen Pfad hin zu einer Normalisierung des Zinsniveaus. In Euroland hingegen hielt EZB-Präsident Mario Draghi an der sehr expansiven Geldpolitik fest. Die bis dato überschaubaren Folgen des Brexit, sehr gute Finanzierungsbedingungen für Unternehmen, fallende Arbeitslosenquoten und die Umschiffung einer Reihe politischer Klippen in Europa durch die Wahlsiege der europafreundlichen Kräfte in den Niederlanden und Frankreich versetzten die Märkte in Kauflaune. Mit gleichzeitig abnehmender Angst vor einem ausufernden US-Protektionismus bildete dies die Basis für ein sehr freundliches Aktienmarktjahr.

Bei Anleihen setzte sich der Trend niedriger Renditen zunächst fort. Das überraschende Brexit-Votum erhöhte die Nachfrage nach risikoärmeren Wertpapierklassen im Sommer nochmals kräftig. Mit der US-Wahl setzte jedoch im weiteren Verlauf eine scharfe Gegenbewegung ein. So zog die Rendite 10-jähriger US-Treasuries im Herbst signifikant an und bewegte sich dann überwiegend seitwärts, Ende Juni lag sie schließlich bei 2,3 Prozent. Laufzeitgleiche Bundesanleihen rentierten zum Stichtag mit knapp 0,5 Prozent, nachdem die Rendite im Sommer 2016 noch überwiegend im negativen Bereich gelegen hatte.

Die internationalen Aktienmärkte durchliefen im Betrachtungszeitraum mehrere turbulente Phasen. Stichtagsbezogen registrierte das Gros der Börsen jedoch kräftige Wertsteigerungen, die vor allem auf die sehr gute Entwicklung ab Oktober 2016 zurückzuführen waren. Deutsche Aktien wiesen im globalen Vergleich eine überdurchschnittliche Performance auf.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Deka-BasisStrategie Flexibel im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 7,6 Prozent (Anteilklasse CF). 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 wichtige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider



Steffen Selbach

Inhalt.

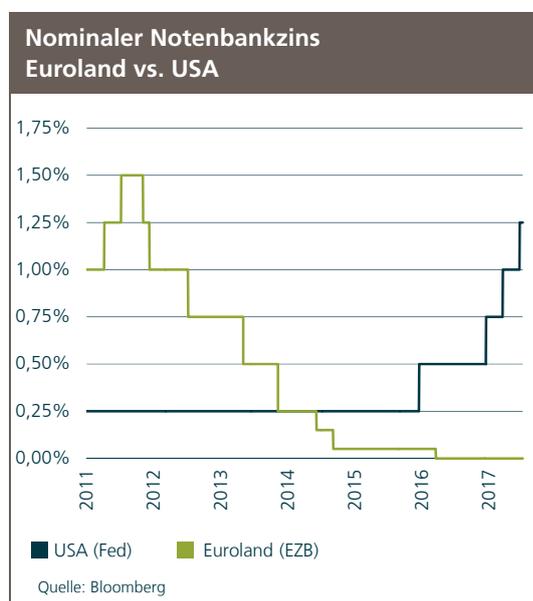
Entwicklung der Kapitalmärkte.	5
Tätigkeitsbericht. Deka-BasisStrategie Flexibel	8
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2017. Deka-BasisStrategie Flexibel	11
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2017. Deka-BasisStrategie Flexibel	13
Anhang. Deka-BasisStrategie Flexibel	37
Vermerk des Abschlussprüfers.	43
Besteuerung der Erträge.	44
Informationen der Verwaltung.	54
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.	55

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

Entwicklung der Kapitalmärkte.

Konjunktur nimmt Fahrt auf

Das Zusammenspiel von Stimulationen der Notenbanken, robusten Wirtschaftsdaten der Industrienationen und verschiedenen (geo)politischen Unsicherheitsfaktoren prägte im Berichtsjahr das Geschehen an den Kapitalmärkten. Mit den Auswirkungen des Brexit-Votums oder dem Putschversuch in der Türkei und auch im weiteren Verlauf mit dem Wahlsieg von Donald Trump zum neuen US-Präsidenten flackerte zeitweise Nervosität an den Märkten auf. Letztlich setzte sich aber Optimismus durch und die Aktienkurse stiegen weltweit signifikant an.



In dem von politischen Risiken übersäten Frühjahr 2017 sind wichtige Hürden genommen worden. Die Euro-kritischen Parteien haben sich bei den Wahlen in den Niederlanden und in Frankreich nicht durchgesetzt. Überdies scheint US-Präsident Trump Schritt für Schritt Abstand von extremen Plänen zu nehmen.

Beflügelt vom Konsum und Bauboom wuchs die deutsche Wirtschaft 2016 um 1,9 Prozent und damit so stark wie zuletzt vor fünf Jahren. Auch Deutschlands Exporte haben trotz der politischen Unsicherheiten und des langsameren Wachstums des Welt Handels im vergangenen Jahr einen Rekordwert erreicht. Flankiert wurde diese Entwicklung über weite Strecken von einer geringen Inflation, einer entspannten Lage am Arbeitsmarkt sowie niedrigen Zinsen.

Das ifo Geschäftsklima erreichte zuletzt ein neues Allzeithoch und spiegelt die prächtige Stimmung in der deutschen Wirtschaft wider. Getrieben von höhe-

ren Investitionen, starkem Binnenkonsum sowie einer boomenden Exportwirtschaft stieg das Bruttoinlandsprodukt (BIP) im ersten Quartal 2017 um 0,6 Prozent gegenüber dem Vorquartal an. Die hohe Wettbewerbsfähigkeit der deutschen Wirtschaft und die Leistungsbilanzüberschüsse sind allerdings den USA wie auch verschiedenen EU-Staaten schon seit längerem ein Dorn im Auge. Exportabhängige Unternehmen registrierten daher mit einiger Sorge den protektionistischen Habitus des neuen US-Präsidenten.

Die Konjunktur in Euroland legte einen guten Jahresstart hin. Das Bruttoinlandsprodukt stieg im ersten Quartal laut vorläufiger Schätzung um 0,5 Prozent im Vergleich zum Vorquartal. Die spanische Wirtschaft nimmt mit einem Wachstum um 0,8 Prozent im ersten Quartal erneut Kurs auf die Marke von 3 Prozent für das Gesamtjahr. Frankreich blieb mit einem Anstieg der Wirtschaftsleistung um 0,3 Prozent im ersten Quartal etwas hinter den Erwartungen zurück.

Die Stimmung der Unternehmen im Euroraum hat sich mit Blick auf den Gesamteinkaufsmanagerindex weiter verbessert. Das Economic Sentiment stieg im April auf den höchsten Stand seit Sommer 2007 und hat damit nicht nur die Schuldenkrise abgeschüttelt, sondern auch die Weltwirtschaftskrise 2008/2009 hinter sich gelassen. Das Wirtschaftsvertrauen profitierte sicherlich auch von der Abnahme politischer Risiken für den Fortbestand der EU angesichts der Wahlausgänge in Österreich, den Niederlanden sowie in Frankreich. Gleichzeitig erhalten die Unternehmen und Konsumenten starken Rückenwind durch die extrem lockere Geldpolitik der Europäischen Zentralbank (EZB).

Der Wachstumstrend in den USA ist intakt, auch wenn im ersten Quartal die Dynamik der US-Wirtschaft saisonal bedingt etwas schwächer ausfiel. Das BIP stieg im ersten Quartal um 0,7 Prozent gegenüber dem Vorquartal. Einer schwachen Konsumdynamik stand erfreulicherweise eine starke Investitionstätigkeit der Unternehmen gegenüber, welche für die Wachstumsaussichten der US-Wirtschaft mit Blick auf den weiteren Jahresverlauf wesentliche Bedeutung besitzt.

Die Arbeitslosenquote sank im Einklang mit dieser Entwicklung auf zuletzt 4,3 Prozent und erreichte das niedrigste Niveau seit 2001. Der Beschäftigungsaufbau sowie der Rückgang der Arbeitslosenquote bilden starke Argumente für eine weitere Anhebung der Leitzinsen durch die US-Notenbank (Fed). Zudem haben die Risiken einer stärkeren Inflationsentwick-

lung mit Donald Trumps fiskalpolitischen Ankündigungen deutlich zugenommen. Die Verbraucherpreise setzten ihren Aufwärtstrend nach dem Jahreswechsel fort, auch wenn am aktuellen Rand eine Beruhigung der Inflationsdynamik zu beobachten war.

In diesem Umfeld hat sich die geldpolitische Divergenz zwischen den USA und Europa weiter vertieft. Schon Ende 2015 hatte die Fed den ersten behutsamen Schritt auf dem Weg hin zur geldpolitischen Normalisierung vollzogen, dem sich im Dezember 2016 erwartungsgemäß ein weiterer Zinsschritt anschloss. In der zweiten Berichtshälfte entschieden sich die Währungshüter um Janet Yellen schließlich, die Leitzinsen nochmals in zwei Schritten um jeweils 25 Basispunkte anzuheben.

Die EZB behielt dagegen angesichts äußerst niedriger Teuerungsraten und verhaltener Wirtschaftsdaten ihre expansive Marschrichtung bei. Allerdings sorgte zum Ende des Berichtsjahres EZB-Präsident Mario Draghi mit Andeutungen über graduelle Anpassungen in der Geldpolitik dafür, dass Spekulationen über einen frühzeitigen Kurswechsel aufkamen, die sich an den Aktienmärkten in deutlichen Kursverlusten und an den Euro-Rentenmärkten in steigenden Zinsen widerspiegeln.

Aktienmärkte in Rekordlaune

Nachdem die Brexit-Entscheidung zu erheblichen Turbulenzen an den Aktienmärkten geführt hatte, konnten sich die Kurse zu Beginn des Berichtszeitraums deutlich erholen und gingen in eine Seitwärtsbewegung über. Ab November 2016 folgte dann eine breite Aufwärtstendenz. Der Schock über das Wahlergebnis in den USA währte nur kurz. Dazu trug nicht zuletzt auch die Erwartung fiskalpolitischer Stimuli und Deregulierungsmaßnahmen im US-Bankensektor bei. Nach einem zunächst verhaltenen Jahresauftakt 2017 legten die Kurse nochmals spürbar zu. Einige Aktienindizes setzten neue Rekordmarken, und auch auf Jahressicht konnten sich Anleger über erhebliche Zuwächse freuen.

In den USA verbuchten der Dow Jones Industrial mit 19,1 Prozent sowie der marktweite S&P 500 mit 15,5 Prozent kräftige Zugewinne, der Nasdaq Composite kletterte sogar um 26,8 Prozent. In Euroland zeigte sich auf Jahressicht eine ähnliche Entwicklung. Hier schloss der EURO STOXX 50 mit einem Plus von 20,2 Prozent. Unter Branchensichtspunkten gerieten in Europa – gemessen am

STOXX Europe 600 – Aktien aus den Bereichen Öl & Gas, Versorger sowie Telekommunikation ins Hintertreffen, während etwa Banken, Rohstoffe und Technologie haussierten.



Die Stimmung deutscher Unternehmen blieb unverändert gut. Die Zahlen zum ersten Quartal 2017 bestätigten, dass sich die positive Stimmung auch in den tatsächlich erzielten Umsatz- und Gewinnzahlen widerspiegelt. Denn für das abgelaufene erste Quartal berichteten die Unternehmen deutliche Anstiege gegenüber dem Vorjahreszeitraum. Entsprechend erfolgreich präsentierten sich die deutschen Standardwerte im DAX, der ein Plus von 27,3 Prozent verbuchte und im letzten Berichtsmont ein neues Allzeithoch markierte.

Das Bruttoinlandsprodukt in Japan ist im ersten Quartal 2017 mit 0,5 Prozent gegenüber dem Vorquartal etwas stärker als erwartet angestiegen. Es ist bereits das fünfte Quartal in Folge, in dem die Volkswirtschaft gewachsen ist. Für japanische Verhältnisse ist dies ein Erfolg. Japanische Aktien spielten mit einem Plus von 28,6 Prozent (Nikkei 225) diese positive Entwicklung wider. In Hongkong stieg der maßgebliche Hang Seng Index um 23,3 Prozent.

Die Stimmung für Schwellenländeraktien verbesserte sich in der zweiten Berichtshälfte. Das globale Wachstumsumfeld war stark genug, um Staatsfinanzen und Unternehmensergebnisse zu stützen. Doch erschien die Dynamik nicht so substantiell, dass es die Zentralbanken zu einer schnelleren geldpolitischen Straffung veranlasst hätte. Das

Risiko eines globalen Handelskriegs hat abgenommen, nachdem US-Präsident Trump von einer Grenzausgleichsteuer im Prinzip abgerückt ist. Vor diesem Hintergrund verzeichneten Schwellenländeraktien – gemessen am MSCI Emerging Markets (in US-Dollar) – eine Wertsteigerung um 21,2 Prozent.

Rentenmärkte im Umschwung

Deutsche Bundesanleihen präsentierten sich im Berichtsjahr in zunehmend schwacher Verfassung. Gemessen am eb.rexx Government Germany Overall verzeichneten Bundesanleihen eine Wertentwicklung von minus 6,6 Prozent. Zu Beginn des Berichtsjahres prägte eine Seitwärtsbewegung der Renditen das Bild. Die Rendite 10-jähriger Bundesanleihen lag dabei im ersten Berichtsquartal sogar überwiegend im negativen Bereich – mit einem Tiefpunkt bei minus 0,2 Prozent. Im Herbst setzte eine Trendumkehr ein, in deren Folge die Rendite nach dem Jahreswechsel mehrmals an die Marke von 0,5 Prozent heranreichte und auf diesem Niveau das Berichtsjahr beendete.

Laufzeitgleiche US-Treasuries registrierten in den ersten drei Monaten einen stetigen Renditeanstieg. Nach der Wahl Donald Trumps nahm die Aufwärtsdynamik dann erheblich zu. So zog allein im Wahlmonat November die Rendite 10-jähriger US-Treasuries vom Tiefpunkt Anfang November bei 1,8 Prozent auf 2,4 Prozent an. Ab dem Frühjahr schwächte sich der Trend ab und die Rendite lag zuletzt bei 2,3 Prozent.

An den Kreditmärkten wurden die gesunkenen Risiken von extremen politischen Szenarien mit Erleichterung aufgenommen. Unternehmensanleihen hatten sich zwar kaum von der zuvor gestiegenen Risikoscheu anstecken lassen und wiesen nach dem Jahreswechsel bei den Risikoaufschlägen (Spreads) einen Seitwärtstrend aus. Doch nach dem beruhigenden Wahlergebnis in Frankreich und dem Erkenntnisgewinn, dass viele der protektionistischen Drohungen von Trump kaum Wirkung zeigen, haben die Spreads nachgegeben. Auch die Anleihekäufe der EZB, wenngleich zuletzt in etwas geringerem Umfang, unterstützten den Markt weiterhin massiv.

Am Devisenmarkt sorgte die vorsichtige Vorgehensweise der Fed zunächst für eine stabile Entwicklung des Euro/US-Dollar-Wechselkurses. Erst nach der US-Wahl wertete der US-Dollar deutlich auf und stieg Ende Dezember vor dem Hintergrund von Spekulationen über weitere Zinserhöhungen in den USA sogar auf den höchsten Stand seit 14 Jahren (1,04 US-Dollar/Euro). Bis zum 30. Juni erholte sich die europäische Gemeinschaftswährung und stieg auf einen Höchstwert von 1,14 US-Dollar/Euro. Ausschlaggebend für die Erholung waren sowohl die irritierende Politik des US-Präsidenten als auch die Wahlsiege gemäßiger Kräfte in der EU. In den letzten Berichtstagen lieferte Mario Draghi mit einer positiven Einschätzung zur Konjunktur in Euroland einen zusätzlichen Aufwärtssimpuls.

**Rendite 10-jähriger Staatsanleihen
USA vs. Euroland**



Die Rohstoffpreise stabilisierten sich im Berichtszeitraum. Öl rangierte in einer Preisspanne zwischen 42 US-Dollar und rund 57 US-Dollar und notierte zuletzt bei 47,9 US-Dollar. Der Goldpreis schnellte im Zuge der Unsicherheit rund um das britische EU-Referendum im Juli 2016 zeitweise auf 1.366 US-Dollar in die Höhe. Im Herbst bröckelte der Preis wieder, als Marktteilnehmer verstärkt in den Aktienmarkt drängten. Zuletzt kostete die Feinunze 1.240 US-Dollar.

Jahresbericht 01.07.2016 bis 30.06.2017

Deka-BasisStrategie Flexibel

Tätigkeitsbericht.

Das Anlageziel des Investmentfonds Deka-BasisStrategie Flexibel ist ein mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, je nach Marktlage weltweit in Aktien, verzinsliche Wertpapiere, Währungen und Rohstoffderivate zu investieren. Ausgehend von der strategischen Marktmeinung der Deka Investment GmbH werden die besten Ideen des fundamentalen Fondsmanagements in diesem Investmentfonds umgesetzt. Der jeweilige Investitionsgrad in den einzelnen Anlageklassen kann dabei zwischen 0 Prozent und 100 Prozent schwanken. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden. Dieser Investmentfonds darf jeweils bis zu 35 Prozent des Wertes des Fonds in Schuldverschreibungen, Schuldscheindarlehen und Geldmarktinstrumente besonderer nationaler und supranationaler öffentlicher Emittenten anlegen.

Fonds profitiert von erhöhter Aktienquote

In den zurückliegenden zwölf Monaten bestimmten an den Aktienbörsen Kurssteigerungen das Bild. An den Anleihemärkten in den USA und Europa prägten hingegen Renditeanstiege das Marktgeschehen. Ausgehend von einem historisch niedrigen Zinsniveau – 10-jährige europäische Staatstitel wiesen zu Beginn des Betrachtungszeitraums eine negative Verzinsung auf – haben sich die Renditen u.a. im Zuge des von der US-Notenbank eingeschlagenen Normalisierungskurses und behutsamer Zinsanhebungen bis zum Ende der Berichtsperiode ein Stück weit von ihren Tiefständen gelöst. Im Berichtszeitraum stiegen die Renditen bei Euroland- und US-Staatsanleihen auch im Zuge einer sich verbessernden Weltkonjunktur an.

Das Fondsmanagement erhöhte im Laufe des Berichtszeitraums den Aktieninvestitionsgrad. Lag die Aktienquote Anfang Juli 2016 nur bei gut 17 Prozent waren zum Jahreswechsel in der Spitze rund 60 Prozent des Fondsvermögens im Aktiensektor investiert. Im Zuge steigender Aktienmarktrisiken verringerte das Fondsmanagement die Aktienquote dann bis zum Stichtag auf knapp 47 Prozent (inkl. Aktienfonds). Unter Berücksichtigung von Aktienderivaten (Optionen, Futures), die der Feinsteuerung des Portfolios dienten, erhöhte sich der Netto-Investitionsgrad in Aktien nochmals leicht um 1,9 Prozentpunkte.

Wichtige Kennzahlen Deka-BasisStrategie Flexibel

Performance*	1 Jahr	3 Jahre	seit Auflegung
Anteilklasse CF	7,6%	-	3,6%
Gesamtkostenquote			
Anteilklasse CF	1,44%		
ISIN			
Anteilklasse CF	DE000DK2EAR4		

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

Veräußerungsergebnisse Deka-BasisStrategie Flexibel (CF) 01.07.2016 – 30.06.2017

Realisierte Gewinne aus	in Euro
Renten u. Zertifikaten	2.436.614,04
Aktien	2.349.127,98
Zielfonds u. Investmentvermögen	258.561,42
Optionen	1.550.930,20
Futures	2.030.378,20
Swaps	3.580.665,10
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	7.548.742,10
Devisenkassageschäften	106.950,63
Sonstigen Wertpapieren	16.395,39
Summe	19.878.365,06
Realisierte Verluste aus	
Renten u. Zertifikaten	-966.906,21
Aktien	-1.558.758,57
Zielfonds u. Investmentvermögen	-131.792,03
Optionen	-2.228.870,97
Futures	-3.396.797,07
Swaps	-3.096.861,78
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	-6.683.335,98
Devisenkassageschäften	-156.281,23
Sonstigen Wertpapieren	-77.504,19
Summe	-18.297.108,03

Deka-BasisStrategie Flexibel

Im Aktienbereich standen weltweite Anlagen mit überzeugenden Dividendenrenditen im Fokus. Weiterhin favorisierte der Fonds u.a. europäische Dividentitel, US-Aktien die von möglichen Steuererleichterungen profitieren könnten, führende Unternehmen aus dem Schwellenländersegment sowie japanische Aktien mit Fokus auf Aktienrückkäufe. Die Berücksichtigung der genannten Faktoren erfolgte über das Fondsmanagement.

Der Wertpapieranteil im Rentensektor wurde im Berichtsjahr zwar spürbar auf zuletzt 38 Prozent des Fondsvolumens reduziert, unter Einrechnung derivativer Finanzinstrumente (Zinsterminkontrakte) erhöhte sich allerdings die Netto-Rentenquote im Stichtagsvergleich deutlich. Im Derivate-Bereich waren daneben Kreditausfallversicherungen (CDS) im Einsatz. Die Zinssensitivität des Rentenportfolios wurde über die Verlängerung der durchschnittlichen Zinsbindungsdauer (Duration) signifikant erhöht.

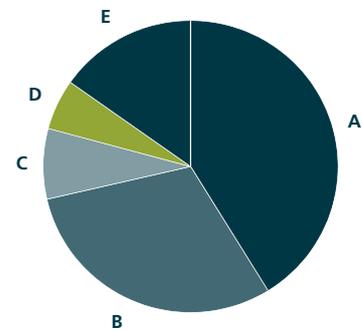
Die Investitionen auf der Rentenseite fokussierten sich über weite Strecken aufgrund eines attraktiven Renditeniveaus auf höher rentierliche US-Dollar- und Euro-Unternehmensanleihen sowie auf US-Dollar-Anleihen mit guter Kreditqualität (Investment Grade). Im Stichtagsvergleich wurde der Anteil an Unternehmensanleihen deutlich zugunsten von Staatsanleihen zurückgeführt. Investitionen im Hochzinssegment erfolgten zwischenzeitlich auch über Exchange Traded Funds (ETF).

Im Berichtszeitraum profitierte der Fonds vor allem von der kontinuierlichen Erhöhung der Aktienquote sowie einer offensiveren Positionierung der Duration. Nachteile ergaben sich indes aus einer temporär hohen US-Dollar-Quote, die aufgrund der schwachen Währungskursentwicklung die Erwartungen nicht erfüllen konnte.

Anteile an dem Sondervermögen sind Wertpapiere, deren Preise durch die börsentäglichen Kurschwankungen der im Fonds befindlichen Vermögensgegenstände bestimmt werden und deshalb steigen oder auch fallen können (Marktpreisrisiken).

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen i.d.R. die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere.

Fondsstruktur Deka-BasisStrategie Flexibel



A Aktien	41,2%
B Festverzinsliche Wertpapiere	30,2%
C Wertpapiere mit besonderer Ausstattung	7,8%
D Aktienfonds	5,6%
E Barreserve, Sonstiges	15,2%

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

Deka-BasisStrategie Flexibel

Der Fonds ermöglicht Investitionen in Unternehmensanleihen. Durch den Ausfall eines Emittenten können für den Fonds Verluste entstehen.

Das Engagement in Investmentanteilen ist marktüblichen und spezifischen Risiken unterworfen. Da die Manager der einzelnen Zielfonds voneinander unabhängig handeln, kann es vorkommen, dass mehrere Zielfonds gleiche Engagements tätigen. Hierdurch können sich bestehende Risiken kumulieren.

Aufgrund der Investitionen in fremde Währungen unterlag der Fonds Fremdwährungsrisiken. Darüber hinaus waren Derivate im Portfolio enthalten, sodass auch hierfür spezifische Risiken wie das Kontrahentenrisiko zu beachten waren.

Die Einschätzung der im Berichtsjahr eingegangenen Liquiditätsrisiken orientiert sich an der Veräußerbarkeit von Vermögenswerten, die potenziell eingeschränkt sein kann. Der Fonds verzeichnete im Berichtszeitraum keine wesentlichen Liquiditätsrisiken.

Zur Bewertung und Vermeidung operationeller Risiken führt die Gesellschaft detaillierte Risikoüberprüfungen durch. Das Sondervermögen wies im Berichtszeitraum keine besonderen operationellen Risiken auf.

Im Berichtszeitraum verzeichnete der Fonds Deka-BasisStrategie Flexibel eine Wertentwicklung von plus 7,6 Prozent (Anteilkategorie CF). Das Fondsvolumen belief sich zum Stichtag auf 111,1 Mio. Euro.

Wertentwicklung 01.07.2016 – 30.06.2017 Deka-BasisStrategie Flexibel (CF)

Index: 30.06.2016 = 100



Darstellung der Fondswertentwicklung auf Basis der Rücknahmepreise, Ausschüttungen zum Rücknahmepreis wiederangelegt.

Deka-BasisStrategie Flexibel

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2017.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände	45.651.657,65	41,26
1. Aktien		
Australien	262.407,04	0,23
Belgien	233.017,18	0,21
Bermuda	100.590,76	0,09
Brasilien	778.125,62	0,70
Britische Jungfern-Inseln	58.201,42	0,05
China	190.659,34	0,17
Dänemark	964.806,26	0,88
Deutschland	3.124.014,60	2,81
Färöer Inseln	129.566,51	0,12
Finnland	630.873,40	0,58
Frankreich	3.786.166,32	3,44
Großbritannien	6.466.927,28	5,87
Hongkong	625.596,42	0,57
Indien	325.659,57	0,29
Indonesien	342.476,04	0,31
Irland	924.073,43	0,83
Italien	1.557.397,71	1,40
Japan	3.473.925,62	3,13
Kaiman-Inseln	1.316.673,59	1,18
Korea, Republik	111.783,54	0,10
Luxemburg	156.651,30	0,14
Malaysia	138.040,47	0,12
Mexiko	139.084,96	0,13
Niederlande	1.955.895,56	1,75
Norwegen	638.652,90	0,58
Österreich	135.216,65	0,12
Portugal	290.483,60	0,26
Russische Föderation	116.995,35	0,11
Schweden	856.521,47	0,78
Schweiz	2.526.019,74	2,29
Singapur	114.980,75	0,10
Spanien	1.585.370,35	1,44
Südafrika	1.093.252,32	1,00
Taiwan	1.051.455,44	0,95
Thailand	470.228,16	0,43
USA	8.979.866,98	8,10
2. Anleihen	41.720.879,34	37,45
Ägypten	1.131.453,24	1,01
Angola	462.902,09	0,42
Argentinien	2.261.143,69	2,02
Äthiopien	173.775,09	0,16
Bermuda	683.109,28	0,61
Bolivien	602.966,96	0,54
Britische Jungfern-Inseln	1.317.847,75	1,18
China	795.140,00	0,72
Dänemark	230.081,51	0,21
Deutschland	211.900,00	0,19
Dominikanische Republik	652.438,78	0,58
Ecuador, Galapagos-Inseln	733.850,47	0,66
Elfenbeinküste	1.037.351,83	0,94
Finnland	199.000,00	0,18
Frankreich	272.375,13	0,25
Georgien	293.846,96	0,26
Großbritannien	1.330.338,78	1,19
Guatemala	283.794,59	0,26
Hongkong	308.922,78	0,28
Indien	366.012,50	0,33
Indonesien	405.589,89	0,36
Irland	220.220,88	0,20
Italien	685.750,00	0,61
Jordanien	540.362,87	0,49
Kaiman-Inseln	351.696,03	0,32
Kasachstan	782.953,81	0,71
Katar	432.772,37	0,39
Luxemburg	176.614,95	0,16
Namibia	369.883,42	0,33
Niederlande	2.068.911,43	1,85
Österreich	889.210,27	0,79
Panama	362.433,17	0,33
Paraguay	411.383,55	0,37
Peru	527.741,25	0,48
Portugal	261.742,50	0,24
Russische Föderation	1.313.372,63	1,17
Schweden	677.015,63	0,61
Senegal	890.744,15	0,79
Singapur	748.757,34	0,68
Slowenien	1.679.115,00	1,50
Sonstige	2.523.097,12	2,25
Spanien	520.134,50	0,47

Deka-BasisStrategie Flexibel

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Sri Lanka	798.382,86	0,72
Südafrika	578.104,13	0,52
Suriname	268.866,68	0,24
Tschechische Republik	967.628,10	0,86
Tunesien	612.000,00	0,55
Türkei	819.477,61	0,74
USA	7.026.859,30	6,31
Vietnam	461.806,47	0,42
3. Investmentanteile	6.209.399,42	5,56
Irland	2.694.335,00	2,41
Luxemburg	3.515.064,42	3,15
4. Sonstige Wertpapiere	123.248,45	0,11
Schweiz	123.248,45	0,11
5. Derivate	1.508.799,82	1,34
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	14.560.443,29	13,07
7. Sonstige Vermögensgegenstände	4.546.164,78	4,09
II. Verbindlichkeiten	-3.194.989,80	-2,88
III. Rückstellungen	-5.272,43	-0,00
IV. Fondsvermögen	111.120.330,52	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände	45.651.657,65	41,26
1. Aktien		
AUD	262.407,04	0,23
BRL	778.125,62	0,70
CHF	2.428.826,47	2,20
DKK	964.806,26	0,88
EUR	14.181.779,20	12,80
GBP	6.449.940,26	5,85
HKD	1.816.645,42	1,64
IDR	342.476,04	0,31
JPY	3.473.925,62	3,13
KRW	111.783,54	0,10
MXN	139.084,96	0,13
MYR	138.040,47	0,12
NOK	768.219,41	0,70
SEK	856.521,47	0,78
SGD	114.980,75	0,10
THB	470.228,16	0,43
TWD	1.051.455,44	0,95
USD	10.209.159,20	9,21
ZAR	1.093.252,32	1,00
2. Anleihen	41.720.879,34	37,45
CZK	967.628,10	0,86
DOP	469.250,07	0,42
EUR	8.728.480,86	7,84
RUB	1.313.372,63	1,17
USD	30.242.147,68	27,16
3. Investmentanteile	6.209.399,42	5,56
EUR	2.694.335,00	2,41
USD	3.515.064,42	3,15
4. Sonstige Wertpapiere	123.248,45	0,11
CHF	123.248,45	0,11
5. Derivate	1.508.799,82	1,34
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	14.560.443,29	13,07
7. Sonstige Vermögensgegenstände	4.546.164,78	4,09
II. Verbindlichkeiten	-3.194.989,80	-2,88
III. Rückstellungen	-5.272,43	-0,00
IV. Fondsvermögen	111.120.330,52	100,00

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

Deka-BasisStrategie Flexibel

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2017.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								63.053.115,15	56,87
Aktien								45.651.657,65	41,26
EUR								14.181.779,20	12,80
FR0000120404	ACCOR S.A. Actions Port.	STK		1.560	2.960	3.600	EUR 41,705	65.059,80	0,06
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Koninkl. Aand. aan toonder	STK		4.852	12.032,352	7.180,352	EUR 16,920	82.095,84	0,07
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port.	STK		920	1.250	330	EUR 109,200	100.464,00	0,09
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		1.140	700	210	EUR 174,150	198.531,00	0,18
IE00BY5Z9G33	Allied Irish Banks PLC Reg.Shares	STK		40.000	48.800	8.800	EUR 4,817	192.680,00	0,17
FR0010220475	Alstom S.A. Actions Porteur	STK		2.050	2.050	0	EUR 30,740	63.017,00	0,06
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port.	STK		3.370	1.470	700	EUR 52,350	176.419,50	0,16
IT0004998065	Anima Holding S.p.A. Azioni nom	STK		15.890	22.000	6.110	EUR 6,315	100.345,35	0,09
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		1.010	120	310	EUR 115,600	116.756,00	0,11
NL0011872643	ASR Nederland N.V. Aandelen op naam	STK		3.720	5.000	1.280	EUR 29,375	109.275,00	0,10
IT0003506190	Atlantia S.p.A. Azioni nom.	STK		3.520	5.000	1.480	EUR 24,900	87.648,00	0,08
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		6.840	3.800	1.560	EUR 24,240	165.801,60	0,15
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		16.200	9.209,8	5.080,8	EUR 7,402	119.912,40	0,11
IT0005218380	Banco BPM S.p.A. Azioni	STK		23.400	23.400	0	EUR 2,942	68.842,80	0,06
DE000BAY0017	Bayer AG Namens-Aktien	STK		1.440	550	310	EUR 113,200	163.008,00	0,15
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien	STK		1.330	440	510	EUR 72,780	96.797,40	0,09
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien	STK		1.460	700	340	EUR 92,590	135.181,40	0,12
FR0000120503	Bouygues S.A. Actions Port.	STK		1.680	1.680	0	EUR 37,075	62.286,00	0,06
FR0000125338	Cappemini SE Actions Port.	STK		1.350	1.750	400	EUR 90,350	121.972,50	0,11
IT0005010423	Cerved Inform.Solutions S.p.A. Azioni nom.	STK		13.060	5.000	3.940	EUR 9,720	126.943,20	0,11
FR0000130403	Christian Dior SE Actions Port. ¹⁾	STK		725	725	0	EUR 253,320	183.657,00	0,17
ES0105027009	Cia. d. Dis.Integ.Logista Hdgs Acciones Port.	STK		2.780	2.780	0	EUR 23,240	64.607,20	0,06
DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien	STK		550	185	175	EUR 189,350	104.142,50	0,09
FR0000045072	Crédit Agricole S.A. Actions Port.	STK		9.340	12.000	2.660	EUR 14,260	133.188,40	0,12
IE0001827041	CRH PLC Reg.Shares	STK		3.430	3.400	4.570	EUR 31,660	108.593,80	0,10
PTCTT0AM0001	CTT-Correios de Portugal S.A. Acções ao Portador	STK		20.650	11.250	0	EUR 5,549	114.586,85	0,10
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien	STK		1.500	1.900	2.300	EUR 92,600	138.900,00	0,12
DE0007480204	Deutsche EuroShop AG Namens-Aktien	STK		2.870	0	1.030	EUR 34,500	99.015,00	0,09
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK		4.900	2.300	1.100	EUR 33,175	162.557,50	0,15
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		10.200	5.600	2.300	EUR 15,985	163.047,00	0,15
DE0005545503	Drillisch AG Inhaber-Aktien	STK		3.000	1.400	1.200	EUR 52,880	158.640,00	0,14
PTEDP0AM0009	EDP - Energias de Portugal SA Acções Nom.	STK		27.300	40.000	12.700	EUR 2,884	78.733,20	0,07
FR0012435121	Elis S.A. Actions au Porteur	STK		3.430	3.430	0	EUR 19,815	67.965,45	0,06
ES0130960018	Enagas S.A. Acciones Port.	STK		4.280	2.200	1.420	EUR 24,870	106.443,60	0,10
IT0005176406	ENAV S.p.A. Azioni nom.	STK		35.050	45.000	9.950	EUR 3,746	131.297,30	0,12
ES0130670112	Endesa S.A. Acciones Port.	STK		4.845	1.925	1.680	EUR 20,650	100.049,25	0,09
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK		24.200	6.370	7.670	EUR 4,724	114.320,80	0,10
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port.	STK		6.700	2.380	2.680	EUR 13,425	89.947,50	0,08
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom.	STK		11.750	7.700	2.750	EUR 13,270	155.922,50	0,14
FR0000121667	Essilor Intl -Cie Génle Opt.SA Actions Port.	STK		780	1.950	1.170	EUR 112,650	87.867,00	0,08
NL0000288876	Eurocommercial Properties N.V. Cert. van Aandelen	STK		2.980	1.691,38	1.020,38	EUR 35,150	104.747,00	0,09
FR0000038259	Eurofins Scientific S.A. Actions Port.	STK		130	130	0	EUR 494,750	64.317,50	0,06
ES0105075008	Euskaltel S.A. Acciones Porteur	STK		9.780	4.160	3.880	EUR 9,350	91.443,00	0,08
ES0118900010	Ferrovial S.A. Acciones Port.	STK		6.640	3.939,5	1.860,81	EUR 19,530	129.679,20	0,12
IT0000072170	Fincobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom.	STK		18.500	9.960	5.460	EUR 7,035	130.147,50	0,12
NL0011279492	Flow Traders N.V. Aandelen op naam	STK		3.200	1.800	1.400	EUR 24,500	78.400,00	0,07
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien	STK		1.240	1.690	1.700	EUR 84,650	104.966,00	0,09
PTGAL0AM0009	Galp Energia SGPS S.A. Acções Nom.	STK		7.270	0	2.830	EUR 13,365	97.163,55	0,09
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK		2.500	3.500	1.000	EUR 36,270	90.675,00	0,08
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG Inhaber-Aktien	STK		910	910	0	EUR 70,790	64.418,90	0,06
NL0010937066	GrandVision N.V. Aandelen op naam	STK		3.525	1.315	1.590	EUR 23,475	82.749,38	0,07
FR0010533075	Groupe Eurotunnel SE Actions Port.	STK		6.660	6.660	0	EUR 9,501	63.276,66	0,06
FR0000121881	Havas S.A. Actions Port.	STK		7.100	7.100	0	EUR 9,226	65.504,60	0,06
DE0006047004	HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien	STK		1.160	1.600	440	EUR 85,080	98.692,80	0,09
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien	STK		2.000	2.000	0	EUR 62,120	124.240,00	0,11
FI0009000459	Huhtamäki Oyj Reg.Shares	STK		3.400	4.500	1.100	EUR 34,590	117.606,00	0,11
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK		15.700	5.293,799	5.214,799	EUR 7,031	110.386,70	0,10
NL0010801007	IMCD N.V. Aandelen op naam	STK		1.390	1.390	0	EUR 47,485	66.004,15	0,06
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK		2.750	330	1.080	EUR 34,195	94.036,25	0,08
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK		3.370	3.370	0	EUR 18,665	62.901,05	0,06
IT0005090300	Infrastrutt. Wireless Italiane Azioni nom.	STK		12.790	12.790	0	EUR 5,030	64.333,70	0,06
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam	STK		14.000	16.500	2.500	EUR 15,190	212.660,00	0,19
ES0139140174	Inmobiliaria Colonial S.A. Acciones Port.	STK		8.600	8.600	0	EUR 7,642	65.721,20	0,06
IT0005211237	Italgas S.P.A. Azioni nom.	STK		20.000	28.000	8.000	EUR 4,474	89.480,00	0,08
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port.	STK		780	250	120	EUR 303,100	236.418,00	0,21
IE0004906560	Kerry Group PLC Reg.Shares A	STK		1.250	440	490	EUR 75,540	94.425,00	0,08
FR0000121964	Klépierre S.A. Actions Port.	STK		2.800	0	1.000	EUR 35,970	100.716,00	0,09
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK		44.360	15.460	0	EUR 2,812	124.740,32	0,11
FI0009013403	KONE Corp. (New) Reg.Shares Cl.B	STK		2.030	340	810	EUR 44,620	90.578,60	0,08
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen aan toonder	STK		1.536	74,232	578,232	EUR 64,020	98.334,72	0,09
NL0009432491	Koninklijke Vopak N.V. Aandelen aan toonder	STK		1.580	1.580	0	EUR 40,785	64.440,30	0,06
DE000LEG1110	LEG Immobilien AG Namens-Aktien	STK		1.150	190	440	EUR 81,440	93.656,00	0,08
DE0006483001	Linde AG Inhaber-Aktien	STK		1.200	550	0	EUR 168,650	202.380,00	0,18
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		660	200	190	EUR 184,700	121.902,00	0,11
IT0001479374	Luxottica Group S.p.A. Azioni nom. ¹⁾	STK		2.260	3.660	3.000	EUR 51,200	115.712,00	0,10
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Action Port.(C.R.)	STK		440	650	910	EUR 222,350	97.834,00	0,09
ES0124244E34	Mapfre S.A. Acciones Nom.	STK		35.920	4.170	12.250	EUR 3,090	110.992,80	0,10

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
ES0152503035	Mediaset España Comunicación Acciones Nom.	STK		12.170	2.870	0	EUR 10,905	132.713,85	0,12
ES0105025003	Merlin Properties SOCIMI S.A. Acciones Nominativas	STK		9.150	12.440	3.290	EUR 11,060	101.199,00	0,09
F00009007835	Metso Corp. Reg.Shares	STK		2.110	2.110	0	EUR 30,240	63.806,40	0,06
IT0004965148	Moncler S.p.A. Azioni nom.	STK		3.100	3.100	0	EUR 20,520	63.612,00	0,06
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG Namens-Aktien	STK		520	1.620	1.100	EUR 122,850	63.882,00	0,06
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		940	590	210	EUR 177,900	167.226,00	0,15
FR0000044448	Nexans S.A. Actions Port.	STK		1.320	1.320	0	EUR 47,975	63.327,00	0,06
FR0010112524	Nexity Actions au Porteur	STK		1.790	2.500	710	EUR 51,320	91.862,80	0,08
F00009005318	Nokian Renkaat Oyj Reg.Shares	STK		3.040	4.070	1.030	EUR 36,120	109.804,80	0,10
BE0974276082	Ontex Group N.V. Actions Nom.	STK		3.345	875	1.130	EUR 31,215	104.414,18	0,09
FR0000133308	Orange S.A. Actions Port.	STK		6.300	2.220	2.620	EUR 14,035	88.420,50	0,08
AT0000APOST4	Österreichische Post AG Inhaber-Aktien	STK		3.530	1.500	970	EUR 38,305	135.216,65	0,12
F00009014575	Outotec Oyj Reg.Shares	STK		10.790	10.790	0	EUR 6,000	64.740,00	0,06
NL0011821392	Philips Lighting N.V. Reg.Shares	STK		4.360	5.430	1.070	EUR 32,480	141.612,80	0,13
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE Namens-Aktien	STK		2.500	3.500	1.000	EUR 37,490	93.725,00	0,08
BE0003810273	Proximus S.A. Actions au Porteur	STK		2.100	2.100	0	EUR 30,770	64.617,00	0,06
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		1.330	1.615	2.035	EUR 65,480	87.088,40	0,08
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		4.620	6.490	1.870	EUR 18,490	85.423,80	0,08
NL0006144495	Relx N.V. Aandelen op naam	STK		6.250	8.460	8.310	EUR 18,105	113.156,25	0,10
FR0000130395	Remy Cointreau S.A. Actions au Porteur	STK		620	620	0	EUR 103,000	63.860,00	0,06
FR0000131906	Renault S.A. Actions Port.	STK		1.130	1.600	470	EUR 80,140	90.558,20	0,08
GB00B03MLX29	Royal Dutch Shell Reg.Shares Cl.A	STK		7.553,672	4.149,675	2.396,003	EUR 23,280	175.849,48	0,16
FR0000121253	Rubis S.A. Actions Port.	STK		1.130	190	360	EUR 99,420	112.344,60	0,10
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings PLC Reg.Shares	STK		8.070	10.120	2.050	EUR 17,740	143.161,80	0,13
IT0004712375	Salvatore Ferragamo SpA Azioni nom.	STK		2.670	2.670	0	EUR 23,470	62.664,90	0,06
F00009003305	Sampo OYJ Reg.Shares Cl.A	STK		2.670	1.300	830	EUR 45,280	120.897,60	0,11
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		2.040	1.110	420	EUR 85,150	173.706,00	0,16
DE000SHA0159	Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.	STK		8.100	3.300	2.900	EUR 12,610	102.141,00	0,09
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port.	STK		1.470	2.000	530	EUR 68,100	100.107,00	0,09
FR0010411983	SCOR SE Actions au Porteur	STK		4.325	1.375	0	EUR 35,160	152.067,00	0,14
LU0088087324	SES S.A. Bearer FDRs (rep.Shs A)	STK		4.420	1.600	1.680	EUR 20,890	92.333,80	0,08
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK		885	85	300	EUR 122,450	108.368,25	0,10
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC Reg.Shares	STK		6.045	1.845	0	EUR 27,220	164.544,90	0,15
IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom.	STK		30.820	19.600	9.180	EUR 3,900	120.198,00	0,11
FR0000120966	Société Bic S.A. Actions Port.	STK		1.150	1.500	350	EUR 104,250	119.887,50	0,11
FR0000130809	Société Générale S.A. Actions Port.	STK		2.860	1.355	795	EUR 47,805	136.722,30	0,12
FR0010613471	Suez S.A. Actions Port.	STK		8.790	2.690	0	EUR 16,250	142.837,50	0,13
DE000SYM9999	Symrise AG Inhaber-Aktien	STK		1.400	320	570	EUR 62,980	88.172,00	0,08
DE000TLX1005	Talanx AG Namens-Aktien	STK		3.380	1.200	1.120	EUR 32,860	111.066,80	0,10
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A. Azioni nom. 2)	STK		80.970	80.970	0	EUR 0,812	65.707,16	0,06
ES0178430E18	Telefónica S.A. Acciones Port.	STK		10.550	5.733	3.947	EUR 9,132	96.342,60	0,09
BE0003826436	Telenet Group Holding N.V. Actions au Porteur	STK		1.150	1.150	0	EUR 55,640	63.986,00	0,06
FR0000051807	Téléperformance SE Actions Port.	STK		1.250	1.250	0	EUR 112,950	141.187,50	0,13
IT0003007728	Tod's S.p.A. Azioni nom.	STK		1.090	1.090	0	EUR 55,250	60.222,50	0,05
FR0000120271	Total S.A. Actions au Porteur	STK		3.311,84	1.833,1	859,26	EUR 43,835	145.174,51	0,13
FR0000124711	Unibail-Rodamco SIIC Actions Port.	STK		440	0	160	EUR 222,800	98.032,00	0,09
NL0000009355	Unilever N.V. Cert.v.Aandelen	STK		3.750	2.200	1.150	EUR 48,870	183.262,50	0,16
DE000UNSE018	Uniper SE Namens-Aktien	STK		3.800	3.800	0	EUR 16,770	63.726,00	0,06
NL0000302636	Van Lanschot Kempen N.V. Aandelen aan toonder	STK		5.250	6.780	1.530	EUR 24,340	127.785,00	0,11
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK		2.020	850	480	EUR 75,300	152.106,00	0,14
F00009003727	Wärtsilä Corp. Reg.Shares	STK		1.220	1.220	0	EUR 52,000	63.440,00	0,06
DE0007472060	Wirecard AG Inhaber-Aktien	STK		1.130	1.130	0	EUR 56,600	63.958,00	0,06
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		2.610	2.970	3.560	EUR 37,285	97.313,85	0,09
AUD								262.407,04	0,23
AU000000DMP0	Domino's Pizza Enterprises Ltd Reg.Shares	STK		2.900	2.900	0	AUD 52,080	101.601,40	0,09
AU000000REA9	REA Group Ltd. Reg.Shares	STK		3.600	3.600	0	AUD 66,400	160.805,64	0,14
BRL								778.125,62	0,70
BRABEVACNOR1	AMBEV S.A. Reg.Shares	STK		27.000	27.000	0	BRL 18,250	130.812,22	0,12
BRCCROACNOR2	CCR S.A. Reg.Shares	STK		30.000	30.000	0	BRL 16,500	131.409,53	0,12
BRLAMEACNPR6	Lojas Americanas S.A. Reg.Pref.Shares	STK		27.750	27.750	0	BRL 13,730	101.147,51	0,09
BRODPVACNOR4	OdontoPrev S.A. Reg.Shares	STK		40.500	40.500	0	BRL 11,760	126.439,86	0,11
BRUGPAACNOR8	Ultrapar Participações S.A. Reg.Shares	STK		7.200	7.200	0	BRL 76,100	145.458,41	0,13
BRWEGEACNORO	Weg S.A. Reg.Shares	STK		30.750	30.750	0	BRL 17,500	142.858,09	0,13
CHF								2.428.826,47	2,20
CH0012410517	Bäloise Holding AG Namens-Aktien	STK		480	480	0	CHF 148,600	65.239,82	0,06
CH0225173167	Cembra Money Bank AG Namens-Aktien	STK		1.760	450	440	CHF 90,950	146.409,10	0,13
CH0010570759	Chocoladef. Lindt & Sprüngli vink.Namens-Aktien	STK		1	1	0	CHF 67.360,000	61.610,51	0,06
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien	STK		1.540	295	505	CHF 79,800	112.402,59	0,10
CH0012142631	Clariant AG Namens-Aktien	STK		3.410	11.410	8.000	CHF 20,980	65.435,37	0,06
CH0012138530	Credit Suisse Group AG Namens-Aktien	STK		11.313	22.813,25	11.500,25	CHF 14,060	145.484,19	0,13
CH0126673539	DKSH Holding AG Nam.-Aktien	STK		900	900	0	CHF 77,800	64.043,46	0,06
CH0030170408	Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.)	STK		240	0	90	CHF 449,600	98.693,89	0,09
CH0010645932	Givaudan SA Namens-Aktien	STK		50	10	20	CHF 1.930,000	88.263,27	0,08
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK		2.900	1.810	460	CHF 84,300	223.603,34	0,20
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		2.710	1.800	490	CHF 80,550	199.658,38	0,18
CH0002168083	Panalpina Welttransp.(Hldg) AG Namens-Aktien	STK		520	520	0	CHF 135,800	64.588,59	0,06
CH0002497458	SGS S.A. Namens-Aktien	STK		50	10	15	CHF 2.331,000	106.601,91	0,10
CH0000587979	Sika AG Inhaber-Aktien	STK		26	0	6	CHF 6.175,000	146.846,30	0,13
CH0012549785	Sonova Holding AG Namens-Aktien	STK		440	440	0	CHF 157,800	63.505,65	0,06
CH0267291224	Sunrise Communications Gr. AG Nam.-Aktien	STK		2.000	0	0	CHF 75,200	137.562,65	0,12

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)	
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien	STK		405	70	125	CHF 325,800	120.686,53	0,11	
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien	STK		1.050	310	460	CHF 88,250	84.753,32	0,08	
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien	STK		210	55	90	CHF 464,800	89.276,70	0,08	
CH0012453913	Temenos Group AG Namens-Aktien	STK		820	820	0	CHF 85,450	64.088,28	0,06	
CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien	STK		1.670	0	330	CHF 118,900	181.614,71	0,16	
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Namens-Aktien	STK		385	445	570	CHF 279,600	98.457,91	0,09	
DKK									964.806,26	0,88
DK0060227585	Christian Hansen Holding AS Navne-Aktier ¹⁾	STK		1.800	630	580	DKK 475,200	115.021,08	0,10	
DK0060448595	Coloplast AS Navne-Aktier B	STK		1.410	400	490	DKK 551,500	104.566,63	0,09	
DK0010234467	FLSmith & Co. AS Navne-Aktier B	STK		1.150	1.150	0	DKK 415,400	64.238,12	0,06	
DK0010272202	GENMAB AS Navne-Aktier	STK		340	340	0	DKK 1.394,000	63.733,86	0,06	
DK0010272632	GN Store Nord AS Navne-Aktier	STK		2.460	2.460	0	DKK 191,900	63.480,24	0,06	
DK0060542181	ISS AS Indehaver Aktier	STK		1.860	1.860	0	DKK 257,000	64.279,81	0,06	
DK0060497295	Matas A/S Indehaver Aktier	STK		4.665	1.155	2.490	DKK 102,000	63.985,32	0,06	
DK0060745370	Nets A/S Ihænderhaver-Aktier	STK		3.860	6.000	2.140	DKK 129,400	67.166,09	0,06	
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		4.050	5.500	3.450	DKK 276,900	150.801,78	0,14	
DK0060252690	Pandora A/S Navne-Aktier	STK		930	930	0	DKK 609,000	76.160,32	0,07	
DK0060228559	TDC A/S Navne-Aktier	STK		12.600	16.600	24.000	DKK 37,970	64.333,86	0,06	
DK0010268606	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier	STK		840	840	0	DKK 593,500	67.039,15	0,06	
GBP									6.449.940,26	5,85
GB00802J6398	Admiral Group PLC Reg.Shares	STK		2.870	2.870	0	GBP 20,030	65.548,20	0,06	
GB00BYM8GJ06	Ascential PLC Reg.Shares	STK		18.110	18.110	0	GBP 3,202	66.120,74	0,06	
GB0000536739	Ashtead Group PLC Reg.Shares	STK		7.000	0	2.000	GBP 16,020	127.867,00	0,12	
GB0030927254	ASOS PLC Reg.Shares	STK		990	990	0	GBP 57,800	65.247,06	0,06	
GB0006731235	Associated British Foods PLC Reg.Shares	STK		3.360	790	1.130	GBP 29,620	113.480,77	0,10	
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares	STK		2.210	2.470	2.310	GBP 51,940	130.885,68	0,12	
GB008BG9VN75	AVEVA Group PLC Reg.Shares	STK		2.850	2.850	0	GBP 19,260	62.589,15	0,06	
GB0002162385	Aviva PLC Reg.Shares	STK		19.750	26.000	21.250	GBP 5,315	119.692,88	0,11	
GB0002634946	BAE Systems PLC Reg.Shares	STK		15.000	20.360	21.360	GBP 6,380	109.121,38	0,10	
GB0080F99717	Berendsen PLC Reg.Shares	STK		4.810	9.610	4.800	GBP 12,210	66.966,66	0,06	
GB0000566504	BHP Billiton PLC Reg.Shares	STK		6.300	2.940	2.840	GBP 11,885	85.376,37	0,08	
GB0007980591	BP PLC Reg.Shares	STK		25.800	14.500	7.200	GBP 4,454	131.029,13	0,12	
GB0002875804	British American Tobacco PLC Reg.Shares	STK		3.400	2.100	600	GBP 52,510	203.572,39	0,18	
GB0030913577	BT Group PLC Reg.Shares	STK		23.700	17.000	11.300	GBP 2,929	79.152,68	0,07	
GB0031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares	STK		3.260	3.260	0	GBP 16,820	62.523,25	0,06	
GB00874CDH82	Cairn Energy PLC Reg.Shares	STK		34.220	34.220	0	GBP 1,709	66.683,75	0,06	
GB008033F229	Centrica PLC Reg.Shares	STK		36.000	20.180	15.680	GBP 2,029	83.288,01	0,07	
GB00806K4575	Compass Group PLC Reg.Shares	STK		7.288,461	7.288,461	0	GBP 16,390	136.211,17	0,12	
GB00BYZVW769	Croda International PLC Reg.Shares	STK		3.070	850	0	GBP 39,150	137.046,54	0,12	
GB0002374006	Diageo PLC Reg.Shares	STK		6.500	2.000	0	GBP 22,995	170.429,47	0,15	
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares	STK		22.000	31.280	9.280	GBP 3,566	89.454,45	0,08	
GB0008220112	DS Smith PLC Reg.Shares	STK		12.880	12.880	0	GBP 4,759	69.892,33	0,06	
GB00BYVWHR75	Equiniti Group PLC Reg.Shares	STK		23.960	23.960	0	GBP 2,473	67.549,33	0,06	
GB00819NLV48	Experian PLC Reg.Shares	STK		3.550	9.050	5.500	GBP 15,930	64.482,53	0,06	
GB00801FLG62	G4S PLC Reg.Shares	STK		17.250	17.250	0	GBP 3,281	64.534,69	0,06	
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC Reg.Shares	STK		9.050	5.800	1.950	GBP 16,435	169.596,24	0,15	
IE0003864109	Greencore Group PLC Reg.Shares	STK		47.000	37.076	13.076	GBP 2,463	131.995,83	0,12	
GB0004161021	Hays PLC Reg.Shares	STK		35.030	35.030	0	GBP 1,663	66.424,81	0,06	
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Reg.Shares	STK		25.200	13.000	4.800	GBP 7,124	204.702,14	0,18	
GB0004478896	Hunting PLC Reg.Shares	STK		12.090	12.090	0	GBP 4,846	66.804,80	0,06	
GB0004544929	Imperial Brands PLC Reg.Shares	STK		5.500	3.400	0	GBP 34,790	218.180,06	0,20	
GB00BMJ6DW54	Informa PLC Reg.Shares	STK		8.400	20.400	12.000	GBP 6,700	64.172,95	0,06	
GB00808QVH41	InterContinental Hotels Group Reg.Shares	STK		3.346	3.346,276	0,276	GBP 43,090	164.399,45	0,15	
GB0031638363	Intertek Group PLC Reg.Shares	STK		1.320	1.320	0	GBP 42,520	63.997,81	0,06	
GB0033986497	ITV PLC Reg.Shares	STK		62.560	22.560	0	GBP 1,815	129.470,64	0,12	
GB008Z4BQC70	Johnson, Matthey PLC Reg.Shares	STK		2.370	3.500	1.130	GBP 29,110	78.666,26	0,07	
GB00BKX5CN86	Just-Eat PLC Reg.Shares	STK		8.600	8.600	0	GBP 6,540	64.131,90	0,06	
GB0005758098	Meggitt PLC Reg.Shares	STK		11.760	30.560	18.800	GBP 4,812	64.525,42	0,06	
GB0080ZT6P94	Merlin Entertainment PLC Reg.Shares	STK		11.200	435	6.835	GBP 4,855	62.001,93	0,06	
GB0081CRLC47	Mondi PLC Reg.Shares	STK		2.860	2.860	0	GBP 19,950	65.058,92	0,06	
GB0080R05C01	National Grid PLC Reg.Shares	STK		6.280	9.592,916	3.312,916	GBP 9,587	68.649,96	0,06	
GB0083MBS747	Ocado Group PLC Reg.Shares	STK		19.480	19.480	0	GBP 2,897	64.348,05	0,06	
GB0030232317	PageGroup PLC Reg.Shares	STK		12.050	12.050	0	GBP 4,758	65.374,66	0,06	
GB0006825383	Persimmon PLC Reg.Shares	STK		5.000	6.500	1.500	GBP 22,480	128.163,47	0,12	
KYG7091M1096	Phoenix Group Holdings Reg.Shares	STK		10.700	15.000	4.300	GBP 7,715	94.127,74	0,08	
GB0007099541	Prudential PLC Reg.Shares	STK		6.470	9.960	7.990	GBP 17,765	131.059,17	0,12	
GB00824CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares	STK		2.200	900	0	GBP 77,420	194.210,98	0,17	
GB0007188757	Rio Tinto PLC Reg.Shares	STK		3.200	1.450	1.050	GBP 32,795	119.661,80	0,11	
GB0007197378	RPC Group PLC Reg.Shares	STK		10.410	15.000	4.590	GBP 7,525	89.321,33	0,08	
GB008KMKR23	RSA Insurance Group PLC Reg.Shares	STK		9.420	9.420	0	GBP 6,195	66.541,13	0,06	
GB0007990962	Shaftesbury PLC Reg.Shares	STK		5.920	5.920	0	GBP 9,720	65.612,40	0,06	
GB0009223206	Smith & Nephew PLC Reg.Shares	STK		4.250	11.050	6.800	GBP 13,340	64.646,15	0,06	
GB00BYZFZ918	Sophos Group PLC Reg.Shares (WI)	STK		39.480	18.430	7.150	GBP 4,402	198.164,16	0,18	
GB0007908733	SSE PLC Shares	STK		6.300	3.200	2.200	GBP 14,700	105.598,03	0,10	
GB0084YCDF59	Talk Talk Telecom Group PLC Reg.Shares	STK		32.630	32.630	0	GBP 1,791	66.636,26	0,06	
GB0008754136	Tate & Lyle PLC Reg.Shares	STK		8.180	20.080	11.900	GBP 6,650	62.025,87	0,06	
GB0088C3BL03	The Sage Group PLC Reg.Shares	STK		8.060	8.060	0	GBP 6,850	62.954,03	0,06	
GB0009465807	The Weir Group PLC Reg.Shares	STK		3.290	3.290	0	GBP 17,440	65.424,48	0,06	
GB0001500809	Tullow Oil PLC Reg.Shares	STK		38.370	38.370	0	GBP 1,507	65.933,02	0,06	
GB008H4HKS39	Vodafone Group PLC Reg.Shares	STK		85.200	66.500	14.800	GBP 2,185	212.221,60	0,19	

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
GB00B1KJJ408	Whitbread PLC Reg.Shares		STK	2.700	2.100	800	GBP 39,950	122.992,46	0,11
GB0031698896	William Hill PLC Reg.Shares		STK	22.960	22.960	0	GBP 2,539	66.471,05	0,06
GB00BYK2V80	Worldpay Group Plc Reg.Shares		STK	38.830	12.730	0	GBP 3,149	139.424,14	0,13
JE00B8KF9B49	WPP PLC Reg.Shares		STK	4.170	1.470	2.000	GBP 16,300	77.503,55	0,07
HKD								1.816.645,42	1,64
KYG2953R1149	AAC Technologies Holdings Inc. Reg.Shares New		STK	18.000	18.000	0	HKD 97,600	197.279,10	0,18
HK000069689	Ala Group Ltd. Reg.Shares		STK	27.000	27.000	0	HKD 57,050	172.972,94	0,16
KYG040111059	Anta Sports Products Ltd. Reg.Shares		STK	66.000	66.000	0	HKD 25,800	191.215,20	0,17
HK0270001396	Guangdong Investment Ltd. Reg.Shares		STK	112.000	112.000	0	HKD 10,760	135.328,43	0,12
KYG4232C1087	Haitian Intl Hldgs Ltd. Reg.Shares		STK	93.000	93.000	0	HKD 21,900	228.710,35	0,21
HK0003000038	Hongkong & China Gas Co. Ltd. Reg.Shares		STK	99.000	99.000	0	HKD 14,680	163.199,95	0,15
HK0388045442	Hongkong Exch. + Clear. Ltd. Reg.Shares		STK	6.800	6.800	0	HKD 201,800	154.095,10	0,14
CNE1000003X6	Ping An Insurance(Grp)Co.China Reg.Shares H		STK	33.000	33.000	0	HKD 51,450	190.659,34	0,17
KYG7800X1079	Sands China Ltd. Reg.Shares Reg.S		STK	40.000	40.000	0	HKD 35,750	160.581,24	0,14
KYG875721634	Tencent Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	7.100	7.100	0	HKD 279,200	222.603,77	0,20
IDR								342.476,04	0,31
ID1000109507	Bank Central Asia TBK, PT Reg.Shares		STK	148.500	148.500	0	IDR 18.150,000	176.840,40	0,16
ID1000095003	PT Bank Mandiri (Persero) Reg.Shares		STK	198.000	198.000	0	IDR 12.750,000	165.635,64	0,15
JPY								3.473.925,62	3,13
JP3152740001	ABC-Mart Inc. Reg.Shares		STK	2.300	4.600	2.300	JPY 6.610,000	118.922,09	0,11
JP3172500005	Autobacs Seven Co. Ltd. Reg.Shares		STK	10.000	20.000	10.000	JPY 1.824,000	142.678,35	0,13
JP3937200008	Azbil Corp. Reg.Shares		STK	4.900	9.700	4.800	JPY 4.270,000	163.665,52	0,15
JP3835620000	Benesse Holdings Inc. Reg.Shares ¹⁾		STK	5.600	11.200	5.600	JPY 4.240,000	185.732,17	0,17
JP3766550002	Hakuhodo DY Holdings Inc. Reg.Shares ¹⁾		STK	12.400	24.800	12.400	JPY 1.491,000	144.621,40	0,13
JP3678800008	Hitachi High-Technologies Corp. Reg.Shares ¹⁾		STK	4.600	9.200	4.600	JPY 4.360,000	156.883,60	0,14
JP3853000002	Horiba Ltd. Reg.Shares		STK	3.200	6.300	3.100	JPY 6.830,000	170.963,70	0,15
JP3143900003	Itochu Techno-Solutions Corp. Reg.Shares		STK	6.000	12.000	6.000	JPY 3.930,000	184.449,31	0,17
JP3183200009	Japan Exchange Group Inc. Reg.Shares		STK	10.500	21.000	10.500	JPY 2.035,000	167.142,52	0,15
JP3870000001	Mabuchi Motor Co. Ltd. Reg.Shares ¹⁾		STK	3.200	6.400	3.200	JPY 5.590,000	139.924,91	0,13
JP3117700009	Mebuki Financial Group Inc. Reg.Shares ¹⁾		STK	41.300	82.500	41.200	JPY 418,000	135.039,11	0,12
JP3822000000	Miraca Holdings Inc. Reg.Shares ¹⁾		STK	3.300	6.500	3.200	JPY 5.050,000	130.358,26	0,12
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co. Ltd. Reg.Shares ¹⁾		STK	5.100	10.200	5.100	JPY 4.250,000	169.547,87	0,15
JP3173400007	Obic Co. Ltd. Reg.Shares ¹⁾		STK	2.800	5.600	2.800	JPY 6.900,000	151.126,41	0,14
JP3188200004	Otsuka Corp. Reg.Shares ¹⁾		STK	3.000	5.900	2.900	JPY 6.970,000	163.563,83	0,15
JP3105220002	Seven Bank Ltd. Reg.Shares ¹⁾		STK	45.700	91.400	45.700	JPY 402,000	143.706,20	0,13
JP3358200008	Shimamura Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.070	2.070	1.000	JPY 13.760,000	115.168,96	0,10
JP3358000002	Shimano Inc. Reg.Shares		STK	960	1.860	900	JPY 17.780,000	133.516,90	0,12
JP3162600005	SMC Corp. Reg.Shares		STK	675	1.175	500	JPY 34.150,000	180.313,28	0,16
JP3351100007	Systemex Corp. Reg.Shares		STK	2.200	4.300	2.100	JPY 6.710,000	115.472,47	0,10
JP3627000007	Toda Corp. Reg.Shares		STK	29.300	58.600	29.300	JPY 700,000	160.434,92	0,14
JP3424950008	Tokyo Century Corp. Reg.Shares		STK	4.300	8.500	4.200	JPY 4.490,000	151.024,72	0,14
JP3935300008	Yamaguchi Financial Group Inc. Reg.Shares ¹⁾		STK	14.100	28.200	14.100	JPY 1.357,000	149.669,12	0,13
KRW								111.783,54	0,10
KR7090430000	Amorepacific Corp. Reg.Shares		STK	480	480	0	KRW 304.000,000	111.783,54	0,10
MXN								139.084,96	0,13
MX01WA000038	Wal-Mart de Mexico SAB de CV Reg.Shares Class V		STK	69.000	69.000	0	MXN 41,650	139.084,96	0,13
MYR								138.040,47	0,12
MYL694700005	Digi.com Berhad Reg.Shares		STK	135.000	135.000	0	MYR 5,010	138.040,47	0,12
NOK								768.219,41	0,70
NO0010633951	B2Holding ASA Navne-Aksjer		STK	63.000	85.225	22.225	NOK 16,300	107.369,15	0,10
FO0000000179	Bakkafrost P/F Navne-Aktier		STK	4.000	5.000	1.000	NOK 309,800	129.566,51	0,12
NO0010031479	DnB ASA Navne-Aksjer A		STK	12.000	14.500	2.500	NOK 141,500	177.537,07	0,16
NO0010096985	Statoil ASA Navne-Aksjer		STK	9.850	5.500	2.550	NOK 139,400	143.565,59	0,13
NO0010063308	Telenor ASA Navne-Aksjer		STK	9.340	6.000	2.560	NOK 138,100	134.862,72	0,12
NO0010208051	Yara International ASA Navne-Aksjer		STK	2.320	3.500	1.180	NOK 310,500	75.318,37	0,07
SEK								856.521,47	0,78
SE0007100581	Assa-Abloy AB Namn-Aktier B		STK	7.090	9.000	1.910	SEK 185,700	136.246,68	0,12
SE0005999778	Com Hem Holding AB (publ) Namn-Aktier		STK	5.280	5.280	0	SEK 117,500	64.200,67	0,06
SE0000163628	Elekta AB Namn-Aktier B		STK	7.810	7.810	0	SEK 79,550	64.292,31	0,06
SE0002683557	Loomis AB Namn-Aktier S.B		STK	1.900	1.900	0	SEK 303,800	59.732,29	0,05
SE0000825820	Lundin Petroleum AB Namn-Aktier		STK	3.820	3.820	0	SEK 163,000	64.434,54	0,06
SE0000427361	Nordea Bank AB Namn-Aktier		STK	12.630	4.500	3.370	SEK 108,300	141.546,65	0,13
SE0000163594	Securitas AB Namn-Aktier B		STK	4.410	4.410	0	SEK 142,500	65.031,12	0,06
SE0000242455	Swedbank AB Namn-Aktier A		STK	6.200	8.000	1.800	SEK 206,400	132.424,76	0,12
SE0000310336	Swedish Match AB Namn-Aktier		STK	2.080	2.080	0	SEK 298,000	64.142,72	0,06
SE0005190238	Tele2 AB Namn-Aktier B		STK	7.000	7.000	0	SEK 89,000	64.469,73	0,06
SGD								114.980,75	0,10
SG1U89935555	M1 Ltd. Reg.Shares		STK	82.500	82.500	0	SGD 2,190	114.980,75	0,10
THB								470.228,16	0,43
TH0268010211	Advanced Info Service (ADVANC) PCL Reg.Shares (Fo)		STK	33.000	33.000	0	THB 177,500	151.093,64	0,14
TH0168A10219	Bumrungrad Hospital PCL Reg.Shares (Foreign)		STK	33.000	33.000	0	THB 172,000	146.411,86	0,13
TH0646010015	PTT PCL Reg.Shares (Foreign)		STK	18.000	18.000	0	THB 372,000	172.722,66	0,16
TWD								1.051.455,44	0,95
TW0002395001	Advantech Co. Ltd. Reg.Shares		STK	23.099,237	23.099,237	0	TWD 215,500	143.408,21	0,13
TW0001476000	Eclat Textile Company Ltd. Reg.Shares		STK	13.000	13.000	0	TWD 371,000	138.946,11	0,13
TW0003008008	Largan Precision Co.Ltd. Reg.Shares		STK	2.000	2.000	0	TWD 4.850,000	279.447,90	0,25
TW0001477008	Makalot Industrial Co.Ltd. Reg.Shares		STK	34.000	34.000	0	TWD 147,000	143.987,69	0,13
TW0002912003	President Chain Store Corp. Reg.Shares		STK	21.000	21.000	0	TWD 273,500	165.464,85	0,15
TW0002330008	Taiwan Semiconductor Manufact. Co. Reg.Shares		STK	30.000	30.000	0	TWD 208,500	180.200,68	0,16

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
USD								10.209.159,20	9,21
US88579Y1010	3M Co. Reg.Shares	STK		500	900	400	USD 207,850	91.090,37	0,08
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares	STK		1.560	1.560	0	USD 72,480	99.104,92	0,09
US01609W1027	Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)	STK		1.800	1.800	0	USD 140,810	222.156,19	0,20
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		260	440	180	USD 937,820	213.720,05	0,19
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares	STK		250	430	180	USD 975,930	213.850,91	0,19
US02376R1023	American Airlines Group Inc. Reg.Shares	STK		2.200	2.200	0	USD 49,620	95.682,36	0,09
US0268747849	American International Grp Inc. Reg.Shares New	STK		1.540	1.540	0	USD 63,500	85.713,03	0,08
US03076C1062	Ameriprise Financial Inc. Reg.Shares	STK		960	960	0	USD 128,020	107.721,27	0,10
US03073E1055	AmerisourceBergen Corp. Reg.Shares	STK		1.220	1.220	0	USD 95,760	102.399,16	0,09
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares	STK		2.300	4.000	1.700	USD 143,680	289.652,03	0,26
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares	STK		3.200	3.200	0	USD 41,440	116.231,05	0,10
US04621X1081	Assurant Inc. Reg.Shares	STK		1.070	1.070	0	USD 104,200	97.724,60	0,09
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares	STK		8.800	13.200	4.400	USD 24,320	187.585,24	0,17
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New	STK		1.600	2.400	800	USD 169,300	237.426,59	0,21
US0936711052	Block H. & R. Inc. Reg.Shares	STK		4.150	4.150	0	USD 30,880	112.325,36	0,10
US0970231058	Boeing Co. Reg.Shares	STK		500	800	300	USD 197,460	86.536,94	0,08
US12673P1057	CA Inc. Reg.Shares	STK		2.900	2.900	0	USD 34,270	87.109,30	0,08
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares	STK		1.100	1.900	800	USD 104,120	100.387,41	0,09
US1729674242	Citigroup Inc. New Reg.Shares	STK		2.300	3.500	1.200	USD 66,980	135.028,49	0,12
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl. A	STK		3.200	5.400	2.200	USD 38,870	109.022,70	0,10
US2067871036	Conduent Inc. Reg.Shares	STK		6.150	6.150	0	USD 15,780	85.061,79	0,08
US2193501051	Corning Inc. Reg.Shares	STK		3.900	3.900	0	USD 30,370	103.815,41	0,09
US2220702037	Coty Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		4.600	4.600	0	USD 18,900	76.203,00	0,07
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares	STK		2.300	4.000	1.700	USD 80,700	162.687,35	0,15
US30303M1027	Facebook Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		1.100	1.800	700	USD 151,040	145.625,38	0,13
US35906A1088	Frontier Communications Corp. Reg.Shares	STK		28.000	28.000	0	USD 1,185	29.082,30	0,03
US3696041033	General Electric Co. Reg.Shares	STK		10.950	22.550	11.600	USD 27,020	259.329,48	0,23
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares	STK		1.250	1.250	0	USD 70,860	77.636,08	0,07
US4128221086	Harley-Davidson Inc. Reg.Shares	STK		1.600	1.600	0	USD 54,080	75.841,88	0,07
US40415F1012	HDFC Bank Ltd. Reg.Shs (Spons.ADRs)	STK		2.500	2.500	0	USD 86,080	188.623,02	0,17
US4385161066	Honeywell International Inc. Reg.Shares	STK		600	1.000	400	USD 132,320	69.587,17	0,06
US4567881085	Infosys Ltd. Reg.Shares (Spons.ADRs)	STK		10.500	10.500	0	USD 14,890	137.036,55	0,12
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares	STK		3.400	4.100	700	USD 132,640	395.280,92	0,36
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares	STK		4.700	8.900	4.200	USD 91,150	375.497,41	0,34
GB0088W67662	Liberty Global Inc. Reg.Shares A	STK		2.420	2.420	0	USD 31,710	67.261,11	0,06
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A	STK		1.200	1.200	0	USD 83,770	88.109,39	0,08
US55959Q2021	Magnit PJSC Reg.Shs(Sp.GDRsREGS)	STK		4.000	4.000	0	USD 33,370	116.995,35	0,11
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares	STK		800	2.500	1.700	USD 153,130	107.374,88	0,10
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK		3.500	6.300	2.800	USD 64,340	197.379,26	0,18
VGG607541015	Michael Kors Holdings Ltd Reg.Shares	STK		1.860	1.860	0	USD 35,700	58.201,42	0,05
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK		6.400	8.450	2.050	USD 68,490	384.201,95	0,35
NL0010831061	Mobileye N.V. Aandelen op naam	STK		1.170	1.170	0	USD 62,850	64.453,06	0,06
US63938C1080	Navient Corp. Reg.Shares	STK		6.200	6.200	0	USD 16,640	90.426,86	0,08
US6556641008	Nordstrom Inc. Reg.Shares	STK		1.700	1.700	0	USD 47,560	70.866,86	0,06
US6293775085	NRG Energy Inc. Reg.Shares	STK		8.200	8.200	0	USD 17,020	122.327,99	0,11
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares	STK		1.200	1.200	0	USD 146,680	154.278,20	0,14
US6826801036	Oneok Inc. (New) Reg.Shares	STK		1.900	1.900	0	USD 51,520	85.798,93	0,08
US7033951036	Patterson Companies Inc. Reg.Shares	STK		1.950	1.950	0	USD 47,590	81.339,73	0,07
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK		7.700	10.900	3.200	USD 33,630	226.970,81	0,20
US7181721090	Philip Morris Internat. Inc. Reg.Shares	STK		1.200	6.500	5.300	USD 117,080	123.144,89	0,11
US7185461040	Phillips 66 Reg.Shares	STK		1.150	1.150	0	USD 81,870	82.523,01	0,07
US7244791007	Pitney-Bowes Inc. Reg.Shares	STK		6.300	6.300	0	USD 15,280	84.375,49	0,08
US74736K1016	Qorvo Inc. Reg.Shares	STK		1.750	1.750	0	USD 64,290	98.612,94	0,09
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares	STK		1.400	1.400	0	USD 55,080	67.588,75	0,06
US74762E1029	Quanta Services Inc. Reg.Shares	STK		3.050	3.050	0	USD 31,880	85.225,70	0,08
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares	STK		1.080	1.080	0	USD 110,540	104.639,50	0,09
IE00858JVZ52	Seagate Technology PLC Reg.Shares	STK		2.600	2.600	0	USD 38,910	88.672,10	0,08
US84265V1052	Southern Copper Corp. Reg.Shares	STK		6.600	6.600	0	USD 34,770	201.141,20	0,18
US8715031089	Symantec Corp. Reg.Shares	STK		3.850	3.850	0	USD 28,060	94.689,28	0,09
US8718291078	Sysco Corp. Reg.Shares	STK		1.770	1.770	0	USD 49,860	77.353,14	0,07
US87612E1064	Target Corp. Reg.Shares	STK		1.300	1.300	0	USD 52,090	59.354,02	0,05
CH0102993182	TE Connectivity Ltd. Namens-Aktien	STK		1.420	1.420	0	USD 78,090	97.193,27	0,09
US8816091016	Tesoro Corp. Reg.Shares	STK		1.080	1.080	0	USD 93,240	88.262,95	0,08
US00130H1059	The AES Corp. Reg.Shares	STK		7.800	7.800	0	USD 11,160	76.297,66	0,07
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK		1.350	1.350	0	USD 88,130	104.282,15	0,09
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares	STK		3.000	9.600	6.600	USD 44,830	117.880,62	0,11
US2605431038	The Dow Chemical Co. Reg.Shares	STK		2.300	3.800	1.500	USD 62,710	126.420,37	0,11
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK		800	1.400	600	USD 152,160	106.694,71	0,10
US5543821012	The Macerich Co. Reg.Shares	STK		1.400	1.400	0	USD 58,950	72.337,63	0,07
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK		2.000	8.750	6.750	USD 86,990	152.493,65	0,14
US89417E1091	The Travelers Companies Inc. Reg.Shares	STK		870	870	0	USD 126,390	96.379,44	0,09
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares	STK		1.000	1.700	700	USD 105,710	92.654,92	0,08
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		1.300	1.300	0	USD 61,570	70.156,02	0,06
US9100471096	United Continental Holdg. Inc. Reg.Shares	STK		1.550	1.550	0	USD 75,440	102.491,02	0,09
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares	STK		700	1.200	500	USD 185,270	113.672,54	0,10
US91913Y1001	Valero Energy Corp. Reg.Shares	STK		1.560	1.560	0	USD 67,090	91.734,95	0,08
US92214X1063	Varex Imaging Corp Reg.Shares	STK		400	400	0	USD 34,140	11.969,50	0,01
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc. Reg.Shares	STK		1.000	1.000	0	USD 102,680	89.999,12	0,08
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		900	900	0	USD 94,420	74.483,30	0,07

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US9497461015	Wells Fargo & Co. Reg.Shares		STK	4.000	6.000	2.000	USD 55,780	195.564,90	0,18
US9668371068	Whole Foods Market Inc. Reg.Shares		STK	3.000	3.000	0	USD 42,070	110.623,19	0,10
US9841216081	Xerox Corp. Reg.Shares		STK	2.425	2.425	0	USD 29,120	61.895,00	0,06
BMG982941046	XL Group Ltd. Reg.Shares		STK	2.600	2.600	0	USD 44,140	100.590,76	0,09
ZAR								1.093.252,32	1,00
ZAE000049433	Avi Ltd. Reg.Shares		STK	25.500	25.500	0	ZAR 94,800	161.825,64	0,15
ZAE000066304	Firststrand Ltd. Reg.Shares		STK	45.000	45.000	0	ZAR 47,540	143.209,07	0,13
ZAE000200457	Mr. Price Group Ltd. Reg.Shares		STK	9.450	9.450	0	ZAR 155,000	98.053,33	0,09
ZAE000117321	New Bidvest Group Ltd. Reg.Shares New		STK	13.500	13.500	0	ZAR 156,680	141.594,43	0,13
ZAE000012084	Shoprite Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	10.800	10.800	0	ZAR 199,160	143.987,47	0,13
ZAE000058517	The SPAR Group Ltd. Reg.Shares		STK	10.650	10.650	0	ZAR 154,120	109.877,16	0,10
ZAE000071080	Tiger Brands Ltd. Reg.Shares New		STK	5.700	5.700	0	ZAR 365,300	139.387,35	0,13
ZAE000132577	Vodacom Group Ltd. Reg.Shares		STK	14.250	14.250	0	ZAR 162,820	155.317,87	0,14
Verzinsliche Wertpapiere								17.278.209,05	15,50
EUR								6.328.440,73	5,67
DE000A1TNDK2	7,6250 % Aareal Bank AG Subord. Nts 14/Und. Reg.S		EUR	200.000	200.000	0	% 105,950	211.900,00	0,19
XS0863907522	7,7500 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 12/42		EUR	200.000	400.000	200.000	% 123,875	247.750,00	0,22
XS1311440082	5,5000 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 15/47		EUR	200.000	650.000	450.000	% 111,500	223.000,00	0,20
XS1428773763	5,0000 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 16/48		EUR	200.000	450.000	250.000	% 107,500	215.000,00	0,19
XS1567439689	5,6250 % Banque Centrale de Tunisie Notes 17/24		EUR	600.000	600.000	0	% 102,000	612.000,00	0,55
XS1637277572	1,0000 % BNP Paribas S.A. MTN 17/24		EUR	275.000	275.000	0	% 99,046	272.375,13	0,25
XS1551677260	2,7500 % NTPC Ltd. MTN 17/27		EUR	350.000	350.000	0	% 104,575	366.012,50	0,33
XS0205545840	7,8200 % Rep. Argentinien Bonds 05/33 ³⁾		EUR	900.000	900.000	0	% 147,450	1.327.045,60	1,18
XS1631414932	5,1250 % Republik Côte d'Ivoire Notes 17/25 Reg.S		EUR	500.000	500.000	0	% 101,600	508.000,00	0,46
PTOTESOE0013	2,2000 % Republik Portugal Obr. 15/22		EUR	250.000	250.000	0	% 104,697	261.742,50	0,24
SI0002103487	1,5000 % Republik Slowenien Bonds 15/35		EUR	1.250.000	4.500.000	3.250.000	% 93,920	1.174.000,00	1,05
SI0002103685	1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27		EUR	500.000	4.400.000	3.900.000	% 101,023	505.115,00	0,45
XS1624344542	2,5000 % Stora Enso Oyj MTN 17/27		EUR	200.000	550.000	350.000	% 99,500	199.000,00	0,18
XS1591694481	2,9950 % TenneT Holding B.V. FLR Securit. 17/Und.		EUR	200.000	475.000	275.000	% 102,750	205.500,00	0,18
CZK								967.628,10	0,86
CZ0001004469	1,0000 % Tschechien Bonds S.95 15/26		CZK	25.000.000	25.000.000	0	% 101,450	967.628,10	0,86
USD								9.982.140,22	8,97
XS1558077845	6,1250 % Arabische Republik Ägypten MTN 17/22 Reg.S		USD	950.000	950.000	0	% 102,250	851.411,17	0,76
XS1558078736	7,5000 % Arabische Republik Ägypten MTN 17/27 Reg.S		USD	300.000	300.000	0	% 106,500	280.042,07	0,25
USN1384FAA32	5,1250 % Bharti Airtel Intl (NL) B.V. Notes 13/23 Reg.S		USD	400.000	400.000	0	% 105,319	369.248,84	0,33
XS0579851949	5,7500 % ESKOM Holdings SOC Limited Bonds 11/21 Reg.S		USD	400.000	600.000	200.000	% 101,059	354.311,51	0,32
XS1187065443	7,1250 % ESKOM Holdings SOC Limited MTN 15/25 Reg.S ¹⁾		USD	250.000	500.000	250.000	% 102,130	223.792,62	0,20
XS0617134092	6,8750 % Georgien Notes 11/21 Reg.S		USD	300.000	300.000	0	% 111,750	293.846,96	0,26
US404280AG49	6,5000 % HSBC Holdings PLC Notes 06/36		USD	100.000	100.000	0	% 129,038	113.101,50	0,10
US404280AH22	6,5000 % HSBC Holdings PLC Notes 07/37		USD	100.000	100.000	0	% 129,347	113.372,78	0,10
US404280AJ87	6,8000 % HSBC Holdings PLC Notes 08/38		USD	400.000	400.000	0	% 133,706	468.773,78	0,42
US404280BH13	4,3750 % HSBC Holdings PLC Notes 16/26		USD	200.000	200.000	0	% 104,163	182.597,07	0,16
XS1589748356	3,8750 % Indonesia Eximbank MTN 17/24		USD	200.000	200.000	0	% 101,525	177.973,53	0,16
XS1595713279	3,8750 % JSC Natl Company KazMunayGas MTN 17/22 Reg.S		USD	200.000	200.000	0	% 98,750	173.108,95	0,16
XS1595713782	4,7500 % JSC Natl Company KazMunayGas MTN 17/27 Reg.S		USD	200.000	200.000	0	% 98,511	172.689,98	0,16
XS1595714087	5,7500 % JSC Natl Company KazMunayGas MTN 17/47 Reg.S ¹⁾		USD	525.000	525.000	0	% 95,000	437.154,88	0,39
USY7138AAF76	5,6250 % PT Pertamina (Persero) Notes 13/43 Reg.S		USD	250.000	250.000	0	% 103,875	227.616,36	0,20
XS0686701953	5,5000 % Republic of Namibia Notes 11/21 Reg.S		USD	200.000	200.000	0	% 107,875	189.105,09	0,17
USP37878AC26	4,5000 % Republik Bolivien Notes 17/28 Reg.S ³⁾		USD	700.000	700.000	0	% 98,275	602.966,96	0,54
XS1631415400	6,1250 % Republik Côte d'Ivoire Notes 17/33 Reg.S ³⁾		USD	625.000	625.000	0	% 96,630	529.351,83	0,48
USY20295AG94	6,2500 % Republik Sri Lanka Bonds 11/21 Reg.S		USD	200.000	200.000	0	% 105,875	185.599,09	0,17
US900123AX87	7,0000 % Republik Türkei Notes 05/20		USD	400.000	400.000	0	% 109,633	384.373,74	0,35
USY9384RAA87	4,8000 % Republik Vietnam Notes 14/24 Reg.S		USD	500.000	1.000.000	500.000	% 105,375	461.806,47	0,42
XS1572343744	4,7500 % SSE PLC FLR Notes 17/77		USD	500.000	500.000	0	% 103,250	452.493,65	0,41
XS1405782159	3,2500 % Staat Katar Bonds 16/26 Reg.S		USD	300.000	300.000	0	% 97,250	255.719,17	0,23
XS1405781854	4,6250 % Staat Katar Bonds 16/46 Reg.S		USD	200.000	200.000	0	% 101,000	177.053,20	0,16
USG8450LAG98	2,7500 % State Grid Overs.Inv.(16) Ltd. Notes 17/22 Reg.S		USD	500.000	500.000	0	% 99,752	437.163,64	0,39
USG8450LAJ38	3,5000 % State Grid Overs.Inv.(16) Ltd. Notes 17/27 Reg.S		USD	500.000	500.000	0	% 100,105	438.708,48	0,39
US92343VDU52	5,2500 % Verizon Communications Inc. Notes 17/37		USD	750.000	1.000.000	250.000	% 107,850	708.979,75	0,64
US92343VDV36	5,5000 % Verizon Communications Inc. Notes 17/47		USD	750.000	1.000.000	250.000	% 109,493	719.777,15	0,65
Andere Wertpapiere								123.248,45	0,11
CHF								123.248,45	0,11
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	550	740	610	CHF 245,000	123.248,45	0,11

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								22.218.561,13	19,94
Verzinsliche Wertpapiere								22.218.561,13	19,94
EUR								2.400.040,13	2,17
ES0213307046	3,3750 % BANKIA S.A. FLR Obl. 17/27 ¹⁾	EUR		300.000	300.000	0	% 102,212	306.634,50	0,28
XS1624790751	0,7500 % Export-Import Bank of China MTN 17/22	EUR		800.000	800.000	0	% 99,393	795.140,00	0,72
XS1634531344	2,7500 % Intrum Justitia AB Notes 17/22 Reg.S	EUR		375.000	375.000	0	% 100,438	376.640,63	0,34
XS1634532748	3,1250 % Intrum Justitia AB Notes 17/24 Reg.S	EUR		300.000	300.000	0	% 100,125	300.375,00	0,27
ES0224244089	4,3750 % Mapfre S.A. FLR Obl. 17/47	EUR		200.000	200.000	0	% 106,750	213.500,00	0,19
XS1574789746	6,8750 % Nyrstar Netherlands (Hlds)B.V. Notes 17/24 Reg.S	EUR		400.000	950.000	550.000	% 101,938	407.750,00	0,37
RUB								1.313.372,63	1,17
RU000A0JWM07	7,7500 % Russische Föderation Bonds S.26219RMFS 16/26	RUB		30.000.000	30.000.000	0	% 99,900	442.515,77	0,40
RU000A0JXF01	7,7000 % Russische Föderation Bonds S.26221RMFS 17/33	RUB		60.000.000	60.000.000	0	% 98,300	870.856,86	0,77
USD								18.505.148,37	16,60
XS1569829200	3,5000 % ABQ Finance Ltd. MTN 17/22	USD		200.000	550.000	350.000	% 98,625	172.889,82	0,16
XS1598047550	3,8750 % Africa Finance Corp. MTN 17/24 Reg.S ¹⁾	USD		375.000	375.000	0	% 99,202	326.064,95	0,29
XS1633896813	4,1250 % African Export-Import Bank MTN 17/24	USD		1.600.000	1.600.000	0	% 99,250	1.391.883,60	1,24
XS1589745170	4,6250 % China Oil & Gas Group Ltd. Notes 17/22	USD		775.000	775.000	0	% 100,563	683.109,28	0,61
XS1151974877	6,6250 % Demokrat. Bdsrep. Äthiopien Notes 14/24 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 99,130	173.775,09	0,16
USP3579EBV85	5,9500 % Dominikanische Republik Bonds 17/27 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 104,500	183.188,71	0,16
XS1520309839	5,3750 % East.& South.Afr.Trd.& Dev. BK MTN 17/22	USD		900.000	900.000	0	% 102,066	805.148,57	0,72
XS1533915721	5,3750 % Evraz Group S.A. Notes 17/23 Reg.S	USD		200.000	500.000	300.000	% 100,750	176.614,95	0,16
XS1400710726	7,2500 % GTH Finance B.V. Notes 16/23 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 110,497	193.701,46	0,17
US44987DAJ54	2,0000 % ING Bank N.V. MTN 15/18 Reg.S	USD		500.000	0	0	% 99,995	438.228,59	0,39
XS1117279882	6,1250 % Königreich Jordanien Notes 15/26 Reg.S	USD		600.000	600.000	0	% 102,750	540.362,87	0,49
USG53770AB22	6,8750 % Latam Finance Ltd. Notes 17/24 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 102,000	178.806,21	0,16
XS0814512223	7,0000 % Northern Lights III B.V. LPN 12/19 ³⁾	USD		500.000	500.000	0	% 58,011	254.231,86	0,23
XS1565437487	4,0000 % Oil India Intern. Pte. Ltd. Notes 17/27 ¹⁾	USD		550.000	850.000	300.000	% 100,420	484.097,86	0,44
USP7808BA54	4,7500 % Petróleos d.Per Nts 17/32 Reg.S	USD		400.000	400.000	0	% 99,875	350.162,15	0,32
USP7808BA838	5,6250 % Petróleos d.Per Nts 17/47 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 101,300	177.579,10	0,16
XS0584493349	10,8750 % Province of Buenos Aires Bonds 11/21 Reg.S ³⁾	USD		500.000	500.000	0	% 114,675	502.563,77	0,45
US040114HL72	6,8750 % Rep. Argentinien Bonds 17/27	USD		475.000	475.000	0	% 103,650	431.534,32	0,39
XS1311099540	5,2500 % Republic of Namibia Notes 15/25 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 103,125	180.778,33	0,16
XS1318576086	9,5000 % Republik Angola Notes 15/25 Reg.S	USD		500.000	500.000	0	% 105,625	462.902,09	0,42
XS1626768730	8,7500 % Republik Ecuador Notes 17/23 Reg.S	USD		850.000	850.000	0	% 98,500	733.850,47	0,66
US698299BD54	4,0000 % Republik Panama Bonds 14/24	USD		200.000	200.000	0	% 105,125	184.284,34	0,17
US698299BG85	4,5000 % Republik Panama Bonds 17/47 ³⁾	USD		200.000	200.000	0	% 101,625	178.148,83	0,16
USP75744AD76	5,0000 % Republik Paraguay Bonds 16/26 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 106,080	185.958,45	0,17
XS1619155564	6,2500 % Republik Senegal Bonds 17/33 Reg.S ³⁾	USD		1.000.000	1.000.000	0	% 101,625	890.744,15	0,79
USY8137FAH11	6,2000 % Republik Sri Lanka Bonds 17/27 Reg.S	USD		700.000	700.000	0	% 99,875	612.783,77	0,55
USP68788AA97	9,2500 % Republik Suriname Notes 16/26 Reg.S	USD		300.000	300.000	0	% 102,250	268.866,68	0,24
XS1574068844	4,3750 % RZD Capital PLC LPN Rus.Railw. 17/24 ¹⁾	USD		250.000	250.000	0	% 100,500	220.220,88	0,20
USA8372TAC20	7,0000 % Suzano Austria GmbH Notes 17/47 Reg.S	USD		1.000.000	1.000.000	0	% 101,450	889.210,27	0,79
XS1617531063	6,1250 % Türkiye Garanti Bankasi A.S. FLR Notes 17/27 Reg.S	USD		500.000	750.000	250.000	% 99,282	435.103,87	0,39
US912828U246	2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26	USD		5.000.000	5.000.000	0	% 97,789	4.285.610,61	3,85
US912828V988	2,2500 % U.S. Treasury Notes 17/27	USD		1.500.000	1.500.000	0	% 99,828	1.312.491,79	1,17
XS0643183220	7,5043 % VimpelCom Holdings B.V. Notes 11/22 Reg.S	USD		200.000	200.000	0	% 114,233	200.250,68	0,18
Neuemissionen								1.245.639,40	1,13
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen								1.015.557,89	0,92
Verzinsliche Wertpapiere								1.015.557,89	0,92
USD								1.015.557,89	0,92
XS1622745203	3,9000 % CNRC Capitale Ltd. FLR Notes 17/Und.	USD		500.000	500.000	0	% 100,850	441.975,63	0,40
USY57657AA90	5,3000 % Marble II Pte. Ltd. Notes 17/22 Reg.S	USD		300.000	300.000	0	% 100,650	264.659,48	0,24
XS1615078141	5,6250 % The Bank of East Asia Ltd. FLR MTN 17/Und.	USD		350.000	350.000	0	% 100,700	308.922,78	0,28
Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen								230.081,51	0,21
Verzinsliche Wertpapiere								230.081,51	0,21
USD								230.081,51	0,21
XS1586367945	6,1250 % Danske Bank AS FLR MTN 17/Und.	USD		250.000	250.000	0	% 105,000	230.081,51	0,21
Nichtnotierte Wertpapiere								978.469,76	0,88
Verzinsliche Wertpapiere								978.469,76	0,88
DOP								469.250,07	0,42
XS1597325098	10,5000 % Dominikanische Republik Gbl. Dep. Nts 17/23 Reg.S	DOP		25.000.000	25.000.000	0	% 101,285	469.250,07	0,42
USD								509.219,69	0,46
USP5015VAG16	4,3750 % Republik Guatemala Notes 17/27 Reg.S	USD		325.000	325.000	0	% 99,625	283.794,59	0,26
USP75744AE59	4,7000 % Republik Paraguay Bonds 17/27 Reg.S	USD		250.000	250.000	0	% 102,875	225.425,10	0,20

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Wertpapier-Investmentanteile								6.209.399,42	5,56
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								6.209.399,42	5,56
EUR								2.694.335,00	2,41
IE00B02KXM00	iShs EURO STOXX Small U.ETF Reg.Shares (Dist)		ANT	80.500	96.000	15.500	EUR 33,470	2.694.335,00	2,41
USD								3.515.064,42	3,15
LU0048388663	Schroder ISF-Asian Opportun. Namensanteile A Dis		ANT	270.000	270.000	0	USD 14,853	3.515.064,42	3,15
Summe Wertpapiervermögen 4)								EUR 93.705.184,86	84,38
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere									
Wertpapier-Optionsrechte								-32.000,00	-0,03
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Optionsrechte auf Aktien								-32.000,00	-0,03
	Telecom Italia S.p.A. (TQI) Call Juli 17 0,90	XEUR	STK	1.000.000			EUR 0,002	1.500,00	0,00
	Telecom Italia S.p.A. (TQI) Call Juli 17 1,00	XEUR	STK	-1.000.000			EUR 0,001	-500,00	-0,00
	Telecom Italia S.p.A. (TQI) Put Aug. 17 0,80	XEUR	STK	-1.500.000			EUR 0,022	-33.000,00	-0,03
Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere								EUR -32.000,00	-0,03
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								-933,47	-0,01
	CAC 40-Index Future (FCE) Juli 17	XPAR	EUR	Anzahl 25				-21.875,00	-0,02
	DJ Stoxx 600 Future (FXXP) Sep. 17	XEUR	EUR	Anzahl -80				26.000,00	0,02
	E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 17	XCME	USD	Anzahl -57				44.839,60	0,04
	FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 17	IFEU	GBP	Anzahl 12				-19.087,69	-0,02
	FTSE 250 Index Future (FMCS) Sep. 17	IFEU	GBP	Anzahl -23				13.689,77	0,01
	IBEX 35 Future (MFXI) Juli 17	XMAD	EUR	Anzahl 10				-30.500,00	-0,03
	SGX Nikkei 225 Index Future (NK) Sep. 17	XSES	JPY	Anzahl 40				16.426,78	0,01
	STXE 600 Basic Res. Index Future (FSTS) Sep. 17	XEUR	EUR	Anzahl 20				9.450,00	0,01
	STXE 600 Constr.& Mat. Index Future (SXOP) Sep. 17	XEUR	EUR	Anzahl 22				-14.886,93	-0,01
	STXE 600 Pers. & H. G. Index Future (Q1L) Sep. 17	XEUR	EUR	Anzahl 11				-11.550,00	-0,01
	STXE 600 Technology Index Future (SX8P) Sep. 17	XEUR	EUR	Anzahl 24				-13.440,00	-0,01
Optionsrechte								42.474,96	0,04
Optionsrechte auf Aktienindices								42.474,96	0,04
	Nikkei 225 Index (N225) Call Aug. 17 20.000	XOSE		Anzahl 18			JPY 350,000	49.280,35	0,04
	Nikkei 225 Index (N225) Call Okt. 17 19.500	XOSE		Anzahl 6			JPY 860,000	40.362,95	0,04
	Nikkei 225 Index (N225) Call Okt. 17 20.500	XOSE		Anzahl -18			JPY 335,000	-47.168,34	-0,04
Summe Aktienindex-Derivate								EUR 41.541,49	0,03
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								15.065,40	0,01
	EURO Bund Future (FGBL) Sep. 17	XEUR	EUR	-3.600.000				11.580,00	0,01
	Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 17	XCBT	USD	-12.000.000				22.905,38	0,02
	Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) Sep. 17	XCBT	USD	5.000.000				-19.419,98	-0,02
Summe Zins-Derivate								EUR 15.065,40	0,01
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)								-31.309,06	-0,03
Offene Positionen									
	ARS/EUR 8.475.000,00	OTC						-18.179,93	-0,02
	AUD/EUR 1.600.000,00	OTC						12.434,37	0,01
	CAD/EUR 1.600.000,00	OTC						17.122,91	0,02
	CZK/EUR 39.811.300,00	OTC						-1.588,86	-0,00
	IDR/EUR 9.000.000.000,00	OTC						-15.137,70	-0,02
	NOK/EUR 2.100.000,00	OTC						1.316,40	0,00
	SEK/EUR 10.729.876,30	OTC						10.477,44	0,01
	USD/EUR 2.500.000,00	OTC						-37.753,69	-0,03
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								1.224.937,56	1,09
Offene Positionen									
	AUD/EUR 1.600.000,00	OTC						4.873,66	0,00
	BRL/USD 2.938.290,00	OTC						-4.644,83	-0,00
	CAD/EUR 1.600.000,00	OTC						-3.889,44	-0,00
	CHF/EUR 2.830.000,00	OTC						17.452,29	0,01
	CZK/EUR 25.400.000,00	OTC						-3.015,32	-0,00
	DKK/EUR 7.000.000,00	OTC						97,12	0,00
	GBP/EUR 5.850.000,00	OTC						20.384,99	0,02
	GBP/USD 942.278,31	OTC						-23.480,30	-0,02
	HKD/EUR 14.500.000,00	OTC						31.637,05	0,03
	HKD/USD 7.744.720,00	OTC						2.756,90	0,00
	IDR/EUR 9.000.000.000,00	OTC						11.962,57	0,01
	INR/USD 64.123.900,00	OTC						3.145,06	0,00
	JPY/EUR 520.000.000,00	OTC						110.859,32	0,10
	KRW/USD 1.813.790.000,00	OTC						14.002,68	0,01
	MXN/USD 3.025.000,00	OTC						1.070,56	0,00
	MYR/USD 2.819.000,00	OTC						-1.490,84	-0,00

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
NOK/EUR 9.500.000,00		OTC						9.715,92	0,01
RUB/USD 137.811.750,00		OTC						22.109,81	0,01
SEK/EUR 7.910.000,00		OTC						-9.706,22	-0,01
THB/USD 18.250.000,00		OTC						624,83	0,00
TWD/USD 35.500.000,00		OTC						3.681,66	0,00
USD/EUR 62.700.000,00		OTC						993.521,34	0,90
ZAR/USD 16.380.000,00		OTC						23.268,75	0,02
Summe Devisen-Derivate							EUR	1.193.628,50	1,06
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Credit Default Swaps (CDS)									
Protection Buyer									
CDS Deutsche Bank AG31 2H6677 / DGZ_FRA 20.03.2024		OTC	EUR	5.000.000				-24.559,15	-0,03
CDS ITRAXX EUROPE S27 V1 5Y / CSFBINT_LDN 20.06.2022		OTC	EUR	6.000.000				-3.769,46	-0,00
CDS Türkei, Republik 1174 9J0135 / BNP_LDN 20.06.2022		OTC	USD	1.000.000				-131.816,21	-0,12
CDS Türkei, Republik 1174 9J0135 / BNP_LDN 20.06.2022		OTC	USD	1.000.000				37.008,84	0,03
CDS Türkei, Republik 1174 9J0135 / JPM_LDN 20.06.2022		OTC	USD	1.000.000				37.008,84	0,03
CDS Türkei, Republik 1174 9J0135 / JPM_LDN 20.06.2022		OTC	USD	1.000.000				37.008,84	0,03
Protection Seller								487.284,40	0,45
CDS Assicurazioni Gener.SpA 0E996B / BNP_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	-1.000.000				8.386,20	0,01
CDS CDX.NA.IG. S28 V1 5Y / CSFBINT_LDN 20.06.2022		OTC	USD	-2.000.000				32.107,93	0,03
CDS Deutsche Bank AG31 2H6677 / JPM_LDN 20.03.2024		OTC	EUR	-5.000.000				3.769,46	0,00
CDS Deutsche Bank AG31 2H6677 / JPM_LDN 20.12.2017		OTC	EUR	-1.000.000				4.404,31	0,00
CDS ENI S.p.A.910 28EFBV / BNP_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	-1.000.000				18.026,24	0,02
CDS Intesa Sanpaolo SpA1023 TYA56D / JPM_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	-1.000.000				7.521,04	0,01
CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S27 V1 5Y / BNP_LDN 20.06.2022		OTC	EUR	-3.000.000				350.933,67	0,32
CDS UBS AG2161 HPHB2JAG6 / JPM_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	-1.000.000				34.359,77	0,03
CDS UniCredit S.p.A.815 T2F69Z / BNP_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	-1.000.000				6.946,76	0,01
CDS Vodafone Group PLC1000 9BADC3 / CSFBINT_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	-1.000.000				20.829,02	0,02
Equity Swaps								-188.387,88	-0,17
EQS ISTX EurMu-Fac. EUR / EURIBORM03 +0,15% EUR / MERRILL_LDN 21.12.2017		OTC	EUR	5.528.924,13				-188.387,88	-0,17
Summe Swaps							EUR	274.337,37	0,25
Sonstige Derivate									
Sonstige Terminkontrakte									
CBOE Volatility Index Future (VIX) Juli 17		XCBO	USD	Anzahl 45.000				16.227,06	0,02
VSTOXX MINI Index Future (V2TX) Juli 17		XEUR	EUR	Anzahl 22.500				-4.272,94	-0,00
Summe Sonstige Derivate							EUR	16.227,06	0,02
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	8.283.134,22			% 100,000	8.283.134,22	7,43
EUR-Guthaben bei									
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	4.001.040,42			% 100,000	4.001.040,42	3,59
Landesbank Berlin AG			EUR	713,62			% 100,000	713,62	0,00
Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-			EUR	561,65			% 100,000	561,65	0,00
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale			CZK	10.466,91			% 100,000	399,33	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	11.234,83			% 100,000	1.510,76	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	65.865,18			% 100,000	75.102,40	0,07
DekaBank Deutsche Girozentrale			HUF	39.976,16			% 100,000	129,19	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	77.476,62			% 100,000	8.100,69	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			PLN	11.179,41			% 100,000	2.641,58	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	35.204,71			% 100,000	3.643,08	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	8.394,31			% 100,000	5.646,97	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	8.813,74			% 100,000	5.946,61	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	106.730,67			% 100,000	97.620,71	0,09
DekaBank Deutsche Girozentrale			HKD	166.400,53			% 100,000	18.685,88	0,02
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	20.044.346,00			% 100,000	156.792,44	0,14
DekaBank Deutsche Girozentrale			MXN	4.834,57			% 100,000	233,98	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			NZD	7.842,93			% 100,000	5.034,78	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			SGD	13.106,32			% 100,000	8.340,80	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			THB	11.000,00			% 100,000	283,74	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			TRY	29.961,25			% 100,000	7.443,14	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	2.132.712,13			% 100,000	1.869.324,33	1,67
DekaBank Deutsche Girozentrale			ZAR	121.193,95			% 100,000	8.112,97	0,01
Summe Bankguthaben							EUR	14.560.443,29	13,07
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
							EUR	14.560.443,29	13,07

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	418.450,93				418.450,93	0,38
	Dividendenansprüche		EUR	95.310,68				95.310,68	0,09
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	1.237.928,91				1.237.928,91	1,12
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	870,64				870,64	0,00
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	23.426,43				23.426,43	0,02
	Forderungen aus Kapitalmaßnahmen		EUR	2.296,00				2.296,00	0,00
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	2.701.274,34				2.701.274,34	2,42
	Forderungen aus Fondsausschüttung		EUR	39.034,45				39.034,45	0,04
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	27.251,55				27.251,55	0,02
	Forderungen aus Ersatzleistung Zinsen/Dividenden		EUR	320,85				320,85	0,00
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	4.546.164,78	4,09
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-426,60				-426,60	-0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-23.105,52				-23.105,52	-0,02
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-1.200.941,82				-1.200.941,82	-1,08
	Verbindlichkeiten aus Derivategeschäften		EUR	-351.480,00				-351.480,00	-0,32
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-129.035,86				-129.035,86	-0,12
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-1.490.000,00				-1.490.000,00	-1,34
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-3.194.989,80	-2,88
Rückstellungen									
	Steuerrückstellungen		EUR	-5.272,43				-5.272,43	-0,00
	Summe Rückstellungen						EUR	-5.272,43	-0,00
Fondsvermögen									
	Umlaufende Anteile Klasse CF						EUR	111.120.330,52	100,00
	Anteilwert Klasse CF						STK	1.043.037	
							EUR	106,54	

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

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

²⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäftes in Wertpapieren.

³⁾ Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um Poolfaktoranleihen, deren Kurswert auch durch Teilrückzahlung oder Teilzinskaptalisierung beeinflusst wird.

⁴⁾ Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR		
		befristet	unbefristet	gesamt
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
Benesse Holdings Inc. Reg.Shares	STK	499	16.550,06	
Christian Dior SE Actions Port.	STK	725	183.657,00	
Christian Hansen Holding AS Navne-Aktier	STK	1.510	96.489,91	
Hakuhodo DY Holdings Inc. Reg.Shares	STK	1.623	18.929,08	
Hitachi High-Technologies Corp. Reg.Shares	STK	481	16.404,57	
Luxottica Group S.p.A. Azioni nom.	STK	1.960	100.352,00	
Mabuchi Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	342	14.954,47	
Mebuki Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	6.995	22.871,64	
Miraca Holdings Inc. Reg.Shares	STK	399	15.761,50	
Nippon Paint Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	1.137	37.799,20	
Obic Co. Ltd. Reg.Shares	STK	452	24.396,12	
Otsuka Corp. Reg.Shares	STK	368	20.063,83	
Seven Bank Ltd. Reg.Shares	STK	4.161	13.084,50	
Yamaguchi Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	1.385	14.701,54	
3,8750 % Africa Finance Corp. MTN 17/24 Reg.S	USD	375.000	326.064,95	
3,3750 % BANKIA S.A. FLR Obl. 17/27	EUR	200.000	204.423,00	
7,1250 % ESKOM Holdings SOC Limited MTN 15/25 Reg.S	USD	200.000	179.034,10	
5,7500 % JSC Natl Company KazMunayGas MTN 17/47 Reg.S	USD	325.000	270.619,69	
4,0000 % Oil India Intern. Pte. Ltd. Notes 17/27	USD	50.000	44.008,90	
4,3750 % RZD Capital PLC LPN Rus.Railw. 17/24	USD	200.000	176.176,70	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		1.796.342,76	1.796.342,76

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2017

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87701	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43655	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,56420	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	9,66345	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,09332	= 1 Euro (EUR)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	4,02535	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,23210	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	26,21100	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	309,44500	= 1 Euro (EUR)
Russische Föderation, Rubel	(RUB)	67,72640	= 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	14,93830	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,14090	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,48215	= 1 Euro (EUR)

Deka-BasisStrategie Flexibel

Mexiko, Peso	(MXN)	20,66255	= 1 Euro (EUR)
Dominikanische Republik, Peso	(DOP)	53,96110	= 1 Euro (EUR)
Brasilien, Real	(BRL)	3,76685	= 1 Euro (EUR)
Argentinien, Peso	(ARS)	18,82690	= 1 Euro (EUR)
Indien, Rupie	(INR)	73,93370	= 1 Euro (EUR)
Thailand, Baht	(THB)	38,76735	= 1 Euro (EUR)
Indonesien, Rupiah	(IDR)	15.241,28500	= 1 Euro (EUR)
Malaysia, Ringgit	(MYR)	4,89965	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,57135	= 1 Euro (EUR)
Südkorea, Won	(KRW)	1.305,38000	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	127,84000	= 1 Euro (EUR)
Taiwan, Neue Dollar	(TWD)	34,71130	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,90515	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,48652	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,55775	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XMAD	Madrid - Bolsa de Madrid
XPAR	Paris - Euronext Paris - Derivatives
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XSES	Singapur - Singapore Exchange (SGX)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

OTC

Over-the-Counter

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
CHF				
CH0010532478	Actelion Ltd. Namens-Aktien	STK	650	650
CH0043238366	Aryzta AG Namens-Aktien	STK	0	2.900
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien	STK	2.655	10.055
DKK				
DK0060696300	Scandinavian Tobacco Group A/S Navne-Aktier	STK	8.000	8.000
EUR				
NL0000303709	AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)	STK	28.500	28.500
NL0010672325	Ahold N.V., Kon. Aandelen aan toonder	STK	0	5.400
IE00BZ0YPPY56	Allied Irish Banks PLC Reg.Shares	STK	48.800	48.800
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port.	STK	870	870
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK	0	6.000
DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien	STK	1.700	3.250
DE000A1DAH00	Brenntag AG Namens-Aktien	STK	2.100	2.100
DE0007100000	Daimler AG Namens-Aktien	STK	610	1.910
DE000EVNK013	Evonik Industries AG Namens-Aktien	STK	1.430	4.430
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.V. Aandelen op naam	STK	17.500	17.500
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien	STK	1.400	1.400
ES0105223004	Gestamp Automoción S.A. Acciones Port.	STK	76.000	76.000
ES0171996087	Grifols S.A. Acciones Port. Cl. A	STK	5.150	5.150
DE000A13SX22	Hella KGaA Hueck & Co. Inhaber-Aktien	STK	0	2.700
DE0006070006	HOCHTIEF AG Inhaber-Aktien	STK	800	800
NL0000303600	ING Groep N.V. Cert.van Aandelen	STK	0	15.000
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK	28.665	60.165
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder	STK	455	4.750,331
FR0000130213	Lagardère S.C.A. Actions Nom.	STK	0	3.600
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder	STK	1.062,128	4.495,677
ES0105131009	Parques Reunidos Serv.Cent.SA Acciones Port.	STK	9.975	9.975
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien	STK	190	190
ES0173093115	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK	0	1.250
FR0000073272	Safran Actions Port.	STK	435	1.935
FR0000121220	Sodexo S.A. Actions Port.	STK	1.000	1.000
DE000TCAG172	Tele Columbus AG Namens-Aktien	STK	6.610	6.610
DE000XNG8888	XING AG Namens-Aktien	STK	270	270
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien	STK	1.610	1.610
FR0000125684	Zodiac Aerospace Actions au Porteur	STK	5.000	5.000
GBP				
GB00B1FP8915	BBA Aviation PLC Reg.Shares	STK	34.000	34.000
GB00B0744B38	Bunzl PLC Reg.Shares	STK	4.900	8.700
GB0031215220	Carnival PLC Reg.Shares	STK	0	1.900
GB00B07KD360	Cobham PLC Reg.Shares	STK	51.250	51.250
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC Reg.Shares	STK	0	6.500
GB0002418548	Elementis PLC Reg.Shares	STK	50.000	50.000

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC Reg.Shares	STK	4.100	4.100
GB00BYXJC278	Ibstock PLC Reg.Shares	STK	0	37.000
GB00BZ02MH16	Nex Group PLC Reg.Shares	STK	10.000	10.000
GB0006776081	Pearson PLC Reg.Shares	STK	11.200	11.200
GB00BDVZYZ77	Royal Mail PLC Reg.Shares	STK	22.000	22.000
GB0004835483	SABMiller PLC Reg.Shares	STK	0	2.050
JE00B2QKY057	Shire PLC Reg.Shares	STK	1.650	1.650
GB00BVFD7Q58	Standard Life PLC Reg.Shares	STK	17.220	33.720
GB0001367019	The British Land Co. PLC Reg.Shares	STK	0	12.000
GB00B1H0DZ51	TP ICAP PLC Reg.Shares	STK	8.171,855	8.171,855
JE00BD9WR069	UBM PLC Reg.Shares	STK	11.800	11.800
JE00BFNVW485	Wolseley PLC Reg.Shares	STK	1.960	1.960
SEK				
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B	STK	840	4.740
SE0007100359	Pandox AB Namn-Aktier B	STK	1.535	8.435
SE0007665823	Resurs Holding AB Namn-Aktier	STK	0	16.000
SE0000113250	Skanska AB Namn-Aktier B (fria)	STK	4.850	4.850
USD				
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A	STK	2.200	2.200
US00508Y1029	Acuity Brands Inc. Reg.Shares	STK	550	550
IE00BD845X29	Adient PLC Reg.Shares	STK	2.900	2.900
US00766T1007	AECOM Reg.Shares	STK	3.900	3.900
US02209S1033	Altria Group Inc. Reg.Shares	STK	3.750	3.750
US0255371017	American Electric Power Co.Inc. Reg.Shares	STK	3.800	3.800
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK	1.200	1.200
US04247X1028	Armstrong Wld Industries (NEW) Reg.Shares	STK	3.450	3.450
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares	STK	13.000	13.000
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares	STK	4.900	4.900
BMG0750C1082	Axalta Coating Systems Ltd. Reg.Shares	STK	5.300	5.300
US05508R1068	B & G Foods Inc.(New) Reg.Shares	STK	4.600	4.600
US0736851090	Beacon Roofing Supply Inc. Reg.Shares	STK	3.000	3.000
US09739D1000	Boise Cascade Co. Reg.Shares	STK	6.700	6.700
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares	STK	2.700	2.700
US12008R1077	Builders Firstsource Inc. Reg.Shares	STK	13.300	13.300
US1672501095	Chicago Bridge & Iron Co.N.V. Reg.Shs(N.Y.Regist.)	STK	4.400	4.400
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares	STK	10.000	10.000
US12572Q1058	CME Group Inc. Reg.Shares	STK	2.450	2.450
US25746U1097	Dominion Energy Inc. Reg.Shares	STK	6.150	6.150
US26138E1091	Dr. Pepper Snapple Group Inc. Reg.Shares	STK	2.150	2.150
US26441C2044	Duke Energy Corp. (New) Reg.Shares New	STK	5.650	5.650
US26969P1084	Eagle Materials Inc.Reg.Shares	STK	1.440	1.440
IE00B8KQN827	Eaton Corporation PLC Reg.Shares	STK	2.100	2.100
US29084Q1004	Emcor Group Inc. Reg.Shares	STK	2.000	2.000
US3434121022	Fluor Corp. (New) Reg.Shares	STK	2.800	2.800
US3873281071	Granite Construction Inc. Reg.Shares	STK	2.400	2.400
US3596941068	H.B. Fuller Co. Reg.Shares	STK	2.900	2.900
US42210P1021	Headwaters Inc. Reg.Shares	STK	6.900	6.900
US4435106079	Hubbell Inc. Reg.Shares	STK	1.200	1.200
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares	STK	3.800	3.800
US4698141078	Jacobs Engineering Group	STK	2.400	2.400
IE00BY7QL619	Johnson Controls Internat. PLC Reg.Shares	STK	3.100	3.100
US48242W1062	KBR Inc. Reg.Shares	STK	8.900	8.900
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares	STK	930	930
US5463471053	Louisiana Pacific Corp. Reg.Shares	STK	7.500	7.500
US5635711089	Manitowoc Co. Inc. Reg.Shares	STK	28.700	28.700
US5732841060	Martin Marietta Materials Inc. Reg.Shares	STK	610	610
US5763231090	MasTec Inc. Reg.Shares	STK	4.000	4.000
US5828391061	Mead Johnson Nutrition Co. Reg.Shares Cl.A	STK	1.260	1.260
US6200763075	Motorola Solutions Inc. Reg.Shares	STK	4.350	4.350
US65339F1012	Nextera Energy Inc. Reg.Shares	STK	2.050	2.050
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares	STK	2.750	2.750
US6951561090	Packaging Corp. of America Reg.Shares	STK	6.100	6.100
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares	STK	4.150	4.150
US6935061076	PPG Industries Inc. Reg.Shares	STK	1.440	1.440
US74340W1036	ProLogis Inc. Reg.Shares	STK	4.040	4.040
US7443201022	Prudential Financial Inc. Reg.Shares	STK	4.900	4.900
US7496851038	RPM International Inc. Reg.Shares	STK	2.650	2.650
US8318652091	Smith Corp., A.O. Reg.Shares	STK	2.900	2.900
US86614U1007	Summit Materials Inc. Reg.Shares Cl. A	STK	5.970,8	5.970,8
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK	3.800	3.800
US8101861065	The Scotts Miracle Gro Co. Reg.Shares Cl.A	STK	2.700	2.700
US8873173038	Time Warner Inc. Reg.Shares New	STK	3.150	3.150
US89531P1057	Trex Co. Inc. Reg.Shares	STK	2.150	2.150
US90333L2016	U.S. Concrete Inc. Reg.Shares New	STK	2.500	2.500
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	4.100	4.100
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares	STK	1.500	1.500
US9135431040	Universal Forest Products Inc. Reg.Shares	STK	1.460	1.460
US91529Y1064	UNUM Group Reg.Shares	STK	11.400	11.400
US9032934054	USG Corp. Reg.Shares	STK	5.200	5.200
US9203551042	Valspar Corp. Reg.Shares	STK	1.340	1.340

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares	STK	3.700	3.700
US9291601097	Vulcan Materials Co. Reg.Shares	STK	1.050	1.050
US9426222009	Watsco Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	2.850	2.850
US92939U1060	WEC Energy Group Inc. Reg.Shares	STK	3.200	3.200
US9841211033	Xerox Corp. Reg.Shares	STK	9.700	9.700
US98850P1093	Yum China Hldgs Inc. Reg.Shares	STK	2.200	2.200
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares	STK	2.950	2.950
Verzinsliche Wertpapiere				
AUD				
AU3CB0234987	2,8000 % European Investment Bank MTN 16/21	AUD	3.000.000	3.000.000
EUR				
XS1381690574	1,2710 % A.P.Møller-Mærsk A/S FLR MTN 16/19	EUR	0	100.000
XS1324446092	1,5000 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 15/22	EUR	0	625.000
XS1381693248	1,7500 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 16/21	EUR	0	100.000
DE000A1TNC78	1,6250 % Aareal Bank AG MTN IHS S.210 14/19	EUR	0	600.000
XS1346254573	2,8750 % ABN AMRO Bank N.V. FLR MTN 16/28	EUR	0	400.000
FR0013233384	1,2500 % ACCOR S.A. Bonds 17/24	EUR	600.000	600.000
XS1391625289	1,1250 % Akzo Nobel N.V. MTN 16/26	EUR	0	700.000
XS1400167133	0,8750 % Allander N.V. MTN 16/26	EUR	0	100.000
DE000A1YQC29	4,7500 % Allianz SE FLR MTN 13/Und.	EUR	0	400.000
XS1521058518	0,6250 % American Express Credit Corp. Notes 16/21	EUR	125.000	125.000
FR0013054020	0,3700 % APRR FLR MTN 15/20	EUR	0	500.000
FR0013252277	1,5000 % Arkema S.A. MTN 17/27	EUR	100.000	100.000
XS1014759648	2,8750 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 14/20	EUR	0	600.000
FR0013169885	1,0000 % Autoroutes du Sud de la France MTN 16/26	EUR	0	200.000
XS1134541306	3,9410 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und.	EUR	0	300.000
XS1203854960	0,8750 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 15/23	EUR	300.000	300.000
XS1458405898	0,7500 % Bank of America Corp. MTN 16/23	EUR	100.000	100.000
XS1319647068	2,6250 % Barclays PLC FLR MTN 15/25	EUR	500.000	500.000
DE000A14J611	2,3750 % Bayer AG FLR Sub. Anl. 15/75	EUR	200.000	400.000
XS1380333929	0,5000 % Berkshire Hathaway Inc. Notes 16/20	EUR	0	100.000
XS1396261338	0,7500 % BMW Finance N.V. MTN 16/24	EUR	0	250.000
XS1470601656	2,2500 % BNP Paribas S.A. MTN 16/27	EUR	200.000	200.000
XS1512677003	1,8750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 16/26	EUR	100.000	100.000
PTBSSL0M0002	2,3750 % BRISA-Concessao Rodoviaria, SA MTN 17/27	EUR	100.000	100.000
FR0013142536	2,3750 % Carmila S.A.S. Notes 16/24	EUR	0	200.000
FR0013155868	0,3490 % Carrefour Banque FLR MTN 16/21	EUR	0	1.000.000
XS1401331753	0,7500 % Carrefour S.A. MTN 16/24	EUR	0	150.000
XS1497312295	0,8750 % CK Hutchison Fin. (16) II Ltd. Notes 16/24	EUR	100.000	100.000
FR0013213832	1,8750 % CNP Assurances S.A. Obl. 16/22	EUR	100.000	100.000
FR0013264421	1,5000 % Coentr.d.Trans.d'Elec.SA (CTE) Obl. 17/28	EUR	600.000	600.000
FR0013264439	2,1250 % Coentr.d.Trans.d'Elec.SA (CTE) Obl. 17/32	EUR	300.000	300.000
DE000CZ40L63	1,1250 % Commerzbank AG MTN Anl. S.883 17/24	EUR	875.000	875.000
XS1239520494	0,0000 % Coöperatieve Rabobank U.A. FLR MTN 15/20	EUR	0	875.000
XS1382784509	1,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 16/26	EUR	0	600.000
XS1317969944	1,0000 % Corporación Andina de Fomento MTN 15/20	EUR	0	350.000
XS1377821464	0,2700 % Covestro AG FLR MTN 16/18	EUR	0	200.000
XS1377763161	1,0000 % Covestro AG MTN 16/21	EUR	0	100.000
XS1377745937	1,7500 % Covestro AG MTN 16/24	EUR	0	100.000
XS1169630602	0,8750 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) MTN 15/22	EUR	0	600.000
FR0013236544	3,5000 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 17/29	EUR	200.000	200.000
FR0013216900	0,4240 % Danone S.A. MTN 16/22	EUR	100.000	100.000
XS1441837546	0,8750 % Deutsche Bahn Finance B.V. MTN 16/31	EUR	100.000	100.000
DE000DL19TA6	1,5000 % Deutsche Bank AG MTN 17/22	EUR	800.000	800.000
DE000GRN0008	0,6250 % Deutsche Kreditbank AG IHS 16/21	EUR	0	100.000
DE000A13SWD8	1,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35252 16/19	EUR	0	350.000
DE000A13SWH9	1,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35254 16/20	EUR	0	500.000
XS1388661735	1,2500 % Deutsche Post AG MTN 16/26	EUR	0	100.000
XS1382791892	0,0200 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. FLR MTN 16/20	EUR	0	1.000.000
XS1382791975	1,5000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 16/28	EUR	0	200.000
XS1557096267	0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/24	EUR	300.000	300.000
XS1405783983	1,5000 % Eastman Chemical Co. Notes 16/23	EUR	100.000	100.000
XS1523250295	1,8750 % Eastman Chemical Co. Notes 16/26	EUR	100.000	100.000
FR0013247202	1,8750 % Edenred S.A. Notes 17/27	EUR	300.000	300.000
BE0002239086	1,3750 % Elia System Operator S.A./N.V. MTN 15/24	EUR	0	500.000
XS1403388694	1,3750 % Enagás Financiaciones S.A.U. MTN 16/28	EUR	0	100.000
XS1575640054	2,1250 % Energa Finance AB MTN 17/27	EUR	450.000	450.000
XS1307369717	1,5000 % Enexis Holding N.V. MTN 15/23	EUR	0	600.000
XS1396367911	0,8750 % Enexis Holding N.V. MTN 16/26	EUR	0	100.000
XS1412593185	0,7500 % ENI S.p.A. MTN 16/22	EUR	0	100.000
XS1412711217	1,6250 % ENI S.p.A. MTN 16/28	EUR	0	100.000
XS1571293171	0,8750 % Ericsson MTN 17/21	EUR	450.000	450.000
XS1571293684	1,8750 % Ericsson MTN 17/24	EUR	700.000	700.000
XS1396285279	1,5000 % Eurogrid GmbH MTN 16/28	EUR	0	100.000
DE000A185QB3	0,7500 % Evonik Finance B.V. MTN 16/28	EUR	100.000	100.000
XS1362349869	0,8510 % FCE Bank PLC FLR MTN 16/18	EUR	0	500.000
XS1319814817	0,2200 % Fedex Corp. FLR Notes 16/19	EUR	0	100.000
XS1319814064	0,5000 % Fedex Corp. Notes 16/20	EUR	0	100.000
XS1319814577	1,0000 % Fedex Corp. Notes 16/23	EUR	0	100.000
XS1319820541	1,6250 % Fedex Corp. Notes 16/27	EUR	0	100.000

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
ES0205032016	0,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 16/22	EUR	100.000	100.000
BE0002283522	0,3750 % Flämische Gemeinschaft MTN Tr.2 17/26	EUR	300.000	300.000
XS1554373164	0,8750 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/22 1	EUR	225.000	225.000
XS1554373248	1,5000 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/24 2	EUR	175.000	175.000
XS1554373677	2,1250 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/27 3	EUR	275.000	275.000
XS1554373834	3,0000 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/32 4	EUR	275.000	275.000
XS1515216650	1,5000 % G4S International Finance PLC MTN 16/23 4	EUR	100.000	100.000
PTGGDAOE0001	1,3750 % Galp Gás Natural Distrib. S.A. MTN 16/23	EUR	100.000	100.000
XS1590568132	1,1250 % Gas Natural CM S.A. MTN 17/24	EUR	400.000	400.000
FR0013205069	1,0000 % Gecina S.A. MTN 16/29	EUR	100.000	100.000
XS1506612693	0,8750 % GELF Bond Issuer I S.A. MTN 16/22	EUR	200.000	200.000
BE0002280494	1,3750 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Bonds 17/24	EUR	300.000	300.000
XS1589806907	1,6250 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 17/26	EUR	400.000	400.000
XS1629387462	1,5000 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 17/27	EUR	325.000	325.000
XS1401174633	1,0000 % Heineken N.V. MTN 16/26	EUR	0	1.000.000
XS1611167856	1,0000 % Hella Finance International BV Notes 17/24	EUR	150.000	150.000
XS1420337633	1,3750 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. MTN 16/23	EUR	0	100.000
XS1485597329	0,8750 % HSBC Holdings PLC MTN 16/24	EUR	100.000	100.000
XS1575444622	1,0000 % Iberdrola Finanzas S.A.U. MTN 17/25	EUR	800.000	800.000
XS1558013014	0,5000 % Imperial Brands Finance PLC MTN 17/21	EUR	100.000	100.000
XS1558013360	1,3750 % Imperial Brands Finance PLC MTN 17/25	EUR	100.000	100.000
XS1169586606	0,7000 % ING Bank N.V. MTN 15/20	EUR	0	600.000
XS1077772538	2,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 14/21	EUR	0	600.000
XS1168003900	1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 15/20	EUR	0	500.000
XS1551294256	1,5000 % Israel MTN 17/27	EUR	675.000	675.000
XS1330300341	1,1250 % ISS Global A/S MTN 15/21	EUR	0	750.000
XS1411535286	0,2500 % Johnson & Johnson Notes 16/22	EUR	0	100.000
XS1411535799	0,6500 % Johnson & Johnson Notes 16/24	EUR	0	100.000
XS1412266816	1,1500 % Johnson & Johnson Notes 16/28	EUR	0	100.000
XS1412266907	1,6500 % Johnson & Johnson Notes 16/35	EUR	0	100.000
XS1456422135	0,6250 % JPMorgan Chase & Co. MTN 16/24	EUR	100.000	100.000
XS1402921412	1,5000 % JPMorgan Chase & Co. MTN 16/26	EUR	0	100.000
XS1592283391	2,2500 % Jyske Bank A/S FLR MTN 17/29	EUR	250.000	250.000
BE0002266352	0,7500 % KBC Groep N.V. MTN 16/23	EUR	100.000	100.000
FR0013248721	1,5000 % Kering S.A. MTN 17/27	EUR	200.000	200.000
ES00000127A2	1,9500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/30	EUR	300.000	300.000
ES00000128Q6	2,3500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/33	EUR	800.000	800.000
FR0012758985	1,1250 % La Poste MTN 15/25	EUR	0	300.000
XS1501363425	0,2500 % LANXESS AG MTN 16/21	EUR	100.000	100.000
DE000LB182E5	2,8750 % Ldsbk Baden-Württemb. Nachr. MTN Schuldv. 16/26	EUR	100.000	100.000
XS1246732249	3,6250 % Ldsbk Baden-Württemb. SMT IHS 15/25	EUR	0	100.000
XS1554456613	1,2500 % LEG Immobilien AG Anl. 17/24	EUR	300.000	300.000
XS1627782771	1,5000 % Leonardo S.p.A. MTN 17/24	EUR	400.000	400.000
XS1139091372	1,0000 % Lloyds Bank PLC MTN 14/21	EUR	0	600.000
XS1219428957	0,6250 % Lloyds Bank PLC MTN 15/20	EUR	0	500.000
FR0012315133	0,0000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE FLR MTN 14/19	EUR	0	1.000.000
XS1237187718	0,0000 % McDonald's Corp. FLR MTN 15/19	EUR	0	1.000.000
XS1403263723	0,5000 % McDonald's Corp. MTN 16/21	EUR	0	100.000
XS1403264374	1,0000 % McDonald's Corp. MTN 16/23	EUR	0	100.000
XS1403264291	1,7500 % McDonald's Corp. MTN 16/28	EUR	0	100.000
XS1512827095	1,8750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. MTN 16/26	EUR	300.000	300.000
XS1496343986	1,3980 % mFinance France S.A. MTN 16/20	EUR	100.000	100.000
XS1233732194	1,1250 % Michelin Luxembourg SCS Notes 15/22	EUR	0	300.000
XS1233734562	1,7500 % Michelin Luxembourg SCS Notes 15/27	EUR	0	300.000
XS1346872580	1,6250 % Mondelez International Inc. Notes 16/23	EUR	0	500.000
XS1511787407	0,3710 % Morgan Stanley FLR MTN S.G 16/22	EUR	875.000	875.000
XS1050547857	2,3750 % Morgan Stanley MTN 14/21	EUR	0	600.000
XS1603892149	1,8750 % Morgan Stanley MTN 17/27	EUR	775.000	775.000
XS1511787589	1,3750 % Morgan Stanley MTN S.G 16/26	EUR	100.000	100.000
XS1409382030	1,0000 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 16/26	EUR	0	200.000
FR0013248713	2,7500 % Nexans S.A. Obl. 17/24	EUR	200.000	200.000
XS1408317433	1,0000 % Orange S.A. MTN 16/25	EUR	0	300.000
XS1574157357	0,2500 % Pfizer Inc. Notes 17/22	EUR	550.000	550.000
XS1574158082	1,0000 % Pfizer Inc. Notes 17/27	EUR	325.000	325.000
XS1362384262	1,2000 % Praxair Inc. Notes 16/24	EUR	0	650.000
FR0013053055	1,3750 % RCI Banque S.A. MTN 15/20	EUR	0	350.000
FR0013201597	0,5000 % RCI Banque S.A. MTN 16/23	EUR	450.000	450.000
FR0013264488	0,8750 % Régie Auton.Transp. Par.(RATP) MTN 17/27	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1576838376	1,0000 % RELX Finance B.V. Notes 17/24	EUR	400.000	400.000
FR0013240835	1,0000 % Renault S.A. MTN 17/23	EUR	400.000	400.000
XS1432493440	3,7500 % Republik Indonesien MTN 16/28 Reg.S	EUR	2.400.000	2.400.000
IT0004898034	4,5000 % Republik Italien B.T.P. 13/23	EUR	0	2.000.000
IT0005216491	0,3500 % Republik Italien B.T.P. 16/21	EUR	3.000.000	3.000.000
XS1428088626	3,0000 % Republik Kroatien Notes 17/27	EUR	550.000	550.000
XS1409726731	1,3750 % Republik Lettland MTN 16/36	EUR	0	100.000
PTOTEAOE0021	4,9500 % Republik Portugal Obr. 08/23	EUR	400.000	400.000
PTOTEEOE0029	4,8000 % Republik Portugal Obr. 10/20	EUR	1.700.000	1.700.000
PTOTEQOE0015	5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24	EUR	200.000	200.000
PTOTEUOE0019	4,1250 % Republik Portugal Obr. 17/27	EUR	200.000	200.000
XS1313004928	3,8750 % Republik Rumänien MTN 15/35 Reg.S	EUR	1.000.000	1.000.000

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1599193403	2,3750 % Republik Rumänien MTN 17/27 Reg.S	EUR	1.000.000	1.000.000
SI0002103545	2,1250 % Republik Slowenien Bonds 15/25	EUR	2.000.000	2.000.000
XS1637276848	2,7500 % Republik Zypern MTN 17/24	EUR	200.000	200.000
FR0013060209	1,6250 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. MTN 15/25	EUR	0	500.000
FR0013152899	1,0000 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. MTN 16/26	EUR	0	100.000
FR0013152907	2,0000 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. MTN 16/36	EUR	0	100.000
FR0013143997	0,6250 % Sanofi S.A. MTN 16/24	EUR	0	200.000
XS0877984459	4,0000 % Santander Intl Debt S.A.U. MTN 13/20	EUR	0	400.000
XS0953219416	2,6250 % Santander UK PLC MTN 13/20	EUR	0	600.000
XS1405777746	4,6250 % SES S.A. FLR Notes 16/Und.	EUR	0	100.000
DE000A2DADR6	1,1250 % Sixt Leasing SE Anl. 17/21	EUR	375.000	375.000
XS1327531486	1,6250 % SKF AB Notes 15/22	EUR	0	500.000
XS1570260460	2,0000 % Smiths Group PLC MTN 17/27	EUR	100.000	100.000
FR0013053329	1,8750 % Soc.Autorout.Nord-I'Est France Obl. 15/26	EUR	0	500.000
XS1324923520	0,7500 % Société Générale S.A. MTN 15/20	EUR	0	500.000
FR0013173432	1,2500 % Suez S.A. MTN 16/28	EUR	0	200.000
DE000TLX2102	2,5000 % Talanx AG Notes 14/26	EUR	0	500.000
XS1551678409	2,5000 % Telecom Italia S.p.A. MTN 17/23	EUR	200.000	200.000
XS1490960942	3,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 16/Und.	EUR	200.000	200.000
FR0013248465	1,5000 % Téléperformance SE Obl. 17/24	EUR	200.000	200.000
XS1241581179	0,8750 % TenneT Holding B.V. MTN 15/21	EUR	0	300.000
XS1240146891	0,3710 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN 15/20	EUR	0	975.000
XS1458408561	1,6250 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 16/26	EUR	100.000	100.000
XS0205935470	5,5000 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC Pre.Sec.S.1 04/Und.	EUR	150.000	150.000
DE000A0E6C37	5,2500 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC Pre.Sec.S.2 05/Und.	EUR	150.000	150.000
XS1405775708	0,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 16/24	EUR	100.000	100.000
DE000A2BPET2	1,3750 % thyssenkrupp AG MTN 17/22	EUR	875.000	875.000
XS1443997819	0,7500 % Total Capital Intl S.A. MTN 16/28	EUR	100.000	100.000
XS1239502328	2,0000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd MTN 15/25	EUR	0	300.000
CH0336602930	1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG MTN 16/26	EUR	200.000	200.000
CH0302790123	1,7500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG Notes 15/22	EUR	0	450.000
XS1401196958	1,1250 % Unibail-Rodamco SE MTN 16/27	EUR	0	220.000
XS1401197253	2,0000 % Unibail-Rodamco SE MTN 16/36	EUR	0	100.000
XS1619568303	1,5000 % Unibail-Rodamco SE MTN 17/29	EUR	500.000	500.000
XS1619568998	2,0000 % Unibail-Rodamco SE MTN 17/37	EUR	250.000	250.000
XS1078760813	1,5000 % UniCredit S.p.A. MTN 14/19	EUR	300.000	1.000.000
XS1508450688	2,1250 % UniCredit S.p.A. MTN 16/26	EUR	750.000	750.000
FR0013176302	0,7500 % Vivendi S.A. Bonds 16/21	EUR	0	100.000
XS1499604905	0,5000 % Vodafone Group PLC MTN 16/24	EUR	150.000	150.000
XS1463101680	1,6000 % Vodafone Group PLC MTN 16/31	EUR	100.000	100.000
XS1273542867	0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH FLR MTN 15/17	EUR	0	300.000
XS1273507100	0,7500 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 15/20	EUR	0	300.000
DE000A18V138	1,6250 % Vonovia Finance B.V. MTN 15/20	EUR	0	600.000
DE000A19B8D4	0,7500 % Vonovia Finance B.V. MTN 17/22	EUR	500.000	500.000
DE000A19B8E2	1,7500 % Vonovia Finance B.V. MTN 17/27	EUR	500.000	500.000
XS1240966348	0,0910 % Wells Fargo & Co. FLR MTN 15/20	EUR	0	375.000
XS1130067140	1,1250 % Wells Fargo & Co. MTN 14/21	EUR	0	600.000
XS1463043973	1,0000 % Wells Fargo & Co. MTN 16/27	EUR	100.000	100.000
XS1575992596	1,5000 % Wolters Kluwer N.V. Notes 17/27	EUR	250.000	250.000
XS1532765879	1,4140 % Zimmer Biomet Holdings Inc. Notes 16/22	EUR	100.000	100.000
GBP				
XS0104440986	5,7500 % 3i Group PLC MTN 99/32	GBP	100.000	100.000
XS1488409977	2,2500 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 16/52	GBP	400.000	400.000
XS1499603170	1,8750 % Babcock International Grp PLC MTN 16/26	GBP	100.000	100.000
XS1441773121	2,6000 % Brown-Forman Corp. Notes 16/28	GBP	300.000	300.000
XS1492680811	1,1250 % Cadent Finance PLC MTN 16/21 1	GBP	100.000	100.000
XS1492680902	2,1250 % Cadent Finance PLC MTN 16/28 2	GBP	100.000	100.000
XS1492681033	2,6250 % Cadent Finance PLC MTN 16/38 3	GBP	100.000	100.000
XS1501155748	1,2500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 16/23	GBP	200.000	200.000
XS1488419935	0,8750 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 16/22	GBP	100.000	100.000
XS0451790280	5,7500 % Kon. KPN N.V. MTN 09/29	GBP	200.000	200.000
USD				
USG0446NAL85	4,7500 % Anglo American Capital PLC Notes 17/27 Reg.S	USD	200.000	200.000
US03938LAX29	6,7500 % ArcelorMittal S.A. Notes 12/22	USD	250.000	250.000
US039483BL57	2,5000 % Archer Daniels Midland Co. Notes 16/26	USD	200.000	200.000
XS1488421592	1,6250 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 16/19	USD	400.000	400.000
US06738EAW57	4,8360 % Barclays PLC Notes 17/28	USD	750.000	750.000
XS1566179039	7,8750 % Bundesrepublik Nigeria Notes 17/32 Reg.S	USD	350.000	350.000
XS1551761999	3,8750 % Central Plaza Development Ltd. Notes 17/20	USD	200.000	200.000
US459284AB10	3,5000 % Coca-Cola European Partners US Notes 10/20	USD	125.000	275.000
USH3698DAQ72	3,5740 % Credit Suisse Group AG Notes 17/23 Reg.S	USD	400.000	400.000
US29082HAB87	5,4000 % Embraer Netherlands Fin. B.V. Notes 17/27	USD	500.000	500.000
XS1498442521	5,1250 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR Anl. 16/77	USD	300.000	300.000
US31572UAF30	5,5000 % Fibria Overseas Finance Ltd. Notes 17/27	USD	225.000	225.000
US345397VU41	5,8750 % Ford Motor Credit Co. LLC Notes 11/21	USD	0	600.000
XS1565437057	5,0000 % Future Land Development Hldgs Notes 17/20	USD	300.000	300.000
USY2749KAC46	6,8750 % Golden Legacy Pte Ltd. Notes 17/24 Reg.S	USD	200.000	200.000
US453140AB17	3,5000 % Imperial Brands Finance PLC Notes 13/23 144A	USD	0	200.000
US459200HE45	1,8750 % Intl Business Machines Corp. Notes 12/19	USD	0	600.000
US487836BD94	4,0000 % Kellogg Co. Notes 10/20	USD	0	400.000

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US58933YAF25	2,8000 % Merck & Co. Inc. Notes 13/23	USD	0	600.000
US91087BAC46	4,1500 % Mexiko Notes 17/27	USD	350.000	350.000
US68389XAP06	2,5000 % Oracle Corp. Notes 12/22	USD	0	500.000
US71647NAK54	7,2500 % Petrobras Global Finance B.V. Notes 14/44	USD	400.000	400.000
US71647NAR08	6,1250 % Petrobras Global Finance B.V. Notes 17/22	USD	175.000	175.000
US71647NAS80	7,3750 % Petrobras Global Finance B.V. Notes 17/27	USD	125.000	125.000
XS1567423766	4,0000 % Proven Glory Capital Ltd. MTN 17/27	USD	300.000	300.000
XS1401816761	4,1250 % Proven Honour Capital Ltd. Bonds 16/26	USD	300.000	300.000
USY20721BQ18	4,3500 % Republik Indonesien MTN 16/27 Reg.S	USD	1.500.000	1.500.000
XS0893103852	4,8750 % Republik Serbien Treasury Notes 13/20 Reg.S	USD	1.000.000	1.000.000
US900123CG37	6,6250 % Republik Türkei Notes 14/45	USD	500.000	500.000
US900123CL22	6,0000 % Republik Türkei Notes 17/27	USD	200.000	200.000
US900123CM05	5,7500 % Republik Türkei Notes 17/47	USD	1.000.000	1.000.000
XS1580443072	6,6250 % Rock Internat.Investment Inc. Notes 17/20	USD	200.000	200.000
XS1582346703	2,7500 % State of Kuwait Bonds 17/22 Reg.S	USD	550.000	550.000
XS1582346968	3,5000 % State of Kuwait Bonds 17/27 Reg.S	USD	600.000	600.000
US50076QAZ90	3,5000 % The Kraft Heinz Co. Notes 12/22	USD	0	250.000
US25468PCW41	2,3500 % The Walt Disney Co. MTN 12/22	USD	0	600.000
US89153VAB53	2,8750 % Total Capital Intl S.A. Notes 12/22	USD	0	300.000
XS1582433428	6,8750 % Trafigura Group Pte Ltd. FLR Notes 17/Und.	USD	375.000	375.000
US913017BV07	3,1000 % United Technologies Corp. Notes 12/22	USD	0	400.000
USG9328DAM23	6,3750 % Vedanta Resources PLC Notes 17/22 Reg.S	USD	250.000	250.000
US92857WBC38	2,9500 % Vodafone Group PLC Notes 13/23	USD	0	300.000
XS1599172746	2,8750 % Want Want China Finance Ltd. Notes 17/22	USD	500.000	500.000
US98310WVJ71	4,2500 % Wyndham Worldwide Corp. Notes 12/22	USD	165.000	300.000
Zertifikate				
EUR				
DE000A0KRKG7	ETFS Com.Sec. Ltd. RI-Disc.-Zert.Ind.Metals 06/Und	STK	375.000	375.000
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06132119D1	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Anrechte	STK	12.071	12.071
ES06132119E9	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Anrechte	STK	20.893	20.893
ES0618900981	Ferrovial S.A. Anrechte	STK	6.760	6.760
ES0618900999	Ferrovial S.A. Anrechte	STK	6.910	6.910
ES06445809C1	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	15.621	15.621
ES06445809D9	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	20.460	20.460
ES06784309B3	Telefónica S.A. Anrechte	STK	13.940	13.940
GBP				
IE00BYX2RZ48	Greencore Group PLC Anrechte (Nil-paid Shares)	STK	24.576	24.576
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
EUR				
DE000A2AA253	Deutsche Börse AG z.Umtausch eing.Namens-Aktien	STK	1.900	1.900
GBP				
GB00BLNN3L44	Compass Group PLC Reg.Shares	STK	6.380	13.380
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1402941790	0,6250 % ABB Finance B.V. MTN 16/23	EUR	0	100.000
ES0211845302	1,3750 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 16/26	EUR	0	100.000
XS1523975859	1,5000 % Akelius Residential Property Notes 16/22	EUR	100.000	100.000
XS1619312686	1,3750 % Apple Inc. Notes 17/29	EUR	700.000	700.000
XS1558491855	1,6250 % Atlantia S.p.A. MTN 17/25	EUR	325.000	325.000
XS1191877452	1,5000 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 15/27	EUR	0	500.000
XS1533922263	1,2500 % Avery Dennison Corp. Notes 17/25	EUR	250.000	250.000
XS1602466424	6,7500 % Banco Santander S.A. FLR Nts 17/Und.	EUR	600.000	600.000
XS1380334141	1,3000 % Berkshire Hathaway Inc. Notes 16/24	EUR	0	100.000
XS1380334224	2,1500 % Berkshire Hathaway Inc. Notes 16/28	EUR	0	100.000
XS1499602289	1,0000 % Blackstone Holdings Fin.Co.LLC Notes 16/26 Reg.S	EUR	100.000	100.000
XS1405777316	1,8500 % Bunge Finance Europe B.V. Notes 16/23	EUR	100.000	100.000
XS1614722806	1,1250 % CaixaBank S.A. MTN 17/24	EUR	400.000	400.000
XS1492691008	1,1250 % Celanese US Holdings LLC Notes 16/23	EUR	100.000	100.000
XS1468525057	2,3750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 16/24	EUR	100.000	100.000
XS1551726810	2,8750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 17/25	EUR	100.000	100.000
XS1529934801	1,4230 % CETIN Finance B.V. MTN 16/21	EUR	100.000	100.000
XS1616917800	1,3750 % CNH Industrial Finance Euro.SA MTN 17/22	EUR	300.000	300.000
XS1525358054	1,8710 % CNRC Capital Ltd. Notes 16/21	EUR	100.000	100.000
XS1505896735	1,3750 % CRH Finance DAC MTN 16/28	EUR	100.000	100.000
XS1328173080	1,8750 % CRH Funding B.V. MTN 15/24	EUR	0	300.000
DE000A2GSCX1	2,1250 % Daimler AG MTN 17/37	EUR	375.000	375.000
XS1492685885	0,7500 % Eaton Capital Unlimited Co. Notes 16/24 Reg.S	EUR	100.000	100.000
XS1111324700	2,6250 % EDP Finance B.V. MTN 14/22	EUR	0	600.000
XS1471646965	1,1250 % EDP Finance B.V. MTN 16/24	EUR	100.000	100.000
XS1558083652	1,8750 % EDP Finance B.V. MTN 17/23	EUR	150.000	150.000
XS1240750767	1,0000 % Eli Lilly and Company Notes 15/22	EUR	0	200.000
XS1240751062	1,6250 % Eli Lilly and Company Notes 15/26	EUR	0	200.000
XS1492580516	4,5000 % ELM B.V. FLR MTN 16/Und.	EUR	100.000	100.000
XS1573192058	1,1250 % Fastighets AB Balder Notes 17/22	EUR	600.000	600.000
XS1576819079	1,8750 % Fastighets AB Balder Notes 17/25	EUR	600.000	600.000
XS1640492648	0,4000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 17/21	EUR	300.000	300.000

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1640492994	1,1000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 17/24	EUR	350.000	350.000
XS1529684695	1,3750 % Gas Networks Ireland MTN 16/26	EUR	100.000	100.000
XS1238900515	0,0000 % General Electric Co. FLR Notes 15/20	EUR	0	425.000
XS1238901166	1,2500 % General Electric Co. Notes 15/23	EUR	0	300.000
XS1577957837	2,8750 % Glo.Wr.Real Estate Invest.Ltd. Bonds 17/22	EUR	225.000	225.000
XS1488494987	1,0000 % Hemsö Fastighets AB MTN 16/26	EUR	100.000	100.000
XS1419664997	2,8750 % IE2 Holdco S.A. MTN 16/26	EUR	100.000	200.000
XS1234953575	1,2500 % Illinois Tool Works Inc. Notes 15/23	EUR	0	300.000
XS1234953906	2,1250 % Illinois Tool Works Inc. Notes 15/30	EUR	0	300.000
XS1617845679	1,5000 % Intl Business Machines Corp. Notes 17/29	EUR	500.000	500.000
XS1511781467	0,8750 % Iren S.p.A. MTN 16/24	EUR	100.000	100.000
DE000A19HCW0	1,2500 % JAB Holdings B.V. Notes 17/24	EUR	300.000	300.000
DE000A19HCX8	2,0000 % JAB Holdings B.V. Notes 17/28	EUR	300.000	300.000
XS1611042646	0,8000 % Kellogg Co. Notes 17/22	EUR	500.000	500.000
XS1323910684	1,9000 % Magna International Inc. Notes 15/23	EUR	0	500.000
ES0224244071	1,6250 % Mapfre S.A. Obl. 16/26	EUR	0	100.000
XS1511779305	1,3750 % Mexiko MTN 16/25	EUR	100.000	100.000
XS1369323149	3,3750 % Mexiko MTN 16/31	EUR	300.000	300.000
XS1564337993	1,8750 % Mölnlycke Holding AB Notes 17/25	EUR	300.000	300.000
XS1523028436	3,3250 % MPT Oper.Partn. L.P./Fin.Corp. Notes 17/25	EUR	525.000	525.000
XS1603948032	3,6250 % Netflix Inc. Notes 17/27 Reg.S	EUR	125.000	125.000
XS1577727164	1,0000 % Nokia Oyj MTN 17/21	EUR	150.000	150.000
XS1577731604	2,0000 % Nokia Oyj MTN 17/24	EUR	300.000	300.000
XS1600824962	3,2500 % Nomad Foods BondCo PLC Notes 17/24 Reg.S	EUR	325.000	325.000
XS1486520403	1,0000 % Nordea Bank AB FLR MTN 16/26	EUR	200.000	200.000
XS1571341830	1,1250 % Parker-Hannifin Corp. Notes 17/25 Reg.S	EUR	550.000	550.000
XS1568875444	2,5000 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/21	EUR	500.000	500.000
XS1568874983	3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/24	EUR	400.000	400.000
XS1568888777	4,8750 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/28	EUR	175.000	175.000
XS1408421763	2,0000 % Philip Morris Internat. Inc. Notes 16/36	EUR	0	300.000
XS1533922776	3,2500 % Quintiles IMS Inc. Notes 17/25 Reg.S	EUR	500.000	500.000
XS1423826798	1,7500 % REN Finance B.V. MTN S.3 16/23	EUR	0	100.000
XS1236685613	1,8750 % Republik Chile Bonds 15/30	EUR	0	300.000
XS1629918415	3,2500 % Republik Türkei Notes S.INTL 17/25	EUR	675.000	675.000
XS1565699763	1,1250 % Ryanair DAC MTN 17/23	EUR	275.000	275.000
XS1316037545	1,5000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20	EUR	0	200.000
XS1511589605	1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken FLR MTN 16/28	EUR	100.000	100.000
XS1321424670	2,2500 % Sky PLC MTN 15/25	EUR	0	600.000
XS1571298139	0,2500 % Svenska Handelsbanken AB MTN 17/22	EUR	1.525.000	1.525.000
XS1617859464	1,0000 % Swedbank AB FLR MTN 17/27	EUR	475.000	475.000
XS1600410481	1,3000 % Talent Yield (Euro) Ltd. Notes 17/22 Reg.S	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1395057430	1,1250 % Telstra Corp. Ltd. MTN 16/26	EUR	0	500.000
XS1439749109	0,3750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 16/20	EUR	350.000	350.000
XS1439749281	1,1250 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 16/24	EUR	350.000	350.000
XS1325825211	2,1500 % The Priceline Group Inc. Notes 15/22	EUR	0	500.000
XS1577956789	1,3000 % Three Gorges Fin. II (KY) Ltd. Notes 17/24	EUR	200.000	200.000
XS1237246316	1,2500 % United Technologies Corp. Notes 15/23	EUR	0	300.000
XS1514149159	1,2500 % Whirlpool Fin. Luxembourg Sarl Notes 16/26	EUR	100.000	100.000
GBP				
XS1328187627	4,1250 % CRH Finance (U.K.) PLC MTN 15/29	GBP	0	300.000
PLN				
PL0000107264	4,0000 % Republik Polen Bonds S.1023 12/23	PLN	4.000.000	4.000.000
USD				
US023135AN60	3,8000 % Amazon.com Inc. Notes 14/24	USD	0	400.000
US035242AL09	3,3000 % Anheuser-Busch InBev Fin. Inc. Notes 16/23	USD	0	200.000
USG05891AA76	6,5000 % Aston Martin Capital Ltd. Notes 17/22 Reg.S	USD	200.000	200.000
USP13296AM37	4,3750 % Banco Inbursa S.A. Notes 17/27 Reg.S	USD	500.000	500.000
US105756BX78	6,0000 % Brasilien Bonds 16/26	USD	1.000.000	1.000.000
US17275RAH57	4,4500 % Cisco Systems Inc. Notes 09/20	USD	0	450.000
USG2176GAA97	4,0000 % CK Hutchison Cap.Sec.(17) Ltd FLR Secs 17/Und. R.S	USD	300.000	300.000
USU1302DAA91	3,8750 % CRH America Inc. Notes 15/25 Reg.S	USD	0	250.000
XS1600667171	5,3750 % East.& South.Afr.Trd.& Dev. BK MTN Tr.2 17/22	USD	900.000	900.000
USP37466AP78	5,0000 % Empr.Transp.DepasajeMetro SA Notes 17/47 Reg.S	USD	200.000	200.000
XS1590806508	4,8750 % Ezdan Sukuk Co. Ltd. MTN 17/22	USD	1.000.000	1.000.000
US31428XAY22	4,0000 % Fedex Corp. Notes 14/24	USD	0	600.000
US375558AY93	2,3500 % Gilead Sciences Inc. Notes 14/20	USD	0	450.000
USU37818AR97	4,0000 % Glencore Funding LLC Notes 17/27 Reg.S	USD	750.000	750.000
US46625HQJ22	2,5500 % JPMorgan Chase & Co. Notes 16/21	USD	0	200.000
XS1405766541	7,0000 % Königreich Bahrain Bonds 16/28 Reg.S	USD	550.000	550.000
XS1567903627	5,5000 % MAF Global Securities Ltd. FLR Notes 17/Und.	USD	525.000	525.000
XS1603335610	4,8500 % Metalloinvest Finance DAC Notes 17/24 Reg.S	USD	850.000	850.000
US91086QBG29	4,1250 % Mexiko MTN 16/26	USD	200.000	200.000
US594918BB90	2,7000 % Microsoft Corp. Notes 15/25	USD	0	500.000
XS1589324075	4,1000 % MMC Finance DAC LPN MMC Norilsk 17/23 Reg.S	USD	800.000	800.000
US61746BD267	3,8750 % Morgan Stanley MTN 16/26	USD	0	200.000
US61746BDJ26	3,7500 % Morgan Stanley Notes 13/23	USD	0	300.000
XS1577964536	5,1960 % OmGrid Funding Ltd. Notes 17/27 Reg.S	USD	300.000	300.000
XS1567423501	3,2500 % Proven Glory Capital Ltd. MTN 17/22	USD	375.000	375.000
XS1566193295	6,5000 % Province of Buenos Aires Bonds 17/23 Reg.S	USD	350.000	350.000
US749343AD11	3,5000 % RCI Banque S.A. Notes 13/18 144A	USD	0	600.000

Deka-BasisStrategie Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
USP04808AM60	6,8750 % Rep. Argentinien Bonds 17/27 Reg.S	USD	475.000	475.000
XS1044540547	4,7500 % Republik Aserbaidschan Notes 14/24 Reg.S	USD	250.000	250.000
XS1626530320	9,6250 % Republik Ecuador Notes 17/27 Reg.S	USD	500.000	500.000
US806854AB12	3,3000 % Schlumberger Investment S.A. Notes 11/21 144A	USD	0	300.000
XS1567051443	3,8500 % Steel Capital S.A. LP MTN Severstal 17/21 Reg.S	USD	600.000	600.000
XS1575874471	3,8750 % Sultanat Oman Notes 17/22 Reg.S	USD	500.000	500.000
XS1575967218	5,3750 % Sultanat Oman Notes 17/27 Reg.S	USD	550.000	550.000
XS1575968026	6,5000 % Sultanat Oman Notes 17/47 Reg.S	USD	425.000	425.000
US38143U8H71	3,7500 % The Goldman Sachs Group Inc. Notes 16/26	USD	0	200.000
US742718EB11	3,1000 % The Procter & Gamble Co. Notes 13/23	USD	400.000	800.000
XS1576037284	5,8750 % Türkiye Garanti Bankasi A.S. MTN 17/23 Reg.S	USD	1.000.000	1.000.000
XS1578203462	6,1250 % Türkiye Is Bankasi A.S. MTN 17/24 Reg.S	USD	500.000	500.000
XS1584113184	7,6250 % Türkiye Sinai Kalkinma Bank.AS FLR Notes 17/27	USD	250.000	250.000
US912828M987	1,6250 % U.S. Treasury Notes 15/20	USD	5.000.000	5.000.000
XS1596778263	3,7500 % UniCredit S.p.A. MTN 17/22 Reg.S	USD	250.000	250.000
US931427AH10	3,8000 % Walgreens Boots Alliance Inc. Notes 14/24	USD	0	400.000
XS1571399754	5,7500 % Yapı Ve Kredi Bankasi A.S. Notes 17/22 Reg.S	USD	650.000	650.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
EUR				
BE0003793107	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port.	STK	870	1.800
ES0118900077	Ferrovial S.A. Acciones Port. Em.05/17	STK	113,278	113,278
ES0178430056	Telefónica S.A. Acciones Port. Em.11/16	STK	557,6	557,6
GBP				
GB0033872168	Icap PLC Reg.Shares	STK	17.500	17.500
GB00BYXK6398	InterContinental Hotels Group Reg.Shares	STK	3.812	6.145
JE00B3CM9527	Janus Henderson Group PLC Reg.Shares	STK	19.100	44.800
GB00B085NH34	National Grid PLC Reg.Shares New	STK	2.265	10.465
GB00BDBBJQ12	Nex Group PLC Reg.Shares	STK	17.500	17.500
GB00BMHTPY25	Rexam PLC Reg.Shares	STK	0	12.800
JPY				
JP3394200004	The Joyo Bank Ltd. Reg.Shares	STK	50.000	50.000
Verzinsliche Wertpapiere				
GBP				
XS1533915564	5,7500 % Aston Martin Capital Ltd. Notes 17/22 Reg.S	GBP	250.000	250.000
XS1640493299	1,7000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 17/22	GBP	100.000	100.000
USD				
XS1596778008	4,6250 % UniCredit S.p.A. MTN 17/27 Reg.S	USD	500.000	500.000
Andere Wertpapiere				
CHF				
CH0366349311	Credit Suisse Group AG Anrechte	STK	12.111	12.111
EUR				
NL0012009641	Eurocommercial Properties N.V. Anrechte (Wahldiv.)	STK	3.200	3.200
NL0011984513	Koninklijke DSM N.V. Anrechte (Wahldividende)	STK	2.040	2.040
NL0012191696	Koninklijke DSM N.V. Anrechte (Wahldividende)	STK	1.991	1.991
NL0011988589	NN Group N.V. Anrechte (Wahldividende)	STK	3.433	3.433
NL0011983432	Royal Dutch Shell PLC Anrechte A (Wahldiv.)	STK	5.800	5.800
NL0012061378	Royal Dutch Shell PLC Anrechte A (Wahldiv.)	STK	6.445	6.445
NL0012181473	Royal Dutch Shell PLC Anrechte A (Wahldividende)	STK	9.622	9.622
NL0012325773	Royal Dutch Shell PLC Anrechte A (Wahldividende)	STK	9.000	9.000
GBP				
GB00BD2MGK60	Informa PLC Anrechte (nil-paid)	STK	3.000	3.000
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
IE00BD4DX952	db x-tr.iBoxx Em.Sov.Q.Wg.(DR) Reg.Shares 1D	ANT	145.000	145.000
IE00B66F4759	iShs EO H.Yield Corp Bd U.ETF Reg.Shares	ANT	46.500	78.500
IE00B6R52036	iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Reg.Shares (Acc)	ANT	190.000	190.000
IE00B9M6RS56	iShsVI-JPM DL EM Bd EOH U.ETFD Reg.Shares	ANT	9.860	9.860
USD				
IE00B4PY7Y77	iShsI-\$Hgh Yld Corp Bd U.ETF Reg.Shares	ANT	18.550	18.550
IE00B7N3YW49	PFIS ETFs-S.-T.HY C.B.IS U.ETF Reg.Inc.Shares	ANT	45.000	86.000
Geldmarktpapiere				
EUR				
XS1323463056	0,0980 % United Parcel Service Inc. FLR Notes 15/20	EUR	0	650.000

Deka-BasisStrategie Flexibel

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CAC 40 INDEX, DAX (PERFORMANCE-INDEX), EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 INDEX, FTSE MIB INDEX, HANG SENG INDEX, IBEX 35 Index, Nikkei 225 Stock Average Index (JPY), STXE 600 AUTOMOBILES & PARTS INDEX (PRICE) (EUR), STXE 600 BANKS INDEX (PRICE) (EUR), STXE 600 Basic Resources Index (Price) (EUR), STXE 600 Constr. & Materials Index (Price) (EUR), STXE 600 Pers. & Househ. Goods Index (Price) (EUR), STXE 600 TECHNOLOGY INDEX (PRICE) (EUR))	EUR	48.383
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 250 Index, MSCI Emerging Markets Index, S&P 500 INDEX, STXE 600 INDEX (PRICE) (EUR))	EUR	32.511
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 10 Year US Treasury Notes (10,0), 30 Year US Treasury Bonds (30,0), Euro Bund (10,0), Euro Buxl Futures (30,0), EuroBTP Italian Gov. (10,0), EuroBTP Italian Gov. (3,0), EuroOAT French Gov. Bond (10,0))	EUR	91.263
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 10 Year US Treasury Notes (10,0), 30 Year US Treasury Bonds (30,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Euro Buxl Futures (30,0), Euro Schatz (2,0), EuroBTP Italian Gov. (10,0), EuroOAT French Gov. Bond (10,0), Long Gilt (10,0))	EUR	230.717
Sonstige Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CBOE Volatility Index, VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	11.263
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CBOE Volatility Index, VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	3.499
Optionsrechte		
Wertpapier-Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktien		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): Deutsche Börse AG Namens-Aktien, Linde AG Inhaber-Aktien, Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B)	EUR	4.218
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): Deutsche Bank AG Namens-Aktien, Deutsche Börse AG Namens-Aktien, Linde AG Inhaber-Aktien, Volkswagen AG Vorzugsaktien)	EUR	7.127
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): Deutsche Bank AG Namens-Aktien, Deutsche Börse AG Namens-Aktien, Linde AG Inhaber-Aktien, Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B, Volkswagen AG Vorzugsaktien)	EUR	6.614
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): ESTX Bank Index (Price) (EUR), EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nikkei 225 Stock Average Index (JPY), STXE 600 OIL & GAS INDEX (PRICE) (EUR))	EUR	15.225
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): CAC 40 INDEX, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 INDEX, S&P 500 INDEX)	EUR	93.538
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): ESTX Bank Index (Price) (EUR), EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 INDEX, FTSE MIB INDEX, STXE 600 Basic Resources Index (Price) (EUR))	EUR	41.954
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): ESTX Bank Index (Price) (EUR), EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 INDEX, FTSE MIB INDEX, S&P 500 INDEX)	EUR	48.227
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	8.993
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	15.755
Sonstige Optionsrechte		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	1.875
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	380
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	2.100
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): CBOE Volatility Index, VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	1.853
Währungsderivate		
Optionsrechte auf Devisen-Derivate		
Optionsrechte auf Devisen		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): EUR/PLN	EUR	11

Deka-BasisStrategie Flexibel

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
ARS/EUR	EUR	994
AUD/EUR	EUR	2.111
AUD/USD	EUR	840
BRL/EUR	EUR	2.994
BRL/USD	EUR	5.364
CHF/EUR	EUR	12.525
CHF/USD	EUR	2.500
CLP/USD	EUR	756
CNY/USD	EUR	4.065
COP/USD	EUR	753
CZK/EUR	EUR	5.003
DKK/EUR	EUR	1.802
GBP/EUR	EUR	23.080
GBP/USD	EUR	14.195
HKD/EUR	EUR	9.808
HUF/USD	EUR	1.163
IDR/EUR	EUR	1.677
IDR/USD	EUR	1.603
INR/USD	EUR	4.800
JPY/EUR	EUR	22.496
JPY/USD	EUR	10.848
KRW/USD	EUR	7.242
MXN/USD	EUR	4.669
MYR/USD	EUR	2.956
NOK/EUR	EUR	5.041
NZD/USD	EUR	2.800
PLN/EUR	EUR	5.576
PLN/USD	EUR	570
RUB/USD	EUR	16.866
SEK/EUR	EUR	2.422
SEK/USD	EUR	891
THB/USD	EUR	2.889
TRY/USD	EUR	2.837
TWD/EUR	EUR	3.540
TWD/USD	EUR	8.096
USD/EUR	EUR	188.616
ZAR/EUR	EUR	2.811
ZAR/USD	EUR	7.619
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
ARS/EUR	EUR	994
AUD/EUR	EUR	2.110
AUD/USD	EUR	827
BRL/EUR	EUR	2.994
BRL/USD	EUR	5.364
CHF/EUR	EUR	10.614
CHF/USD	EUR	2.502
CLP/USD	EUR	756
CNY/USD	EUR	4.065
COP/USD	EUR	753
CZK/EUR	EUR	6.996
DKK/EUR	EUR	1.809
GBP/EUR	EUR	19.207
GBP/USD	EUR	13.989
HKD/EUR	EUR	4.870
HUF/USD	EUR	1.135
IDR/EUR	EUR	1.677
IDR/USD	EUR	1.605
INR/USD	EUR	4.801
JPY/EUR	EUR	13.371
JPY/USD	EUR	8.542
KRW/USD	EUR	7.240
MXN/USD	EUR	4.145
MYR/USD	EUR	2.959
NOK/EUR	EUR	4.232
NZD/USD	EUR	2.788
PLN/EUR	EUR	5.718
PLN/USD	EUR	1.318
RUB/USD	EUR	16.867
SEK/EUR	EUR	1.794
SEK/USD	EUR	891
THB/USD	EUR	1.440
TRY/USD	EUR	2.582
TWD/EUR	EUR	3.536
TWD/USD	EUR	8.100
USD/EUR	EUR	124.957
ZAR/EUR	EUR	1.026
ZAR/USD	EUR	6.744

Deka-BasisStrategie Flexibel

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)		
Credit Default Swaps (CDS)		
Protection Buyer: (Basiswert(e): CDS CDX.EM. S26 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S27 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE S26 V1 5Y)	EUR	9.869
Protection Seller: (Basiswert(e): CDS CDX.NA.HY. S27 V2 5Y, CDS CDX.NA.IG. S27 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S26 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S27 V1 5Y)	EUR	21.012
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes): unbefristet		
(Basiswert(e): 0,0000 % General Electric Co. FLR Notes 15/20, 0,0000 % McDonald's Corp. FLR MTN 15/19, 0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH FLR MTN 15/17, 0,2200 % Fedex Corp. FLR Notes 16/19, 0,2500 % LANXESS AG MTN 16/21, 0,2700 % Covestro AG FLR MTN 16/18, 0,3700 % APRR FLR MTN 15/20, 0,3710 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN 15/20, 0,3750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 16/20, 0,4240 % Danone S.A. MTN 16/22, 0,5000 % Fedex Corp. Notes 16/20, 0,5000 % Vodafone Group PLC MTN 16/24, 0,6250 % ABB Finance B.V. MTN 16/23, 0,6250 % Deutsche Kreditbank AG IHS 16/21, 0,6250 % Lloyds Bank PLC MTN 15/20, 0,7500 % Bank of America Corp. MTN 16/23, 0,7500 % BMW Finance N.V. MTN 16/24, 0,7500 % Carrefour S.A. MTN 16/24, 0,7500 % KBC Groep N.V. MTN 16/23, 0,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 16/24, 0,8510 % FCE Bank PLC FLR MTN 16/18, 0,8750 % CK Hutchison Fin. (16) II Ltd. Notes 16/24, 0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/24, 0,8750 % Ericsson MTN 17/21, 0,8750 % HSBC Holdings PLC MTN 16/24, 1,0000 % Autoroutes du Sud de la France MTN 16/26, 1,0000 % Corporación Andina de Fomento MTN 15/20, 1,0000 % Hemsö Fastighets AB MTN 16/26, 1,0000 % Lloyds Bank PLC MTN 14/21, 1,0000 % McDonald's Corp. MTN 16/23, 1,0000 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 16/26, 1,0000 % Nordea Bank AB FLR MTN 16/26, 1,0000 % Orange S.A. MTN 16/25, 1,0000 % Wells Fargo & Co. MTN 16/27, 1,1250 % Akzo Nobel N.V. MTN 16/26, 1,1250 % Cadent Finance PLC MTN 16/21 1, 1,1250 % Celanese US Holdings LLC Notes 16/23, 1,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35254 16/20, 1,1250 % EDP Finance B.V. MTN 16/24, 1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 15/20, 1,1250 % Telstra Corp. Ltd. MTN 16/26, 1,1250 % Wells Fargo & Co. MTN 14/21, 1,2000 % Praxair Inc. Notes 16/24, 1,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 16/26, 1,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35252 16/19, 1,2500 % General Electric Co. Notes 15/23, 1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG MTN 16/26, 1,2500 % United Technologies Corp. Notes 15/23, 1,2500 % Whirlpool Fin. Luxembourg Sarl Notes 16/26, 1,2710 % A.P.Møller-Mærsk A/S FLR MTN 16/19, 1,3000 % Berkshire Hathaway Inc. Notes 16/24, 1,3750 % CRH Finance DAC MTN 16/28, 1,3750 % Elia System Operator S.A./N.V. MTN 15/24, 1,3750 % Galp Gás Natural Distrib. S.A. MTN 16/23, 1,3750 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. MTN 16/23, 1,3750 % Mexiko MTN 16/25, 1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken FLR MTN 16/28, 1,5000 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 15/22, 1,5000 % Aelius Residential Property Notes 16/22, 1,5000 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 15/27, 1,5000 % Deutsche Bank AG MTN 17/22, 1,5000 % Eastman Chemical Co. Notes 16/23, 1,5000 % G4S International Finance PLC MTN 16/23 4, 1,5000 % Israel MTN 17/27, 1,5000 % JPMorgan Chase & Co. MTN 16/26, 1,5000 % Republik Slowenien Bonds 15/35, 1,5000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20, 1,5000 % UniCredit S.p.A. MTN 14/19, 1,6000 % Vodafone Group PLC MTN 16/31, 1,6250 % Aareal Bank AG MTN IHS S.210 14/19, 1,6250 % Atlantia S.p.A. MTN 17/25, 1,6250 % ENI S.p.A. MTN 16/28, 1,6250 % Mapfre S.A. Obl. 16/26, 1,6250 % Mondelez International Inc. Notes 16/23, 1,6250 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. MTN 15/25, 1,6250 % SKF AB Notes 15/22, 1,6250 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 16/26, 1,6250 % U.S. Treasury Notes 15/20, 1,6250 % Vonovia Finance B.V. MTN 15/20, 1,7500 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 16/21, 1,7500 % Covestro AG MTN 16/24, 1,7500 % REN Finance B.V. MTN S.3 16/23, 1,7500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG Notes 15/22, 1,8750 % CNP Assurances S.A. Obl. 16/22, 1,8750 % CRH Funding B.V. MTN 15/24, 1,8750 % Edenred S.A. Notes 17/27, 1,9000 % Magna International Inc. Notes 15/23, 10,8750 % Province of Buenos Aires Bonds 11/21 Reg.S, 2,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 14/21, 2,0000 % Philip Morris Internat. Inc. Notes 16/36, 2,0000 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. MTN 16/36, 2,0000 % Smiths Group PLC MTN 17/27, 2,0000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd MTN 15/25, 2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26, 2,1250 % UniCredit S.p.A. MTN 16/26, 2,1500 % The Priceline Group Inc. Notes 15/22, 2,2500 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 16/52, 2,2500 % BNP Paribas S.A. MTN 16/27, 2,3750 % Bayer AG FLR Sub. Anl. 15/75, 2,3750 % Carmila S.A.S. Notes 16/24, 2,3750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 16/24, 2,3750 % Morgan Stanley MTN 14/21, 2,5000 % Talanx AG Notes 14/26, 2,6250 % EDP Finance B.V. MTN 14/22, 2,7000 % Microsoft Corp. Notes 15/25, 2,8000 % Merck & Co. Inc. Notes 13/23, 2,8750 % ABN AMRO Bank N.V. FLR MTN 16/28, 2,8750 % Ldsbk Baden-Württemb. Nachr. MTN Schuldv. 16/26, 3,0000 % Republik Kroatien Notes 17/27, 3,1000 % United Technologies Corp. Notes 12/22, 3,2500 % Proven Glory Capital Ltd. MTN 17/22, 3,2500 % Quintiles IMS Inc. Notes 17/25 Reg.S, 3,3750 % BANKIA S.A. FLR Obl. 17/27, 3,3750 % Mexiko MTN 16/31, 3,5000 % ABQ Finance Ltd. MTN 17/22, 3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/24, 3,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 16/Und., 3,8750 % Africa Finance Corp. MTN 17/24 Reg.S, 3,8750 % Indonesia Eximbank MTN 17/24, 3,8750 % Republik Rumänien MTN 15/35 Reg.S, 3,8750 % Sultanat Oman Notes 17/22 Reg.S, 3,9410 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und., 4,0000 % CK Hutchison Cap.Sec.(17) Ltd FLR Secs 17/Und. R.S, 4,0000 % Oil India Intern. Pte. Ltd. Notes 17/27, 4,1250 % Mexiko MTN 16/26, 4,3750 % RZD Capital PLC LPN Rus.Railw. 17/24, 4,6250 % SES S.A. FLR Notes 16/Und., 4,7500 % Allianz SE FLR MTN 13/Und., 4,7500 % Anglo American Capital PLC Notes 17/27 Reg.S, 4,7500 % Republik Aserbaidzhan Notes 14/24 Reg.S, 4,8000 % Republik Portugal Obr. 10/20, 4,8000 % Republik Vietnam Notes 14/24 Reg.S, 4,8360 % Barclays PLC Notes 17/28, 4,8750 % Republik Serbien Treasury Notes 13/20 Reg.S, 4,9500 % Republik Portugal Obr. 08/23, 5,0000 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 16/48, 5,1250 % Bharti Airtel Intl (NL) B.V. Notes 13/23 Reg.S, 5,2500 % Republic of Namibia Notes 15/25 Reg.S, 5,3750 % East. & South.Afr.Trd.& Dev. BK MTN 17/22, 5,3750 % Sultanat Oman Notes 17/27 Reg.S, 5,4000 % Embraer Netherlands Fin. B.V. Notes 17/27, 5,5000 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 15/47, 5,5000 % Fibria Overseas Finance Ltd. Notes 17/27, 5,5000 % MAF Global Securities Ltd. FLR Notes 17/Und., 5,5000 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC Pre.Sec.S.1 04/Und., 5,5000 % Verizon Communications Inc. Notes 17/47, 5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24, 5,7500 % Yapi Ve Kredi Bankasi A.S. Notes 17/22 Reg.S, 6,2500 % Republik Sri Lanka Bonds 11/21 Reg.S, 6,3750 % Vedanta Resources PLC Notes 17/22 Reg.S, 6,5000 % Province of Buenos Aires Bonds 17/23 Reg.S, 6,7500 % Banco Santander S.A. FLR Nts 17/Und., 6,8750 % Latam Finance Ltd. Notes 17/24 Reg.S, 6,8750 % Nyxstar Netherlands (Hlds)B.V. Notes 17/24 Reg.S, 6,8750 % Trafigura Group Pte Ltd. FLR Notes 17/Und., 7,1250 % ESKOM Holdings SOC Limited MTN 15/25 Reg.S, 7,2500 % Petrobras Global Finance B.V. Notes 14/44, 7,5043 % VimpelCom Holdings B.V. Notes 11/22 Reg.S, 7,7500 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 12/42, 7,8200 % Rep. Argentinien Bonds 05/33, 7,8750 % Bundesrepublik Nigeria Notes 17/32 Reg.S, ACCOR S.A. Actions Port., AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.), Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs), Aryzta AG Namens-Aktien, Associated British Foods PLC Reg.Shares, Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom., Benesse Holdings Inc. Reg.Shares, Centrica PLC Reg.Shares, Christian Hansen Holding AS Navne-Aktier, Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien, Coloplast AS Navne-Aktier B, Credit Suisse Group AG Namens-Aktien, DnB ASA Navne-Aksjer A, Engie S.A. Actions Port., Ferrovia S.A. Acciones Port., Fiat Chrysler Automobiles N.V. Aandelen op naam, Givaudan SA Namens-Aktien, H & M Hennes & Mauritz AB Namm-Aktier B, Hakuhodo DY Holdings Inc. Reg.Shares, Harley-Davidson Inc. Reg.Shares, Hikma Pharmaceuticals PLC Reg.Shares, Hitachi High-Technologies Corp. Reg.Shares, Iberdrola S.A. Acciones Port., Icap PLC Reg.Shares, KONE Corp. (New) Reg.Shares Cl.B, Koninklijke DSM N.V. Aandelen aan toonder, L'Oréal S.A. Actions Port., Luxottica Group S.p.A. Azioni nom., LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Action	EUR	121.867

Deka-BasisStrategie Flexibel

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Port.(C.R.), Mabuchi Motor Co. Ltd. Reg.Shares, Mapfre S.A. Acciones Nom., Mebuki Financial Group Inc. Reg.Shares, Mediaset España Comunicacion Acciones Nom., Meggitt PLC Reg.Shares, Miraca Holdings Inc. Reg.Shares, Nestlé S.A. Namens-Aktien, Nippon Paint Holdings Co. Ltd. Reg.Shares, Novartis AG Namens-Aktien, Obic Co. Ltd. Reg.Shares, Orange S.A. Actions Port., Otsuka Corp. Reg.Shares, Publicis Groupe S.A. Actions Port., Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine, Sanofi S.A. Actions Port., SES S.A. Bearer FDRs (rep.Shs A), Seven Bank Ltd. Reg.Shares, SGS S.A. Namens-Aktien, Statoil ASA Navne-Aksjer, Suez S.A. Actions Port., Swisscom AG Namens-Aktien, Telefónica S.A. Acciones Port., Total S.A. Actions au Porteur, Whitbread PLC Reg. Shares, Yamaguchi Financial Group Inc. Reg.Shares, Yara International ASA Navne-Aksjer)		

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 14,23 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 65.586.682 Euro.

Deka-BasisStrategie Flexibel CF

Entwicklung des Sondervermögens

		EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		85.440.249,32
1. Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.684.755,84
2. Zwischenausschüttung(en)		-,-
3. Mittelzufluss (netto)		20.193.980,96
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen ¹⁾	EUR	+53.700.576,14
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-33.506.595,18
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-1.946,99
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		+7.172.803,07
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		+4.032.347,66
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		+83.412,42
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		111.120.330,52

¹⁾ Zum 12.11.2016 wurden der Deka-Wertkonzept offensiv CF (T) und der Deka-Wertkonzept offensiv TF (T) auf den Deka-BasisStrategie Flexibel CF verschmolzen. Nettoinventarwert der Anteilscheine, die im Rahmen der Verschmelzung ausgegeben wurden: EUR 6.455.532,45 und EUR 13.234.067,94

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
30.06.2014	-,-	-,-
30.06.2015	59.106.089,97	106,10
30.06.2016	85.440.249,32	100,92
30.06.2017	111.120.330,52	106,54

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.07.2016 - 30.06.2017 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller	87.340,92	0,08
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	1.521.470,94	1,46
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	42.873,36	0,04
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	1.275.091,73	1,22
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-10.182,60	-0,01
davon Negative Einlagezinsen	-18.314,30	-0,02
davon Positive Einlagezinsen	8.131,70	0,01
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	193.573,09	0,19
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	12.005,98	0,01
9. Abzug ausländischer Quellensteuer	-151.902,54	-0,15
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-151.902,54	-0,15
10. Sonstige Erträge	56.246,57	0,05
davon Kompensationszahlungen	51.896,49	0,05
davon Quellensteuerrückvergütung	4.350,08	0,00
Summe der Erträge	3.026.517,45	2,90
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-4.026,36	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-1.344.738,77	-1,29
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-201.966,36	-0,19
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-5.882,22	-0,01
davon EMIR-Kosten	-8.786,57	-0,01
davon Kostenpauschale	-172.126,56	-0,17
davon Ratinggebühren	-15.171,01	-0,01
Summe der Aufwendungen	-1.550.731,49	-1,49
III. Ordentlicher Nettoertrag	1.475.785,96	1,41
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	19.878.365,06	19,06
2. Realisierte Verluste	-18.297.108,03	-17,54
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	1.581.257,03	1,52
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	3.057.042,99	2,93
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	4.032.347,66	3,87
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	83.412,42	0,08
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	4.115.760,08	3,95
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	7.172.803,07	6,88

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

Deka-BasisStrategie Flexibel CF

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung

	EUR	EUR
	insgesamt	je Anteil *)
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	3.057.042,99	2,93
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,00
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt ¹⁾	-106.950,63	-0,10
2. Vortrag auf neue Rechnung	-1.594.144,26	-1,53
III. Gesamtausschüttung ²⁾	1.355.948,10	1,30
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung ³⁾	1.355.948,10	1,30

Umlaufende Anteile: Stück 1.043.037

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

¹⁾ Realisierte Gewinne aus Devisenkassageschäften.

²⁾ Der Abzug von Kapitalertragsteuer und Solidaritätszuschlag erfolgt gemäß § 7 Abs. 3, 3a und 3c InvStG über die depotführende Stelle bzw. über die letzte inländische auszahlende Stelle als Entrichtungsverpflichtete.

³⁾ Ausschüttung am 18. August 2017.

Deka-BasisStrategie Flexibel

Anhang.

Zusätzliche Angaben zu den Derivaten

Instrumentenart	Kontrahent	Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)
Aktienindex-Terminkontrakte	Bolsa de Madrid (BME), Madrid	-30.500,00
Aktienindex-Terminkontrakte	CME Globex	44.839,60
Aktienindex-Terminkontrakte	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)	-4.426,93
Aktienindex-Terminkontrakte	Euronext Paris	-21.875,00
Aktienindex-Terminkontrakte	ICE Futures Europe	-5.397,92
Aktienindex-Terminkontrakte	Singapore Exchange Derivatives Trading (SGX-DT)	16.426,78
Credit Default Swaps	BNP Paribas S.A. [London Branch]	458.310,55
Credit Default Swaps	Credit Suisse International	-78.879,26
Credit Default Swaps	DekaBank Deutsche Girozentrale	-3.769,46
Credit Default Swaps	J.P. Morgan Securities PLC	87.063,42
Devisenterminkontrakte	Barclays Bank PLC	467.294,27
Devisenterminkontrakte	BNP Paribas S.A.	90.302,04
Devisenterminkontrakte	Citigroup Global Markets Ltd.	52.216,43
Devisenterminkontrakte	Credit Suisse AG [London Branch]	25.529,45
Devisenterminkontrakte	Goldman Sachs International	1.164,78
Devisenterminkontrakte	HSBC Bank PLC	34.424,14
Devisenterminkontrakte	J.P. Morgan Securities PLC	3.145,06
Devisenterminkontrakte	Merrill Lynch International	539.681,44
Devisenterminkontrakte	Morgan Stanley & Co. International PLC	-3.114,42
Devisenterminkontrakte	Nomura International PLC	-17.421,13
Devisenterminkontrakte	Société Générale S.A.	-2.350,46
Devisenterminkontrakte	The Royal Bank of Scotland PLC	2.756,90
Equity Swaps	Merrill Lynch International	-188.387,88
Optionsrechte auf Aktien	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)	-32.000,00
Optionsrechte auf Aktienindices	Osaka Exchange - Futures and Options	42.474,96
Sonstige Terminkontrakte	Chicago Board Options Exchange (CBOE)	-4.272,94
Sonstige Terminkontrakte	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)	20.500,00
Zinsterminkontrakte	Chicago Board of Trade (CBOT)	3.485,40
Zinsterminkontrakte	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)	11.580,00
Gesamtbetrag der bei Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten:		EUR 1.490.000,00
davon:		
Bankguthaben		EUR 1.490.000,00

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial wurde für dieses Sondervermögen gemäß der DerivateV nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt (relativer Value-at-Risk gem. § 8 DerivateV).

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§ 37 Abs. 5 DerivateV i. V. m. § 9 DerivateV)

125% EURO STOXX® NR in EUR, -25% S&P 500 VIX Short-Term Futures Index TR in EUR

Dem Sondervermögen wird ein derivatereies Vergleichsvermögen gegenübergestellt. Es handelt sich dabei um eine Art virtuelles Sondervermögen, dem keine realen Positionen oder Geschäfte zugrunde liegen. Die Grundidee besteht darin, eine plausible Vorstellung zu entwickeln, wie das Sondervermögen ohne Derivate oder derivative Komponenten zusammengesetzt wäre. Das Vergleichsvermögen muss den Anlagebedingungen, den Angaben im Verkaufsprospekt und den wesentlichen Anlegerinformationen des Sondervermögens im Wesentlichen entsprechen, ein derivatereies Vergleichsmaßstab wird möglichst genau nachgebildet. In Ausnahmefällen kann von der Forderung des derivatereies Vergleichsvermögens abgewichen werden, sofern das Sondervermögen Long/Short-Strategien nutzt oder zur Abbildung von z.B. Rohstoffexposure oder Währungsabsicherungen.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (§ 37 Abs. 4 Satz 1 und 2 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

kleinster potenzieller Risikobetrag 1,75%
 größter potenzieller Risikobetrag 4,78%
 durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 3,17%

Der potenzielle Risikobetrag für das Marktrisiko des Sondervermögens wird über die Risikokennzahl Value-at-Risk (VaR) dargestellt. Zum Ausdruck gebracht wird durch diese Kennzahl der potenzielle Verlust des Sondervermögens, der unter normalen Marktbedingungen mit einem Wahrscheinlichkeitsniveau von 99% (Konfidenzniveau) bei einer angenommenen Haltedauer von 10 Arbeitstagen auf Basis eines effektiven historischen Betrachtungszeitraumes von einem Jahr nicht überschritten wird. Wenn zum Beispiel ein Sondervermögen einen VaR-Wert von 2,5% aufwiese, dann würde unter normalen Marktbedingungen der potenzielle Verlust des Sondervermögens mit einer Wahrscheinlichkeit von 99% nicht mehr als 2,5% des Wertes des Sondervermögens innerhalb von 10 Arbeitstagen betragen. Im Bericht wird die maximale, minimale und durchschnittliche Ausprägung dieser Kennzahl auf Basis einer Beobachtungszeitreihe von maximal einem Jahr oder ab Umstellungsdatum veröffentlicht. Der VaR-Wert des Sondervermögens darf das Zweifache des VaR-Wertes des derivatereies Vergleichsvermögens nicht übersteigen. Hierdurch wird das Marktrisiko des Sondervermögens klar limitiert.

Risikomodelle (§ 37 Abs. 4 Satz 3 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

Varianz-Kovarianz Ansatz

Im Berichtszeitraum genutzter Umfang des Leverage gemäß der Brutto-Methode (§ 37 Abs. 4 Satz 4 DerivateV i. V. m. § 5 Abs. 2 DerivateV)

2,4

Emittenten oder Garanten, deren Sicherheiten mehr als 20% des Wertes des Fonds ausgemacht haben (§ 37 Abs. 6 DerivateV):

Im Berichtszeitraum wiesen keine Sicherheiten eine erhöhte Emittentenkonzentration nach § 27 Abs. 7 Satz 4 DerivateV auf.

Deka-BasisStrategie Flexibel

Zusätzliche Angaben zu den Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäften (besichert)

Instrumentenart	Kontrahent	Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)	
Wertpapier-Darlehen	DekaBank Deutsche Girozentrale	EUR	1.752.333,86
Wertpapier-Darlehen	Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme	EUR	44.008,90
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:		EUR	6.793.375,70
davon:			
Schuldverschreibungen		EUR	6.793.375,70
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten:		EUR	46.650,12
Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse CF		EUR	12.005,98
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse CF		EUR	5.882,22
Umlaufende Anteile Klasse CF		STK	1.043.037
Anteilwert Klasse CF		EUR	106,54

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen / Investmentanteile

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzolumina 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, z.B. Broker-Quotes, zugrunde gelegt, welche sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Investmentanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs bewertet.

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate

Verzinsliche Wertpapiere, 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 mittels externer Modellkurse, z.B. Broker-Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.

Bankguthaben

Der Wert von Bankguthaben, Einlagenzertifikaten und ausstehenden Forderungen, Bardividenden und Zinsansprüchen entspricht grundsätzlich dem jeweiligen nominalen Betrag.

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. Die Bewertung von 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, erfolgt anhand von Fair Values, 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.

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.

Gesamtkostenquote (laufende Kosten) Anteilklasse CF 1,44%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Für das Sondervermögen ist gemäß den Anlagebedingungen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Kostenpauschale von 0,16% p.a. vereinbart. Davon entfallen bis zu 0,08% p.a. auf die Verwahrstelle und bis zu 0,10% p.a. auf Dritte (Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten sowie Sonstige).

Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen der aus dem Fonds an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen zu.

Die Gesellschaft gewährt an Vermittler, z.B. Kreditinstitute, wiederkehrend - meist jährlich - Vermittlungsentgelte als so genannte "Vermittlungsprovisionen" bzw. "Vermittlungsfolgeprovisionen".

Deka-BasisStrategie Flexibel

Für den Erwerb und die Veräußerung der Investmentanteile sind keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge berechnet worden. Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:

db x-tr.iBoxx Em.Sov.Q.Wg.(DR) Reg.Shares 1D		n.v.
iShs EO H.Yield Corp Bd U.ETF Reg.Shares		0,50
iShs EURO STOXX Small U.ETF Reg.Shares (Dist)		0,38
iShsII-\$Hgh Yld Corp Bd U.ETF Reg.Shares		0,48
iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Reg.Shares (Acc)		0,53
iShsVI-JPM DL EM Bd EOH U.ETFD Reg.Shares		0,48
PFIS ETFs-S.-T.HY C.B.IS U.ETF Reg.Inc.Shares		0,55
Schroder ISF-Asian Opportun. Namensanteile A Dis		1,50
Wesentliche sonstige Erträge		
Anteilklasse CF		
Kompensationszahlungen	EUR	51.896,49
Quellensteuerrückvergütung	EUR	4.350,08
Wesentliche sonstige Aufwendungen		
Anteilklasse CF		
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	5.882,22
EMIR-Kosten	EUR	8.786,57
Kostenpauschale	EUR	172.126,56
Ratinggebühren	EUR	15.171,01
Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt	EUR	427.371,86

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka Investment GmbH 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 Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH 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 Investment GmbH nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - 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 Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Deka Investment GmbH bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeiters 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.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeiter erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

Die variable Vergütung der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaften und von Mitarbeitern, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitern (zusammen als "risikorelevante Mitarbeiter") unterliegt folgenden Regelungen:

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaften wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitern unterhalb der Geschäftsführungsebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung.
- 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 Mitarbeiters, 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 Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 75 TEUR (in Luxemburg: 100 TEUR) nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß der geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2016 fand im 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 Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2016 angemessen ausgestaltet.

Wesentliche Änderungen an dem Vergütungssystem oder der Vergütungspolitik der Deka Investment GmbH wurden im Geschäftsjahr 2016 nicht vorgenommen. Zudem konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Deka-BasisStrategie Flexibel

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	45.990.665,82
davon feste Vergütung	EUR	34.883.192,83
davon variable Vergütung	EUR	11.107.472,99
Zahl der Mitarbeiter der KVG		426

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**	EUR	11.093.657,83
Geschäftsführer	EUR	2.182.355,46
weitere Risktaker	EUR	2.147.470,94
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR	320.480,00
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risktaker	EUR	6.443.351,43

* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt.

** Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risktaker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risktaker oder Geschäftsführer befinden. Weitere Risktaker: alle sonstigen Risktaker, die nicht Geschäftsführer oder Risktaker mit Kontrollfunktionen sind.

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
Wertpapier-Darlehen (besichert)		
Aktien	596.015,42	0,54
Verzinsliche Wertpapiere	1.200.327,34	1,08
Total Return Swaps	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Equity Swaps	-188.387,88	-0,17

10 größte Gegenparteien	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
Wertpapier-Darlehen (besichert)		
DekaBank Deutsche Girozentrale	1.752.333,86	Deutschland
Organisierte Wertpapier-Darlehensysteme	44.008,90	Deutschland
Total Return Swaps	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
Merrill Lynch International	-188.387,88	Großbritannien

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	1.796.342,76
Total Return Swaps	absolute Beträge in EUR
Restlaufzeit 91-365 Tage	-188.387,88

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. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen an einem geregelten Markt in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder an einer Börse in einem Mitgliedstaat der OECD notiert sein oder gehandelt werden und 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. Markturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehensysteme 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-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 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>.

Deka-BasisStrategie Flexibel

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen
EUR

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)

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
Restlaufzeit 1-7 Tage	46.650,12
unbefristet	6.793.375,70

Die über organisierte Wertpapier-Darlehensysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

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 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.

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	10.833,83	100,00
Kostenanteil des Fonds	5.308,52	49,00
Ertragsanteil der KVG	5.308,52	49,00

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.

Total Return Swaps

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	533.755,48	100,00
Kostenanteil des Fonds	0,00	0,00
Ertragsanteil der KVG	0,00	0,00

Ausweis realisierter Total Return Swaps exklusive offene Geschäfte

Beim Handel von Total Return Swap 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.

Für Total Return Swaps werden unter „absolute Beträge in EUR“ realisierte Gewinne und Verluste aus Einzelgeschäften saldiert ausgewiesen. Somit bezieht sich der Ausweis "in % der Bruttoerträge des Fonds" ebenfalls auf das saldierte realisierte Ergebnis der Total Return Swaps.

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

1,92% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
3M Co.	3.006.500,96
SpareBank 1 Boligkreditt AS	1.320.591,09
Philip Morris International Inc.	1.017.900,25
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	1.001.682,57
National Australia Bank Ltd.	227.302,33
Nordrhein-Westfalen, Land	223.166,20
FMS Wertmanagement	6.803,91
Rheinland-Pfalz, Land	2.688,10
Berlin, Land	2.612,51
NRW.BANK	1.759,77

Total Return Swaps

Eine Zuordnung von erhaltenen Sicherheiten zu Einzelgeschäften innerhalb eines Sondervermögens ist aufgrund der Globalbesicherung nicht möglich. Daher kann keine Angabe zu den Emittenten der gestellten Wertpapiersicherheiten in Bezug auf Total Return Swaps getätigt werden.

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

Deka-BasisStrategie Flexibel

Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer	3
Clearstream Banking Frankfurt	1.222.252,65 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus	46.650,12 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
J.P.Morgan AG Frankfurt	5.571.123,05 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

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

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Ermittlung Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste:

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Berichtszeitraum die in den Anteilpreis einfließenden Wertansätze der im Bestand befindlichen Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Berichtszeitraumes mit den Summenpositionen zum Anfang des Berichtszeitraumes die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Als Steuerrückstellung werden ungewisse Verbindlichkeiten ausgewiesen, für welche die Voraussetzungen gemäß § 36a Absatz 1 bis 3 EStG in Zusammenhang mit der Kapitalertragsteuer auf ausgezahlte inländische Dividendeneinnahmen nicht vorlagen.

Erläuterung zur Abgrenzung von Devisentermin- und Devisenkassageschäften:

Im Berichtszeitraum wurde die Definition von Devisenkassageschäften hinsichtlich der Abwicklungsdauer von 3 Handelstagen auf 2 Handelstage angepasst. Devisentransaktionen, die ab dem 02.01.2017 abgeschlossen wurden und bei welchen zwischen Abschluss- und Erfüllungstag 3 Handelstage liegen, werden nunmehr als Devisentermingeschäfte ausgewiesen.

Frankfurt am Main, den 20. September 2017
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des Abschlussprüfers.

An die Deko Investment GmbH, Frankfurt am Main

Die Deko Investment GmbH hat uns beauftragt, gemäß § 102 des Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) den Jahresbericht des Sondervermögens Deko-BasisStrategie Flexibel für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2016 bis 30. Juni 2017 zu prüfen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter

Die Aufstellung des Jahresberichts nach den Vorschriften des KAGB liegt in der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft.

Verantwortung des Abschlussprüfers

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung über den Jahresbericht abzugeben.

Wir haben unsere Prüfung nach § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass Unrichtigkeiten und Verstöße, die sich auf den Jahresbericht wesentlich auswirken, mit hinreichender Sicherheit erkannt werden. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die

Kenntnisse über die Verwaltung des Sondervermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung werden die Wirksamkeit des rechnungslegungsbezogenen internen Kontrollsystems und die Nachweise für die Angaben im Jahresbericht überwiegend auf der Basis von Stichproben beurteilt. Die Prüfung umfasst die Beurteilung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze für den Jahresbericht und der wesentlichen Einschätzungen der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der Jahresbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2016 bis 30. Juni 2017 den gesetzlichen Vorschriften.

Frankfurt am Main, den 22. September 2017

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Schobel
Wirtschaftsprüfer

Bordt
Wirtschaftsprüfer

Besteuerung der Erträge.

1. Allgemeine Besteuerungssystematik

Die Erträge eines deutschen oder ausländischen Fonds werden grundsätzlich auf der Ebene des Anlegers versteuert, während der Fonds selbst von der Steuer befreit ist. Die steuerrechtliche Behandlung von Erträgen aus Fondsanteilen folgt damit dem Grundsatz der Transparenz, wonach der Anleger grundsätzlich so besteuert werden soll, als hätte er die von dem Fonds erzielten Erträge unmittelbar selbst erwirtschaftet (Transparenzprinzip). Abweichend von diesem Grundsatz ergeben sich bei der Fondsanlage jedoch einige Besonderheiten. So werden beispielsweise bestimmte Erträge bzw. Gewinne auf der Ebene des Anlegers erst bei Rückgabe der Fondsanteile erfasst. Negative Erträge des Fonds sind mit positiven Erträgen gleicher Art zu verrechnen. Soweit die negativen Erträge hierdurch nicht vollständig ausgeglichen werden können, dürfen sie nicht von dem Anleger geltend gemacht werden, sondern müssen auf der Ebene des Fonds vorgetragen und in nachfolgenden Geschäftsjahren mit gleichartigen Erträgen ausgeglichen werden.

Eine Besteuerung des Anlegers können ausschließlich die Ausschüttung bzw. Thesaurierung von Erträgen (laufende Erträge) sowie die Rückgabe von Fondsanteilen auslösen. Die Besteuerung richtet sich dabei im Einzelnen nach den Vorschriften des Investmentsteuergesetzes in Verbindung mit dem allgemeinen Steuerrecht. Die steuerrechtlichen Folgen einer Anlage in einen Fonds sind dabei im Wesentlichen unabhängig davon, ob es sich um einen deutschen oder um einen ausländischen Fonds handelt, sodass die nachfolgende Darstellung für beide gleichermaßen gilt. Etwaige Unterschiede in der Besteuerung werden an der jeweiligen Stelle hervorgehoben.

Darüber hinaus gelten die Anmerkungen auch für Dachfonds, d. h. für Fonds, die ihr Kapital ganz überwiegend oder jedenfalls zum Teil in andere Fonds anlegen. Der Anleger muss bei Dachfonds keine Besonderheiten beachten, weil ihm die für die Besteuerung erforderlichen Informationen von der Gesellschaft in der gleichen Form zur Verfügung gestellt werden wie für andere Fonds.

Seit dem 1. Januar 2009 unterliegen Einkünfte aus Kapitalvermögen für Privatanleger in Deutschland der Abgeltungsteuer i.H.v. 25 Prozent als spezielle Form der Kapitalertragsteuer. Zusätzlich zur Abgeltungsteuer ist ein Solidaritätszuschlag in Höhe von 5,5 Prozent der Abgeltungsteuer einzubehalten und abzuführen. Seit dem 1. Januar 2015 ist jede Stelle,

die verpflichtet ist, Abgeltungsteuer für natürliche Personen abzuführen, auch Kirchensteuerabzugsverpflichteter. Dazu zählen insbesondere Banken, Kreditinstitute und Versicherungen. Diese haben – entsprechend der Religions-/ Konfessionszugehörigkeit des Anlegers – Kirchensteuer in Höhe von 8 Prozent bzw. 9 Prozent der Abgeltungsteuer automatisch einzubehalten und an die steuererhebenden Religionsgemeinschaften abzuführen. Zu diesem Zweck wird die Religionszugehörigkeit des Anlegers in Form eines verschlüsselten Kennzeichens beim Bundeszentralamt für Steuern abgefragt. Das sogenannte Kirchensteuerabzugsmerkmal (KiStAM) gibt Auskunft über die Zugehörigkeit zu einer steuererhebenden Religionsgemeinschaft und den geltenden Kirchensteuersatz. Die Abfrage erfolgt einmal jährlich zwischen dem 1. September und 31. Oktober (sogenannte Regelabfrage). Sofern der Anleger der Datenweitergabe beim Bundeszentralamt für Steuern bereits widersprochen hat bzw. bis zum 30. Juni eines Jahres widerspricht, sperrt das Bundeszentralamt die Übermittlung des KiStAM. Ein entsprechender Widerspruch gilt bis zu seinem Widerruf. Kirchenmitglieder werden in diesem Fall von ihrem Finanzamt zur Abgabe einer Steuererklärung für die Erhebung der Kirchensteuer auf Abgeltungsteuer aufgefordert. Bei Ehegatten/ Lebenspartnern mit gemeinschaftlichen Depots werden die Kapitalerträge den Ehegatten/ Lebenspartnern jeweils hälftig zugeordnet und hierauf die Kirchensteuer je nach Religionsgemeinschaft berechnet. Die Abzugsfähigkeit der Kirchensteuer als Sonderausgabe wird bereits beim Steuerabzug mindernd berücksichtigt. Auf einen entsprechenden Hinweis auf den Solidaritätszuschlag sowie die Kirchensteuer wird bei den folgenden Ausführungen jeweils verzichtet.

Die deutsche Abgeltungsteuer entfaltet für Privatanleger grundsätzlich abgeltende Wirkung. Soweit die Einnahmen der Abgeltungsteuer unterliegen haben, entfällt damit die Verpflichtung des Privatanlegers, die Einnahmen in seiner Einkommensteuererklärung anzugeben. Von der Abgeltungsteuer erfasst werden – mit wenigen Ausnahmen – alle Einkünfte aus Kapitalvermögen, worunter alle laufenden Kapitalerträge, wie z. B. Zinsen und Dividenden, sowie auch realisierte Kursgewinne (Veräußerungsgewinne), wie beispielsweise Gewinne aus der Veräußerung von Aktien oder Renten, fallen.

Bei laufenden Erträgen wie z. B. Zinsen und Dividenden ist die Abgeltungsteuer anwendbar, wenn diese dem Anleger nach dem 31. Dezember 2008 zufließen. Im Fall von realisierten Gewinnen und

Verlusten ist die Abgeltungsteuer anwendbar, wenn die Wirtschaftsgüter nach dem 31. Dezember 2008 erworben wurden. Dies gilt sowohl für die von dem Fonds erworbenen Wirtschaftsgüter als auch für den von dem Anleger erzielten Gewinn oder Verlust aus der Veräußerung eines Fondsanteils. Bei Einkünften aus Kapitalvermögen, die nicht im Zusammenhang mit Fondsanteilen stehen, gelten teilweise abweichende Übergangsregelungen.

Kann der Anschaffungszeitpunkt von Wirtschaftsgütern nicht eindeutig bestimmt werden, ist die gesetzliche Verbrauchsfolgefiktion zu beachten, wonach die als erstes angeschafften Wertpapiere als zuerst verkauft gelten. Dies gilt sowohl für die Wirtschaftsgüter des Fonds als auch für die von dem Anleger gehaltenen Fondsanteile z. B. bei Girosammelverwahrung.

2. Besteuerung der laufenden Erträge aus Fonds

2.1. Ertragsarten und Ertragsverwendung

Ein Fonds darf gemäß der jeweiligen Anlagepolitik sowie der Vertragsbedingungen in unterschiedliche Wirtschaftsgüter investieren. Die hieraus erzielten Erträge dürfen aufgrund des Transparenzgedankens nicht einheitlich z. B. als Dividenden qualifiziert werden, sondern sind entsprechend den Regeln des deutschen Steuerrechts jeweils getrennt zu erfassen. Ein Fonds kann daher beispielsweise Zinsen, zinsähnliche Erträge, Dividenden und Gewinne aus der Veräußerung von Wirtschaftsgütern erwirtschaften. Die Erträge werden dabei nach steuerrechtlichen Vorschriften – insbesondere dem Investmentsteuergesetz – ermittelt, sodass sie regelmäßig von den tatsächlich ausgeschütteten Beträgen bzw. den im Jahresbericht ausgewiesenen Beträgen für Ausschüttung und Thesaurierung abweichen. Die steuerrechtliche Behandlung der Erträge beim Anleger hängt sodann von der Ertragsverwendung des Fonds ab, d. h. ob der Fonds die Erträge vollständig thesauriert oder vollständig bzw. teilweise ausschüttet. Die Ertragsverwendung Ihres Fonds entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt oder dem Jahresbericht. Darüber hinaus ist danach zu differenzieren, ob die Erträge einem Privatanleger oder einem betrieblichen Anleger zuzurechnen sind. Sofern vom Fonds eine steuerrechtliche Substanzausschüttung ausgewiesen wird, ist diese für den Anleger nicht steuerbar. Dies bedeutet für einen bilanzierenden Anleger, dass die Substanzausschüttung in der Handelsbilanz ertragswirksam zu vereinnahmen ist, in der Steuerbilanz aufwandswirksam ein passiver Ausgleichsposten zu

bilden ist und damit technisch die historischen Anschaffungskosten steuerneutral gemindert werden. Alternativ können die fortgeführten Anschaffungskosten um den anteiligen Betrag der Substanzausschüttung vermindert werden.

2.2. Ausländische Quellensteuer

Auf ausländische Erträge werden teilweise Quellensteuern in dem jeweiligen Land einbehalten, die auf der Ebene des Fonds als Werbungskosten abgezogen werden dürfen. Alternativ kann die Gesellschaft die ausländischen Quellensteuern in den Besteuerungsgrundlagen ausweisen, sodass sie direkt auf Ebene des Anlegers auf die zu zahlende Steuer angerechnet werden, oder sie der Anleger von seinen Einkünften abziehen kann. Teilweise investieren Fonds darüber hinaus in Länder, in denen auf die Erträge zwar tatsächlich keine Quellensteuer einbehalten wird, der Anleger aber gleichwohl eine Quellensteuer auf seine persönliche Steuerschuld anrechnen kann (fiktive Quellensteuer). In diesen Fällen kommt auf Ebene des Anlegers ausschließlich die Anrechnung der ausgewiesenen fiktiven Quellensteuer in Betracht. Ein Abzug von fiktiver Quellensteuer von den Einkünften des Anlegers ist unzulässig.

2.3. Veröffentlichung der Besteuerungsgrundlagen

Die für die Besteuerung des Anlegers maßgeblichen Besteuerungsgrundlagen werden von der Gesellschaft zusammen mit einer Berufsträgerbescheinigung, dass die Angaben nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden, im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlicht.

2.4. Besteuerung im Privatvermögen

Wann die von dem Fonds erzielten Erträge beim Anleger steuerrechtlich zu erfassen sind, hängt von der Ertragsverwendung ab. Bei einer Thesaurierung hat der Anleger die sog. ausschüttungsgleichen Erträge, d. h. bestimmte von dem Fonds nicht zur Ausschüttung verwendete Erträge, in dem Kalenderjahr zu versteuern, in dem das Geschäftsjahr des Fonds endet. Da der Anleger in diesem Fall tatsächlich keine Erträge erhält, diese aber gleichwohl versteuern muss, spricht man in diesem Zusammenhang von der sog. Zuflussfiktion. Bei einer Vollausschüttung sind beim Anleger die ausgeschütteten Erträge und bei einer Teilausschüttung sowohl die ausgeschütteten als auch die ausschüttungsgleichen Erträge grundsätzlich steuerpflichtig. In beiden Fällen hat der in Deutschland steuerpflichtige Anleger die Erträge im Jahr des Zuflusses zu versteuern.

Sowohl die ausgeschütteten als auch die ausschüttungsgleichen Erträge sind grundsätzlich in vollem Umfang steuerpflichtig, es sei denn, die Steuerfreiheit bestimmter Erträge ist explizit geregelt. Bei der Ermittlung der Einkünfte aus Kapitalvermögen ist als Werbungskosten ein Sparer-Pauschbetrag in Höhe von 801,- Euro (bei Zusammenveranlagung: 1.602,- Euro) abzuziehen, soweit der Anleger in Deutschland unbeschränkt steuerpflichtig ist. Der Abzug von dem Anleger tatsächlich entstandenen Werbungskosten (z. B. Depotgebühren) ist in der Regel ausgeschlossen. Gewinne aus der Veräußerung von Wertpapieren und Termingeschäften sind vom Anleger nur bei Ausschüttung bzw. bei Rückgabe der Fondsanteile zu versteuern.

2.5. Besteuerung im Betriebsvermögen

Der in Deutschland unbeschränkt steuerpflichtige betriebliche Anleger, der seinen Gewinn durch Einnahme-Überschuss-Rechnung ermittelt, hat die ausgeschütteten Erträge sowie die ausschüttungsgleichen Erträge zum gleichen Zeitpunkt wie der Privatanleger zu versteuern. Im Fall der Gewinnermittlung durch Betriebsvermögensvergleich hat der Anleger die ausschüttungsgleichen Erträge am Geschäftsjahresende des Fonds und die ausgeschütteten Erträge mit Entstehung des Anspruchs zu erfassen. Insoweit finden die allgemeinen Regeln des Bilanzsteuerrechts Anwendung.

Für den betrieblichen Anleger sind sowohl die ausgeschütteten als auch die ausschüttungsgleichen Erträge grundsätzlich in vollem Umfang steuerpflichtig, soweit nicht die Steuerfreiheit bestimmter Erträge explizit geregelt ist. So sind beispielweise Dividenderträge sowie ausgeschüttete realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Aktien von dem Anleger nur in Höhe von 60 Prozent zu versteuern (Teileinkünfteverfahren). Für körperschaftsteuerpflichtige Anleger sind z. B. in- und ausländische Dividenderträge, die dem Sondervermögen vor dem 1. März 2013 zugeflossen sind, zu 95 Prozent steuerfrei. Aufgrund der Neuregelung zur Besteuerung von Streubesitzdividenden sind Dividenden, die dem Sondervermögen nach dem 28. Februar 2013 zugeflossen sind, bei körperschaftsteuerpflichtigen Anlegern steuerpflichtig. Die ausgeschütteten realisierten Gewinne aus der Veräußerung von Aktien sind grundsätzlich zu 95 Prozent steuerfrei. Dies gilt nicht für derartige Erträge aus Fondsanteilen, die insbesondere Kreditinstitute ihrem Handelsbestand zuordnen.

3. Rückgabe von Fondsanteilen

Steuerrechtlich wird die Rückgabe von Fondsanteilen wie ein Verkauf behandelt, d. h. der Anleger realisiert einen Veräußerungsgewinn oder -verlust.

3.1. Besteuerung im Privatvermögen

Gewinne und Verluste aus der Rückgabe von Fondsanteilen sind als positive bzw. negative Einkünfte aus Kapitalvermögen grundsätzlich steuerpflichtig. Die Gewinne und Verluste können mit anderen Erträgen aus Kapitalvermögen grundsätzlich verrechnet werden. Dies gilt jedoch nicht im Hinblick auf Verlustvorträge oder zukünftige Verluste aus der Veräußerung von Aktien, für die ein separater Verlustverrechnungstopf zu führen ist.

Das Verrechnungsverbot gilt auch für Verluste aus der Rückgabe von Fondsanteilen oder Veräußerung anderer Wertpapiere, die noch unter das alte Recht vor Einführung der Abgeltungsteuer fallen.

Der so genannte DBA-Gewinn umfasst Erträge und Gewinne bzw. Verluste, die aufgrund eines Doppelbesteuerungsabkommens zwischen dem Quellstaat und Deutschland steuerfrei und noch nicht ausgeschüttet oder thesauriert worden sind. Der Gewinn bzw. Verlust aus der Veräußerung der Fondsanteile ist für private Anleger in Höhe des besitzzeitanteiligen DBA-Gewinns steuerfrei. Der DBA-Gewinn wird von der Gesellschaft als Prozentsatz des Rücknahmepreises veröffentlicht.

Der im Rücknahmepreis als enthalten geltende Zwischengewinn unterliegt ebenfalls der Besteuerung. Dieser setzt sich aus den von dem Fonds erwirtschafteten Zinsen und zinsähnlichen Erträgen zusammen, die seit dem letzten Ausschüttungs- oder Thesaurierungstermin angefallen sind und seit diesem Zeitpunkt noch nicht steuerpflichtig ausgeschüttet oder thesauriert wurden. Der Zwischengewinn wird von der Gesellschaft bewertungstäglich ermittelt und zusammen mit dem Rücknahmepreis veröffentlicht. Außerdem wird er dem Anleger von der Verwahrstelle in Deutschland auf der Wertpapierabrechnung mitgeteilt. Der beim Kauf gezahlte Zwischengewinn gehört beim Anleger grundsätzlich zu den negativen Einnahmen aus Kapitalvermögen, die er mit anderen positiven Einkünften aus Kapitalvermögen verrechnen kann. Voraussetzung ist, dass vom Fonds ein Ertragsausgleich durchgeführt wird und sowohl bei der Veröffentlichung des Zwischengewinns als auch im Rahmen der von den Berufsträgern zu bescheinigenden Steuerdaten hierauf hingewiesen wird. Der bei Rückgabe der Fondsan-

teile vereinnahmte Zwischengewinn zählt zu den positiven Einkünften aus Kapitalvermögen. Wird der Zwischengewinn nicht veröffentlicht, sind jährlich 6 Prozent des Entgelts für die Rückgabe oder Veräußerung des Fondsanteils als Zwischengewinn anzusetzen.

Hedgefonds sind gesetzlich nicht verpflichtet, den Zwischengewinn zu ermitteln bzw. zu veröffentlichen. Sofern sich die Gesellschaft dazu entschließt, darf der Zwischengewinn für Hedgefonds allerdings freiwillig ermittelt und veröffentlicht werden.

Der Veräußerungsgewinn wird für den Anleger grundsätzlich von der deutschen Verwahrstelle ermittelt. Gewinn oder Verlust ist hierbei der Unterschied zwischen dem Veräußerungspreis einerseits und den Anschaffungskosten und den Werbungskosten andererseits. Darüber hinaus sind die Anschaffungskosten sowie der Veräußerungspreis jeweils um den Zwischengewinn zu mindern. Der so ermittelte Veräußerungsgewinn bzw. -verlust ist zusätzlich um die ausschüttungsgleichen Erträge zu mindern, um insoweit eine Doppelbesteuerung zu vermeiden.

3.2. Besteuerung im Betriebsvermögen

Bei einer Rückgabe von Fondsanteilen bildet die Differenz zwischen dem Rücknahmepreis und den Anschaffungskosten grundsätzlich den steuerpflichtigen Veräußerungsgewinn oder Veräußerungsverlust. Der erhaltene Zwischengewinn stellt beim betrieblichen Anleger einen unselbständigen Teil des Veräußerungserlöses dar.

Der Aktiengewinn umfasst Dividenden, soweit diese bei Zurechnung an den Anleger steuerfrei sind, Veräußerungsgewinne und -verluste aus Aktien sowie Wertsteigerungen und -minderungen aus Aktien, die noch nicht ausgeschüttet oder thesauriert worden sind. Der Aktiengewinn wird von der Gesellschaft als Prozentsatz des Rücknahmepreises veröffentlicht, sodass der Anleger den absoluten Aktiengewinn sowohl bei Erwerb als auch bei Rückgabe der Fondsanteile durch Multiplikation mit dem jeweiligen Rücknahmepreis ermitteln muss. Die Differenz zwischen dem absoluten Aktiengewinn bei Rückgabe und dem absoluten Aktiengewinn bei Erwerb stellt sodann den besitzzeitanteiligen Aktiengewinn dar, durch den der Anleger eine Aussage darüber erhält, in welchem Umfang die Wertsteigerung bzw. der Wertverlust seiner Fondsanteile auf Aktien zurückzuführen ist. Der Gewinn bzw. Verlust aus der Veräußerung der Fondsanteile ist für körperschaftsteuerpflichtige Anleger i.H.v. 95 Prozent

des besitzzeitanteiligen Aktiengewinns, für einkommensteuerpflichtige betriebliche Anleger i.H.v. 40 Prozent des besitzzeitanteiligen Aktiengewinns steuerfrei. Aufgrund der oben erwähnten Gesetzesänderung werden seit dem 1. März 2013 zwei Aktiengewinne getrennt für körperschaftsteuerpflichtige Anleger und für einkommensteuerpflichtige betriebliche Anleger veröffentlicht.

Der so genannte DBA-Gewinn umfasst Erträge und Gewinne bzw. Verluste, die aufgrund eines Doppelbesteuerungsabkommens zwischen dem Quellensstaat und Deutschland steuerfrei und noch nicht ausgeschüttet oder thesauriert worden sind. Der Gewinn bzw. Verlust aus der Veräußerung der Fondsanteile ist für betriebliche Anleger in Höhe des besitzzeitanteiligen DBA-Gewinns steuerfrei. Der DBA-Gewinn wird von der Gesellschaft in der gleichen Form wie der Aktiengewinn getrennt von diesem veröffentlicht.

Der betriebliche Anleger hat die Fondsanteile mit den Anschaffungskosten zuzüglich gegebenenfalls Anschaffungsnebenkosten zu aktivieren. Der beim Kauf gezahlte Zwischengewinn stellt einen unselbständigen Teil der Anschaffungskosten dar. Wenn der Fonds während der Haltedauer der Fondsanteile Erträge thesauriert, sind die ausschüttungsgleichen Erträge außerbilanziell zu erfassen und ein aktiver Ausgleichsposten zu bilden. Zum Zeitpunkt der Rückgabe der Fondsanteile sind diese erfolgswirksam auszubuchen und der aktive Ausgleichsposten ist aufzulösen, um eine doppelte steuerrechtliche Erfassung der ausschüttungsgleichen Erträge zu vermeiden. Darüber hinaus ist der besitzzeitanteilige Aktiengewinn außerbilanziell zu berücksichtigen.

Der folgende Absatz betrifft ausschließlich Fonds nach deutschem Recht:

Der Europäische Gerichtshof (EuGH) hat in der Rechtssache STEKO Industriemontage GmbH entschieden, dass die Regelung im Körperschaftsteuergesetz für den Übergang vom körperschaftsteuerlichen Anrechnungsverfahren zum Halbeinkünfteverfahren in 2001 europarechtswidrig ist. Das Verbot für Körperschaften, Gewinnminderungen im Zusammenhang mit Beteiligungen an ausländischen Gesellschaften nach § 8b Absatz 3 KStG steuerwirksam geltend zu machen, galt nach § 34 KStG bereits in 2001, während dies für Gewinnminderungen im Zusammenhang mit Beteiligungen an inländischen Gesellschaften erst in 2002 galt. Dies widerspricht nach Auffassung des EuGH der Kapitalverkehrsfreiheit. Der Bundesfinanzhof (BFH) hat mit Urteil vom

28. Oktober 2009 (Az. I R 27/08) entschieden, dass die Rechtssache STEKO grundsätzlich Wirkungen auf die Fondsanlage entfaltet. Mit BMF-Schreiben vom 1. Februar 2011 „Anwendung des BFH-Urteils vom 28. Oktober 2009 – I R 27/08 beim Aktiengewinn („STEKO-Rechtsprechung“)" hat die Finanzverwaltung insbesondere dargelegt, unter welchen Voraussetzungen nach ihrer Auffassung eine Anpassung eines Aktiengewinns aufgrund der Rechtssache STEKO möglich ist. Der BFH hat zudem mit den Urteilen vom 25. Juni 2014 (I R 33/09) und 30. Juli 2014 (I R 74/12) im Nachgang zum Beschluss des Bundesverfassungsgerichts vom 17. Dezember 2013 (1 BvL 5/08, BGBl I 2014, 255) entschieden, dass Hinzurechnungen von negativen Aktiengewinnen aufgrund des § 40a KAGG i.d.F. des Steuersenkungsgesetzes vom 23. Oktober 2000 in den Jahren 2001 und 2002 nicht zu erfolgen hatten und dass steuerfreie positive Aktiengewinne nicht mit negativen Aktiengewinnen zu saldieren waren. Soweit also nicht bereits durch die STEKO-Rechtsprechung eine Anpassung des Anleger-Aktiengewinns erfolgt ist, kann ggf. nach der BFH-Rechtsprechung eine entsprechende Anpassung erfolgen. Die Finanzverwaltung hat sich hierzu bislang nicht geäußert. Im Hinblick auf mögliche Maßnahmen aufgrund der BFH-Rechtsprechung empfehlen wir Anlegern mit Anteilen im Betriebsvermögen, einen steuerlichen Berater zu konsultieren.

4. Deutsche Kapitalertragsteuer

Die inländischen depotführenden Verwahrstellen haben grundsätzlich die Kapitalertragsteuer für den Anleger einzubehalten und abzuführen. Die Kapitalertragsteuer hat für Privatanleger grundsätzlich abgeltende Wirkung. Der Anleger hat allerdings ein Veranlagungswahlrecht und in bestimmten Fällen eine Veranlagungspflicht. Werden die Fondsanteile im Betriebsvermögen gehalten, besteht grundsätzlich eine Pflicht zur Veranlagung. Wird der betriebliche Anleger mit seinen Erträgen aus Fondsanteilen zur Einkommen- oder Körperschaftsteuer veranlagt, ist die gezahlte Kapitalertragsteuer nur eine Steuervorauszahlung ohne abgeltende Wirkung, die der Anleger auf seine persönliche Steuerschuld anrechnen kann. Hierfür erhält der Anleger von deutschen Verwahrstellen eine Steuerbescheinigung, die er im Rahmen seiner Veranlagung dem Finanzamt vorlegen muss.

Im Rahmen der Veranlagung ist der Steuersatz bei Privatanlegern für Einkünfte aus Kapitalvermögen auf 25 Prozent begrenzt. Eine freiwillige Veranla-

gung ist insbesondere Anlegern ohne oder mit einem sehr niedrigen zu versteuernden Einkommen zu empfehlen.

Bei Erteilung einer Nichtveranlagungsbescheinigung oder der Vorlage eines gültigen Freistellungsauftrags verzichten deutsche Verwahrstellen insoweit auf den Einbehalt der Kapitalertragsteuer. Weist der Anleger nach, dass er Steuerausländer ist, beschränkt sich der Kapitalertragsteuerabzug auf Erträge aus deutschen Dividenden.

Deutsche Verwahrstellen haben für den Steuerpflichtigen einen Verlustverrechnungstopf zu führen, der automatisch in das nächste Jahr übertragen wird. Hierbei sind Verluste aus dem Verkauf von Aktien nur mit Gewinnen aus dem Verkauf von Aktien verrechenbar. Gewinne aus der Rückgabe von Fondsanteilen sind steuerrechtlich keine Gewinne aus Aktien.

Kapitalertragsteuer wird nur insoweit einbehalten, als die positiven Einkünfte die (vorgetragenen) negativen Einkünfte sowie evtl. Freistellungsaufträge übersteigen. Der in Deutschland unbeschränkt steuerpflichtige Anleger darf seinen Banken insgesamt Freistellungsaufträge bis zu einem Gesamtbetrag von 801,- Euro (bei Zusammenveranlagung: 1.602,- Euro) erteilen.

Freistellungsauftrag, Nichtveranlagungsbescheinigung bzw. der Nachweis der Ausländereigenschaft müssen der Verwahrstelle rechtzeitig vorliegen. Rechtzeitig ist im Falle der Thesaurierung vor dem Geschäftsjahresende des Fonds, bei ausschüttenden Fonds vor der Ausschüttung und bei der Rückgabe von Fondsanteilen vor der Transaktion.

Werden die Fondsanteile nicht in einem deutschen Depot verwahrt und die Ertragsbescheinigung einer deutschen Zahlstelle vorgelegt, können Freistellungsauftrag sowie Nichtveranlagungsbescheinigung nicht berücksichtigt werden.

Ausländische Anleger können bei verspätetem Nachweis der Ausländereigenschaft die Erstattung des Steuerabzugs grundsätzlich entsprechend der Abgabenordnung (§ 37 Abs. 2 AO) beantragen. Zuständig ist das für die depotführende Stelle zuständige Finanzamt. Eine Erstattung des Steuerabzugs auf deutsche Dividenden ist nur im Rahmen des einschlägigen Doppelbesteuerungsabkommens zwischen ihrem Ansässigkeitsstaat und Deutschland möglich. Für die Erstattung ist das Bundeszentralamt für Steuern zuständig.

Soweit der Fonds gezahlte oder fiktiv anrechenbare ausländische Quellensteuern ausweist, werden diese grundsätzlich beim Steuerabzug steuermindernd berücksichtigt. Ist eine steuerrechtliche Berücksichtigung ausgewiesener anrechenbarer Quellensteuern ausnahmsweise nicht möglich, werden sie in einem „Quellensteuertopf“ vorgetragen.

4.1. Deutsche Fonds

Deutsche depotführende Stellen haben sowohl bei Ausschüttung als auch bei Thesaurierung grundsätzlich Kapitalertragsteuer einzubehalten und abzuführen.

Werden die Fondsanteile bei einer deutschen Verwahrstelle verwahrt, hat die Verwahrstelle bei Rückgabe der Fondsanteile darüber hinaus Kapitalertragsteuer auf den Zwischengewinn einzubehalten. Bei Rückgabe von Fondsanteilen, die nach dem 31. Dezember 2008 angeschafft wurden, wird darüber hinaus Kapitalertragsteuer auf den Gewinn aus der Veräußerung der Fondsanteile einbehalten.

4.2. Ausländische Fonds

Ausländische Gesellschaften führen keine Kapitalertragsteuer an das deutsche Finanzamt ab. Bei ausschüttenden bzw. teilausschüttenden Fonds behält jedoch die deutsche Verwahrstelle die Kapitalertragsteuer auf ausgeschüttete Erträge ein.

Werden die Fondsanteile bei einer deutschen Verwahrstelle zurückgegeben, hat diese darüber hinaus Kapitalertragsteuer auf den Zwischengewinn einzubehalten und abzuführen. Bei Rückgabe von Fondsanteilen, die nach dem 31. Dezember 2008 angeschafft wurden, wird darüber hinaus Kapitalertragsteuer auf den Gewinn aus der Veräußerung der Fondsanteile einbehalten.

Zusätzlich hat die deutsche Verwahrstelle Kapitalertragsteuer auf die Summe der dem Anleger nach dem 31. Dezember 1993 als zugeflossen geltenden und noch nicht der deutschen Kapitalertragsteuer unterlegenen Erträge einzubehalten und abzuführen. Wurden die Fondsanteile seit Erwerb ununterbrochen bei ein und derselben deutschen Verwahrstelle verwahrt, bilden nur die besitzzeitanteiligen akkumulierten ausschüttungsgleichen Erträge die Bemessungsgrundlage für die Kapitalertragsteuer. Die akkumulierten ausschüttungsgleichen Erträge werden von der Gesellschaft ermittelt und bewertungstäglich zusammen mit dem Rücknahmepreis veröffentlicht.

5. EU-Zinsrichtlinie (Zinsinformationsverordnung)

Am 10. November 2015 hat der Rat der Europäischen Union die Richtlinie zur Abschaffung der EU-Zinsrichtlinie (Richtlinie 2003/48/EG) erlassen. Mit Ausnahme von Österreich ist die EU-Zinsrichtlinie daher seit dem 1. Januar 2016 aufgehoben. Die Aufhebung erfolgt allerdings vorbehaltlich der Fortgeltung bestimmter administrativer Verpflichtungen, wie z. B. das Berichten und Austauschen von Informationen in Bezug auf sowie der Einbehalt von Quellensteuern von Zahlungen vor dem 1. Januar 2016. In Österreich erfolgt die Aufhebung spätestens zum 1. Januar 2017. Unter gewissen Voraussetzungen kann die Aufhebung auch bereits zum 1. Oktober 2016 erfolgen. Übergangsbestimmungen im Fall von sich überschneidenden Geltungsbereichen verhindern eine parallele Anwendung. Im Ergebnis bedeutet dies, dass spätestens ab 2018 innerhalb der EU volle Steuertransparenz gegeben sein wird und die EU-Quellensteuer ab diesem Zeitpunkt obsolet wird.

Bis zur Aufhebung der EU-Zinsrichtlinie waren alle Mitgliedstaaten verpflichtet, den zuständigen Behörden der Mitgliedstaaten Auskünfte über Zinszahlungen und gleichgestellte Zahlungen zu erteilen, die im Auskunft erteilenden Mitgliedstaat an eine in einem anderen Mitgliedstaat ansässige Person gezahlt werden. Allerdings wurde einigen Staaten gewährt, stattdessen während einer Übergangszeit eine Quellensteuer in Höhe von 35 Prozent zu erheben. Von diesem Recht machte zuletzt nur noch Österreich Gebrauch.

6. Grundzüge des automatischen steuerlichen Informationsaustausches (Common Reporting Standard, CRS)

Am 21. Juli 2014 hat die Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) einen globalen Standard für den automatischen Austausch von Kontodaten in Steuerangelegenheiten vorgelegt. Der vorgelegte Standard sieht einen automatisierten, internationalen Datenaustausch zwischen den nationalen Finanzbehörden vor und besteht aus einem Musterabkommen, dem sog. Common Reporting Standard („CRS“) Due Diligence Prozess sowie einer Musterkommentierung. Der CRS definiert meldepflichtige Finanzinstitute, Konten und Informationen. Ende Oktober 2014 haben 51 Staaten das Musterabkommen unterzeichnet, um Informationen automatisiert auszutauschen. Zwischen-

zeitlich haben sich mehr als 90 Staaten und Gebiete darauf verständigt, durch gegenseitigen Informationsaustausch über Finanzkonten eine effektive Besteuerung sicherzustellen. CRS beginnt grundsätzlich erstmalig mit dem Meldezeitraum 2016, einige CRS-Teilnehmerstaaten beginnen jedoch erst mit dem Meldejahr 2017. Deutschland hat sich verpflichtet, die Informationen über Finanzkonten aus dem Jahr 2016 erstmalig im September 2017 mit den OECD-Partnerstaaten auszutauschen.

Seit 1. Januar 2016 müssen deutsche Finanzinstitute sämtliche Kontoinhaber kennzeichnen, bei denen eine ausländische Steuerpflicht vorliegt. Deren Depots und Erträge sind an die deutschen Finanzbehörden (Bundeszentralamt für Steuern BZSt) zu melden. Dieses leitet die Daten an die betreffenden Teilnehmerstaaten weiter. Vorgesehen sind nur Melde- jedoch keinerlei Steuerabzugsverpflichtungen. Die Regelungen der Abgeltungsteuer bleiben durch den steuerlichen Informationsaustausch unberührt.

7. Investmentsteuerreform

Der Entwurf für ein Investmentsteuerreformgesetz sieht grundsätzlich vor, dass ab 2018 bei Fonds bestimmte inländische Erträge (Dividenden/Mieten/Veräußerungsgewinne aus Immobilien) bereits auf Ebene des Fonds besteuert werden sollen. Sollte der Entwurf in dieser Form als Gesetz verabschiedet werden, sollen auf Ebene des Anlegers Ausschüttungen, Vorabpauschalen und Gewinne aus dem Verkauf von Fondsanteilen unter Berücksichtigung von Teilfreistellungen grundsätzlich steuerpflichtig sein.

Die Teilfreistellungen sollen ein Ausgleich für die Vorbelastung auf der Fondsebene sein, so dass Anleger unter bestimmten Voraussetzungen einen pauschalen Teil der vom Fonds erwirtschafteten Erträge steuerfrei erhalten. Dieser Mechanismus gewährleistet allerdings nicht, dass in jedem Einzelfall ein vollständiger Ausgleich geschaffen wird.

Zum 31. Dezember 2017 soll unabhängig vom tatsächlichen Geschäftsjahresende des Fonds für steuerliche Zwecke ein (Rumpf-)Geschäftsjahr als beendet gelten. Hierdurch können ausschüttungsgleiche Erträge zum 31. Dezember 2017 als zugeflossen gelten. Zu diesem Zeitpunkt sollen auch die Fondsanteile der Anleger als veräußert, und am 01. Januar 2018 als wieder angeschafft gelten. Ein Gewinn im Sinne des Gesetzesentwurfes aus

dem fiktiven Verkauf der Anteile soll jedoch erst im Zeitpunkt der tatsächlichen Veräußerung der Anteile bei den Anlegern als zugeflossen gelten.

8. Rechtliche Hinweise

Diese steuerlichen Hinweise sollen einen Überblick über die steuerlichen Folgen der Fondsanlage vermitteln. Sie können nicht alle steuerlichen Aspekte behandeln, die sich aus der individuellen Situation des Anlegers ergeben können. Interessierten Anlegern empfehlen wir, sich durch einen Angehörigen der steuerberatenden Berufe über die steuerlichen Folgen des Fondsinvestments beraten zu lassen.

Die steuerlichen Ausführungen basieren auf der derzeit bekannten Rechtslage. Es kann keine Gewähr dafür übernommen werden, dass sich die steuerrechtliche Beurteilung durch Gesetzgebung, Rechtsprechung oder Erlasse der Finanzverwaltung nicht ändert. Solche Änderungen können auch rückwirkend eingeführt werden und die oben beschriebenen steuerrechtlichen Folgen nachteilig beeinflussen.

9. Änderung durch das Bilanzrechtsmodernisierungsgesetz (BilMoG): Spezielle Anhangangaben für Fonds (§ 285 Nr. 26 HGB; § 314 Absatz 1 Nr. 18 HGB)

Anleger, die nach dem Handelsgesetzbuch (HGB) dazu verpflichtet sind, den Jahresabschluss um einen Anhang zu erweitern, und die zu mehr als 10 Prozent am Fondskapital von in- und ausländischen Spezial- und Publikumsfonds beteiligt sind, müssen nach dem BilMoG ergänzende Angaben zu den Fonds im Anhang offenlegen.

Das BilMoG ist grundsätzlich für Geschäftsjahre anwendbar, die nach dem 31. Dezember 2009 beginnen. Das BilMoG sieht die folgenden zusätzlichen Angaben im Anhang (§ 285 Nr. 26 HGB) und Konzernanhang (§ 314 Absatz 1 Nr. 18 HGB) vor:

- Klassifizierung des Fonds nach Anlagezielen, z. B. Aktienfonds, Rentenfonds, Immobilienfonds, Mischfonds, Hedgefonds oder Sonstiger Fonds
- Marktwert / Anteilwert nach §§ 168, 278 KAGB oder § 36 InvG in der bis zum 21. Juli 2013 geltenden Fassung
- Differenz zwischen Marktwert und Buchwert

- (Ertrags-)Ausschüttungen des Geschäftsjahres
- Beschränkungen des Rechts zur täglichen Rückgabe
- Gründe für das Unterlassen von Abschreibungen gemäß § 253 Absatz 3 Satz 4 HGB
- Anhaltspunkte für eine voraussichtlich nicht dauerhafte Wertminderung

Bitte wenden Sie sich für individuelle und weiterführende Informationen persönlich an Ihren Abschlussprüfer.

Steuerliche Behandlung

Deka Investment GmbH

Deka-BasisStrategie Flexibel CF

ISIN		DE000DK2EAR4			
WKN		DK2EAR			
Besteuerungsgrundlagen für den Zeitraum von / bis		1. Juli 2016 bis 30. Juni 2017			
Ausschüttung per		18. August 2017			
		Privat- vermögen	Betriebs- vermögen		
			EStG	KStG	
	Ausschüttung ¹⁾	EUR je Anteil	1,3000	1,3000	1,3000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1a	Ausschüttung nach Investmentsteuergesetz ²⁾	EUR je Anteil	1,4415	1,4415	1,4415
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1a, aa	In der Ausschüttung enthaltene ausschüttungsgleiche Erträge aus Vorjahren	EUR je Anteil	0,0001	0,0001	0,0001
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1a, bb	In der Ausschüttung enthaltene Substanzbeträge	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1b	Ausgeschüttete Erträge ³⁾	EUR je Anteil	1,4414	1,4414	1,4414
	Thesaurierung netto ⁴⁾	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 i. V. m. Nr. 1a und b	Thesaurierung brutto (Betrag der ausschüttungsgleichen Erträge) ⁵⁾	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
	Zinsen und sonstige Erträge	EUR je Anteil	0,2346	0,2346	0,2346
	Dividenden nach § 8b Abs. 1 KStG bzw. § 3 Nr. 40 EStG	EUR je Anteil	1,2068	1,2068	-,-
	Dividenden nicht nach § 8b Abs. 1 KStG (Streubesitzdividende)	EUR je Anteil	-,-	-,-	1,2068
	Ausländische DBA befreite Einkünfte	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	Veräußerungsgewinne nach § 8b KStG bzw. § 3 Nr. 40 EStG	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	Sonstige Veräußerungsgewinne	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	Summe Erträge	EUR je Anteil	1,4414	1,4414	1,4414
	Im Betrag der ausgeschütteten bzw. ausschüttungsgleichen Erträge enthalten:				
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, aa	Erträge i. S. d. § 2 Abs. 2 Satz 1 InvStG i. V. m. § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG (Bruttoertrag Dividenden)	EUR je Anteil	-,-	1,2068	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, bb	Steuerfreie Veräußerungsgewinne i. S. d. § 2 Abs. 2 Satz 2 InvStG i. V. m. § 8 Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG	EUR je Anteil	-,-	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, cc	Erträge i. S. d. § 2 Abs. 2a InvStG (Zinsanteil i. S. d. § 4h EStG)	EUR je Anteil	-,-	0,1538	0,1538
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, dd	Steuerfreie Veräußerungsgewinne i. S. d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 Satz 1 InvStG in der am 31.12.2008 anzuwendenden Fassung	EUR je Anteil	0,0000	-,-	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, ee	Erträge i. S. d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 Satz 2 InvStG in der am 31.12.2008 anzuwendenden Fassung, soweit die Erträge nicht Kapitalerträge i. S. d. § 20 EStG sind	EUR je Anteil	0,0000	-,-	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, ff	Steuerfreie Veräußerungsgewinne i. S. d. § 2 Abs. 3 InvStG in der ab dem 01.01.2009 anzuwendenden Fassung	EUR je Anteil	0,0000	-,-	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, gg	Ausländische DBA befreite Einkünfte i. S. d. § 4 Abs. 1 InvStG	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, hh	In Doppelbuchstabe gg enthaltene Einkünfte, die nicht dem Progressionsvorbehalt unterliegen	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, ii	Einkünfte i. S. d. § 4 Abs. 2 InvStG, für die kein Abzug nach Abs. 4 vorgenommen wurde (ausländische Einkünfte mit anrechenbarer bzw. fiktiv anrechenbarer Quellensteuer)	EUR je Anteil	0,5654	0,5654	0,5654
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, jj	in Doppelbuchstabe ii enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	EUR je Anteil	-,-	0,5654	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, kk	in Doppelbuchstabe ii enthaltene Einkünfte mit Anrechnung fiktiver Quellensteuer	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, ll	in Doppelbuchstabe kk enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	EUR je Anteil	-,-	0,0000	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, mm	Erträge i. S. d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG	EUR je Anteil	-,-	-,-	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, nn	in Doppelbuchstabe ii enthaltene Einkünfte i. S. d. § 21 Abs. 22 Satz 4 dieses Gesetzes, auf die § 2 Abs. 2 dieses Gesetzes in der am 20. März 2013 geltenden Fassung i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	EUR je Anteil	-,-	-,-	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1c, oo	in Doppelbuchstabe kk enthaltene Einkünfte i. S. d. § 21 Abs. 22 Satz 4 dieses Gesetzes, auf die § 2 Abs. 2 dieses Gesetzes in der am 20. März 2013 geltenden Fassung i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	EUR je Anteil	-,-	-,-	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1d	den zur Anrechnung von Kapitalertragsteuer berechtigenden Teil der Ausschüttung bzw. ausschüttungsgleichen Erträge				
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1d, aa	im Sinne von § 7 Abs. 1 und 2 InvStG ⁶⁾	EUR je Anteil	1,3892	1,3892	1,3892
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1d, bb	im Sinne von § 7 Abs. 3 InvStG ⁶⁾	EUR je Anteil	0,0522	0,0522	0,0522
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1d, cc	in Doppelbuchstabe aa enthaltene Erträge im Sinne von § 7 Abs. 1 Satz 4 ⁶⁾	EUR je Anteil	-,-	1,1546	1,1546
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f	Betrag der ausländischen Steuer, der auf die in den ausgeschütteten Erträgen enthaltenen Einkünfte i. S. d. § 4 Abs. 2 InvStG entfällt und				
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, aa	nach § 4 Abs. 2 InvStG i. V. m. § 32d Abs. 5 oder § 34c Abs. 1 EStG oder einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung anrechenbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde ⁷⁾	EUR je Anteil	0,0901	0,0901	0,0901
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, bb	in Doppelbuchstabe aa enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist ⁷⁾	EUR je Anteil	-,-	0,0901	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, cc	nach § 4 Abs. 2 InvStG i. V. m. § 34c Abs. 3 EStG abziehbar, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde ⁷⁾	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, dd	in Doppelbuchstabe cc enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist ⁷⁾	EUR je Anteil	-,-	0,0000	-,-

Steuerliche Behandlung

Deka Investment GmbH		Deka-BasisStrategie Flexibel CF			
ISIN		DE000DK2EAR4			
WKN		DK2EAR			
Besteuerungsgrundlagen für den Zeitraum von / bis		1. Juli 2016 bis 30. Juni 2017			
Ausschüttung per		18. August 2017			
		Privat- vermögen	Betriebs- vermögen		
			EstG	KStG	
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, ee	nach einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung als gezahlt gilt und nach § 4 Abs. 2 i. V. m. diesem Abkommen anrechenbar ist ^{7) 8)}	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, ff	in Doppelbuchstabe ee enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist ⁷⁾	EUR je Anteil	-,-	0,0000	-,-
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, gg	in Doppelbuchstabe aa enthalten ist und auf Einkünfte i. S. d. § 21 Abs. 22 Satz 4 dieses Gesetzes entfällt, auf die § 2 Abs. 2 dieses Gesetzes in der am 20. März 2013 geltenden Fassung i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist ⁷⁾	EUR je Anteil	-,-	-,-	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, hh	in Doppelbuchstabe cc enthalten ist und auf Einkünfte i. S. d. § 21 Abs. 22 Satz 4 dieses Gesetzes entfällt, auf die § 2 Abs. 2 dieses Gesetzes in der am 20. März 2013 geltenden Fassung i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist ⁷⁾	EUR je Anteil	-,-	-,-	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1f, ii	in Doppelbuchstabe ee enthalten ist und auf Einkünfte i. S. d. § 21 Abs. 22 Satz 4 dieses Gesetzes entfällt, auf die § 2 Abs. 2 dieses Gesetzes in der am 20. März 2013 geltenden Fassung i. V. m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist ⁷⁾	EUR je Anteil	-,-	-,-	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1g	Absetzung für Abnutzung oder Substanzverringerung	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
InvStG § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1h	Im Geschäftsjahr gezahlte Quellensteuer, vermindert um die erstattete Quellensteuer des Geschäftsjahres oder früherer Geschäftsjahre	EUR je Anteil	0,1415	0,1415	0,1415
	Betrag der nichtabziehbaren Werbungskosten i. S. d. § 3 Abs. 3 Satz 2 Nr. 2 InvStG i. d. F. vom 26. Juni 2013	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
	davon nichtabziehbare Werbungskosten auf Zinsen und sonstige Erträge	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
	davon nichtabziehbare Werbungskosten auf Dividenden nach § 8b KStG bzw. § 3 Nr. 40 EStG	EUR je Anteil	0,0000	0,0000	0,0000
	Sonstige Hinweise				
	In den steuerpflichtigen Erträgen enthaltene Zielfondserträge, die ausschließlich steuerlich zu berücksichtigen sind (Thesaurierungen und Zwischengewinne)	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	davon ausländische DBA befreite Einkünfte	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	davon Zinsen und sonstige Erträge	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	davon Dividenden nach § 8b KStG bzw. § 3 Nr. 40 EStG	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	Erstattete Quellensteuerrückvergütungen aus Vorjahren für Zinsen und sonstige Erträge	EUR je Anteil	-,-	-,-	-,-
	Erstattete Quellensteuerrückvergütungen aus Vorjahren für Dividenden nach § 8b KStG bzw. § 3 Nr. 40 EStG	EUR je Anteil	0,0041	0,0041	0,0041
	Tatsächlich abgezogene ausländische Quellensteuer auf Zinsen und sonstige Erträge	EUR je Anteil	0,0031	0,0031	0,0031
	Tatsächlich abgezogene ausländische Quellensteuer auf Dividenden nach § 8b KStG bzw. § 3 Nr. 40 EStG	EUR je Anteil	0,1425	0,1425	0,1425
	Datum des Ausschüttungsbeschlusses		15. August 2017		
	Ex-Tag		18. August 2017		
	Zahltag		18. August 2017		

¹⁾ Betrag, der dem Anleger tatsächlich gezahlt oder gutgeschrieben wird, einschließlich Kapitalertragsteuer nach § 7 Abs. 3 InvStG.

²⁾ Betrag, der dem Anleger tatsächlich gezahlt oder gutgeschrieben wird, einschließlich Kapitalertragsteuer nach § 7 Abs. 3 InvStG, jedoch vor Abzug der ausländischen Quellensteuer.

³⁾ Enthalten sind: Steuerbare Erträge vor Abzug der im Ausland einbehaltenen Quellensteuer. Ausschüttungsgleiche Erträge aus Vorjahren und Substanzbeträge sind nicht enthalten.

⁴⁾ Netto-Betrag der ausschüttungsgleichen Erträge, die dem Anleger als steuerbar zugeordnet werden, obwohl sie nicht ausgeschüttet werden. Kapitalertragsteuern, Solidaritätszuschlag, Zielfondserträge, die ausschließlich steuerlich zu berücksichtigen sind und steuerlich nicht abzugsfähige Werbungskosten sind hier abgezogen.

⁵⁾ Brutto-Betrag der ausschüttungsgleichen Erträge, die dem Anleger als steuerbar zugeordnet werden, obwohl sie nicht ausgeschüttet werden. Kapitalertragsteuern, Solidaritätszuschlag und ausländische Quellensteuern sind hier nicht abgezogen.

⁶⁾ Sämtliche Angaben erfolgen ohne Berücksichtigung der individuellen steuerlichen Situation des Anlegers. Bei Depotverwahrung und rechtzeitiger Vorlage einer NV-Bescheinigung des Finanzamtes oder eines Freistellungsauftrages erfolgt unter bestimmten Voraussetzungen entweder kein Einbehalt von den Steuerabzugsbeträgen oder eine ggf. teilweise Erstattung bereits einbehaltenen Steuer. Für die Anrechnung im Rahmen der Steuererklärung sind deshalb die Angaben in der Steuerbescheinigung maßgeblich.

⁷⁾ Die Anrechnung erfolgt gemäß § 34c EStG bzw. § 26 KStG auf den Teil der deutschen Einkommen- bzw. Körperschaftsteuer, der auf die ausländischen Einkünfte entfällt.

⁸⁾ Nicht in den Werten gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 f, aa enthalten.

Informationen der Verwaltung.

Das DekaBank Depot – Service rund um Ihre Investmentfonds –

Mit dem DekaBank Depot bieten wir Ihnen die kostengünstige Möglichkeit, verschiedene Investmentfonds Ihrer Wahl in einem einzigen Depot und mit einem Freistellungsauftrag verwahren zu lassen. Hierfür steht Ihnen ein Fondsuniversum von rund 1.000 Fonds der Deka-Gruppe und international renommierter Kooperationspartner zur Verfügung. Das Spektrum eignet sich zur Realisierung der unterschiedlichsten Anlagekonzepte. So können Sie zum Vermögensaufbau aus mehreren Alternativen wählen, unter anderem:

- Für Investmentfonds-Anleger, die regelmäßig sparen möchten, eignet sich der individuell zu gestaltende Deka-FondsSparplan ab einer Mindestanlage von 25,- Euro. Im Rahmen eines auf die eigenen Bedürfnisse abgestimmten Deka-Auszahlplans lässt sich das so aufgebaute Vermögen später gezielt nutzen.
- Für alle, die regelmäßig für ein Kind sparen möchten, ist der Deka-JuniorPlan besonders geeignet. Mit Beträgen ab monatlich 25,- Euro wird für den Vermögensaufbau chancenreich und breit gestreut in Investmentfonds angelegt und dank eines professionellen Anlagemanagements langfristig hohe Ertragsmöglichkeiten genutzt sowie Risiken im Vergleich zu Anlagen in Einzeltiteln spürbar reduziert.

- Für den systematischen und flexiblen Vermögensaufbau – insbesondere im Rahmen der privaten Altersvorsorge – können Sie zwischen verschiedenen Varianten wählen:

- **Deka-ZukunftsPlan:** Die individuelle Vorsorgelösung mit intelligentem Anlagekonzept – auch mit Riester-Förderung.
- **Deka-BonusRente:** Bietet Ihnen alle Vorteile einer Riester-Lösung und eröffnet zudem zusätzliche Renditechancen an den Wertpapiermärkten.
- **Deka-BasisRente:** Kombiniert als Rürup-Lösung die Vorteile einer staatlich geförderten Investmentanlage mit dem Wachstumspotenzial einer optimierten Vermögensstruktur.

Für die Auftragserteilung können Sie verschiedene Wege nutzen, z.B. Post, Telefon oder Internet über unsere Webpräsenz www.deka.de

Auskünfte rund um das DekaBank Depot und Fondsinformationen erhalten Sie über unser Service-Telefon unter der Nummer (0 69) 7147-652. Sie erreichen uns montags bis freitags von 8.00 Uhr bis 18.00 Uhr.

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.
(Stand: 31. Dezember 2016)

Alleingeschäftlerin

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Rüdiger

Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Landesbank Berlin Investment GmbH, Berlin;

Mitglied des Aufsichtsrates der Deka Immobilien GmbH, Frankfurt am Main

Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better

Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;

Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der Landesbank Berlin Investment GmbH, Berlin

und der

Deka Immobilien GmbH,
Frankfurt am Main

und der

Deka Immobilien Investment GmbH,
Frankfurt am Main

und der

WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH,
Düsseldorf

und der

S Broker AG & Co. KG,
Wiesbaden

Mitglied des Verwaltungsrates der DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A.,
Luxemburg

Mitglieder

Dr. Fritz Becker

Mitglied des Aufsichtsrates der Augsburger Aktienbank AG,
Augsburg

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsischen Sparkasse Dresden,
Dresden

und der

Sachsen-Finanzgruppe,
Dresden

Jörg Munning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse,
Münster

Heinz-Jürgen Schäfer
Offenbach

(Stand 9. Januar 2017)

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)

Thomas Ketter

Stellvertretender Vorsitzender des Verwaltungsrates der Deka International S.A.,
Luxemburg

und der

International Fund Management S.A.,
Luxemburg

und der

Dealis Fund Operations S.A.,
Luxemburg

Dr. Ulrich Neugebauer

Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,
Köln

und der

Sparkassen Pensionsfonds AG,
Köln

und der

Sparkassen Pensionskasse AG,
Köln

Michael Schmidt

Thomas Schneider

Mitglied des Aufsichtsrates der Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin

Steffen Selbach

Mitglied des Aufsichtsrates der bevestor GmbH,
Frankfurt am Main

(Stand 1. Januar 2017)

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Square
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Eigenkapital

gezeichnetes und eingezahltes

Kapital: EUR 447,9 Mio.

Eigenmittel: EUR 5.366 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2016)

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft
sowie Wertpapiergeschäft

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39
www.deka.de