

Deutsche Asset Management S.A.

Deutsche Bank Zins & Dividende

Halbjahresbericht 2018

Fonds Luxemburger Rechts



Hinweise für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Verkaufsprospekt, Verwaltungsreglement, „Wesentliche Anlegerinformationen“, Halbjahres- und Jahresberichte, Ausgabe- und Rücknahmepreise sind kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft sowie den Zahl- und Informationsstellen erhältlich.

Rücknahmeanträge können bei den deutschen Zahlstellen eingereicht werden. Sämtliche Zahlungen (Rücknahmeerlöse, etwaige Ausschüttungen und sonstige Zahlungen) werden durch die deutschen Zahlstellen an die Anleger ausgezahlt.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile sowie etwaige Mitteilungen an die Anteilinhaber werden grundsätzlich im Internet unter www.dws.de veröffentlicht. Sofern in einzelnen Fällen eine Veröffentlichung in einer Tageszeitung oder im Recueil Electronique des Sociétés et Associations (RESA) des Handels- und Firmenregisters in Luxemburg gesetzlich vorgeschrieben ist, erfolgt die Veröffentlichung in Deutschland im Bundesanzeiger.

Vertriebs-, Zahl- und Informationsstellen für Deutschland sind:

Deutsche Bank AG
Taunusanlage 12
D-60325 Frankfurt am Main
und deren Filialen

Deutsche Bank Privat- und Geschäftskunden AG
Theodor-Heuss-Allee 72
D-60486 Frankfurt am Main
und deren Filialen

Inhalt

Halbjahresbericht 2018
vom 1.1.2018 bis 30.6.2018

Hinweise	2
Halbjahresbericht Deutsche Bank Zins & Dividende	4
Vermögensaufstellung zum Halbjahresabschluss	6

Hinweise

Für den in diesem Bericht genannten Fonds gilt das Luxemburger Recht.

Wertentwicklung

Der Erfolg einer Investmentfondsanlage wird an der Wertentwicklung der Anteile gemessen. Als Basis für die Wertberechnung werden die Anteilwerte (=Rücknahmepreise) herangezogen, unter Hinzurechnung zwischenzeitlicher Ausschüttungen, die z. B. im Rahmen der Investmentkonten bei der Deutsche Asset Management S.A. kostenfrei reinvestiert werden. Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognosen für die Zukunft.

Darüber hinaus ist in dem Bericht auch der entsprechende Vergleichsindex – soweit vorhanden – dargestellt. Alle Grafik- und Zahlenangaben geben den **Stand vom 30. Juni 2018** wieder (sofern nichts anderes angegeben ist).

Verkaufsprospekte

Der Kauf von Fondsanteilen erfolgt auf Grundlage des zzt. gültigen Verkaufsprospekts und Verwaltungsreglements sowie des Dokuments „Wesentliche Anlegerinformationen“, ergänzt durch den jeweiligen letzten geprüften Jahresbericht und zusätzlich durch den jeweiligen Halbjahresbericht, falls ein solcher jüngerer Datums als der letzte Jahresbericht vorliegt.

Ausgabe- und Rücknahmepreise

Die jeweils gültigen Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie alle sonstigen Informationen für die Anteilinhaber können jederzeit am Sitz der Verwaltungsgesellschaft sowie bei den Zahlstellen erfragt werden. Darüber hinaus werden die Ausgabe- und Rücknahmepreise in jedem Vertriebsland in geeigneten Medien (z. B. Internet, elektronische Informationssysteme, Zeitungen, etc.) veröffentlicht.

Halbjahresbericht

Deutsche Bank Zins & Dividende

Deutsche Bank Zins & Dividende Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0791195471	-1,8%
Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.	
Stand: 30.6.2018 Angaben auf Euro-Basis	

Vermögensaufstellung zum Halbjahresabschluss

Deutsche Bank Zins & Dividende

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Börsengehandelte Wertpapiere						1 883 039 885,68	86,99	
Aktien								
Crown Resorts (AU000000CWN6)	Stück	520 532			AUD	13,5000	4 459 013,29	0,21
Flight Centre Travel Group (AU000000FLT9)	Stück	179 373			AUD	63,6500	7 244 577,21	0,33
Fortescue Metals Group (AU000000FMG4)	Stück	1 411 151			AUD	4,3900	3 930 932,38	0,18
Harvey Norman Holdings (AU000000HVN7).	Stück	989 091			AUD	3,3200	2 083 684,20	0,10
LendLease Group (AU000000LLC3)	Stück	404 894			AUD	19,8100	5 089 596,84	0,24
Canadian Imperial Bank of Commerce (CA1360691010) ³⁾	Stück	93 722	16 339		CAD	114,1100	6 945 007,74	0,32
Enbridge (CA29250N1050)	Stück	342 990		236 469	CAD	43,9000	9 778 077,15	0,45
The Toronto-Dominion Bank (CA8911605092)	Stück	172 472	172 472		CAD	75,7800	8 487 517,48	0,39
TransCanada (CA89353D1078) ³⁾	Stück	769 961	30 903		CAD	56,3500	28 175 402,53	1,30
Nestlé Reg. (CH0038863350)	Stück	319 751		35 267	CHF	76,4600	21 135 216,30	0,98
Novartis Reg. (CH0012005267).	Stück	477 203		149 236	CHF	74,8000	30 857 820,96	1,43
Swiss Life Holding Reg. (CH0014852781)	Stück	17 800			CHF	346,1000	5 325 766,16	0,25
Tryg (DK0060636678)	Stück	237 622			DKK	149,1000	4 754 448,92	0,22
Allianz (DE0008404005)	Stück	230 942	4 097	52 779	EUR	176,8400	40 839 783,28	1,89
BMW Ord. (DE0005190003)	Stück	69 336			EUR	77,9100	5 401 967,76	0,25
Deutsche Post Reg. (DE0005552004)	Stück	225 482	225 482		EUR	28,0400	6 322 515,28	0,29
Henkel Pref. (DE0006048432).	Stück	61 486	19 590		EUR	109,3000	6 720 419,80	0,31
ING Groep (NL0011821202)	Stück	422 088	422 088		EUR	12,4260	5 244 865,49	0,24
Jerónimo Martins, SGPS Port. Bear. (PTJMT0AE0001) . .	Stück	253 706			EUR	12,6150	3 200 501,19	0,15
Michelin Reg. (FR0000121261)	Stück	59 650	21 504		EUR	104,4500	6 230 442,50	0,29
Red Electrica Corporacion (ES0173093024)	Stück	224 218			EUR	17,5700	3 939 510,26	0,18
Royal Dutch Shell Cl. A (GB00B03MLX29)	Stück	1 193 133	627 742		EUR	29,8800	35 650 814,04	1,65
Sampo Bear. A (FI0009003305)	Stück	513 307	24 330		EUR	41,7700	21 440 833,39	0,99
Sanofi (FR0000120578)	Stück	96 045	11 582	126 907	EUR	69,3900	6 664 562,55	0,31
SCOR (FR0010411983)	Stück	125 993			EUR	31,7700	4 002 797,61	0,18
Siemens Reg. (DE0007236101)	Stück	160 170	37 860	26 088	EUR	113,2800	18 144 057,60	0,84
Total (FR0000120271)	Stück	518 943	518 943		EUR	52,4000	27 192 613,20	1,26
Unibail-Rodamco-Westfield (FR0013326246)	Stück	104 732	104 732		EUR	188,5000	19 741 982,00	0,91
Unilever (NL0000009355)	Stück	811 803		257 339	EUR	48,0250	38 986 839,08	1,80
UPM Kymmene Corp. Bear. (FI0009005987)	Stück	197 817			EUR	30,6800	6 069 025,56	0,28
VINCI (FR0000125486)	Stück	89 476	89 476		EUR	82,8400	7 412 191,84	0,34
BAE Systems (GB0002634946)	Stück	2 162 328	2 162 328		GBP	6,4760	15 821 077,99	0,73
BHP Billiton (GB0000566504)	Stück	336 644	405 382	68 738	GBP	17,1500	6 522 929,16	0,30
British American Tobacco (BAT) (GB0002875804)	Stück	422 740			GBP	39,0250	18 639 056,04	0,86
Compass Group (GB00BD6K4575)	Stück	299 147	299 147		GBP	16,2700	5 498 951,18	0,25
EasyJet (GB00B7KR2P84)	Stück	299 236			GBP	16,7650	5 667 937,57	0,26
Imperial Brands (GB0004544929)	Stück	670 291		187 357	GBP	28,3850	21 496 113,48	0,99
Legal & General Group (GB0005603997)	Stück	1 518 992			GBP	2,6550	4 556 461,15	0,21
Persimmon (GB0006825383)	Stück	164 826			GBP	25,3900	4 728 202,62	0,22
Reckitt Benckiser Group (GB00B24CGK77)	Stück	126 413		127 230	GBP	62,5600	8 935 032,52	0,41
TUI Reg. (DE000TUAG000)	Stück	348 717			GBP	16,7100	6 583 505,90	0,30
NWS Holdings (BMG668971101)	Stück	2 562 000			HKD	13,5800	3 806 164,57	0,18
Yue Yuen Industries (Holdings) (BMG988031446)	Stück	1 255 000			HKD	22,1500	3 041 067,94	0,14
Bridgestone Corp. (JP3830800003)	Stück	76 500	76 500		JPY	4 333,0000	2 569 470,18	0,12
KDDI Corp. (JP3496400007)	Stück	672 568		104 800	JPY	3 031,0000	15 802 128,66	0,73
mixi (JP3882750007).	Stück	82 200			JPY	2 804,0000	1 786 665,63	0,08
Nippon Telegraph and Telephone Corp. (JP3735400008). .	Stück	1 093 270	20 500	54 500	JPY	5 036,0000	42 678 250,61	1,97
Sekisui House (JP3420600003).	Stück	286 800			JPY	1 960,0000	4 357 412,50	0,20
Sumitomo Rubber Industries (JP3404200002)	Stück	296 400			JPY	1 760,0000	4 043 750,24	0,19
Tokio Marine Holdings Inc. (JP3910660004).	Stück	498 600	34 000		JPY	5 193,0000	20 070 770,90	0,93
DNB A (NO0010031479)	Stück	908 304			NOK	158,8000	15 206 789,05	0,70
Telenor (NO0010063308)	Stück	1 095 823	1 095 823		NOK	168,1500	19 426 433,68	0,90
Spark New Zealand (NZTELE0001S4)	Stück	1 864 265			NZD	3,7300	4 039 683,07	0,19
Atlas Copco Cl.A (SE0011166610)	Stück	119 659	222 262	102 603	SEK	259,6000	2 984 333,18	0,14
Epiroc Cl.A (SE0011166933)	Stück	102 603	102 603		SEK	93,4900	921 557,57	0,04
Swedbank (SE0000242455)	Stück	516 028	176 704		SEK	191,5500	9 496 261,68	0,44
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. (TW0002330008)	Stück	7 002 279		1 405 000	TWD	216,5000	42 794 873,16	1,98
3M Co. (US88579Y1010).	Stück	18 590	18 590		USD	195,9700	3 127 109,27	0,14
Altria Group (US02209S1033)	Stück	334 623		84 501	USD	57,2900	16 455 409,16	0,76

Deutsche Bank Zins & Dividende

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Automatic Data Processing (US0530151036)	Stück	63 569		7 902	USD	134,2500	0,34
Bank of America Corp. (US0605051046)	Stück	260 971	260 971		USD	28,6700	0,30
Chunghwa Telecom Sp. ADR (new) (US17133Q5027) ..	Stück	229 641			USD	35,8200	0,33
Cisco Systems (US17275R1023)	Stück	1 159 119	30 728	351 202	USD	42,9400	1,97
Cummins (US2310211063)	Stück	34 909			USD	133,2400	0,18
Dominion Energy (US25746U1097)	Stück	227 927		18 426	USD	68,4700	0,62
DowDuPont Reg. (US26078J1007)	Stück	410 097	57 741	37 919	USD	66,1500	1,08
Duke Energy (new) (US26441C2044)	Stück	215 865		56 203	USD	79,2300	0,68
Gap (US3647601083)	Stück	104 727			USD	33,5100	0,14
Honeywell International (US4385161066)	Stück	52 865	6 032		USD	143,1300	0,30
HP (US40434L1052)	Stück	1 128 611	326 205		USD	22,6700	1,01
Invesco (BMG491BT1088)	Stück	144 446			USD	26,5900	0,15
Johnson & Johnson (US4781601046)	Stück	104 701	69 221		USD	122,0000	0,51
Medtronic (IE00BTN1Y115)	Stück	98 612	98 612		USD	86,3300	0,34
Merck & Co. (US58933Y1055)	Stück	544 310		29 574	USD	60,3000	1,30
Microsoft Corp. (US5949181045)	Stück	93 791	72 610		USD	98,6300	0,37
Nextera Energy Inc. (US65339F1012)	Stück	342 692	11 876		USD	166,8100	2,27
Packaging Corp. of America (US6951561090)	Stück	47 171			USD	112,0800	0,21
PepsiCo (US7134481081)	Stück	425 777	14 214		USD	108,6800	1,83
Pfizer (US7170811035)	Stück	1 419 676	71 454		USD	36,3600	2,05
PG & E Corp. (US69331C1080)	Stück	161 900			USD	42,7100	0,27
Philip Morris International (US7181721090)	Stück	223 236			USD	81,6600	0,72
Principal Financial Group (US74251V1026)	Stück	77 656			USD	52,9700	0,16
Raytheon Co. (US7551115071)	Stück	124 178			USD	192,9200	0,95
The Coca-Cola Co. (US1912161007)	Stück	523 058	29 862		USD	43,4700	0,90
United Technologies Corp. (US9130171096)	Stück	101 629	33 366		USD	124,6000	0,50
Verizon Communications (US92343V1044)	Stück	702 867	61 694	65 484	USD	50,8600	1,42
Wells Fargo & Co. (US9497461015)	Stück	129 534	129 534		USD	53,6300	0,28
Verzinsliche Wertpapiere							
3,3750 % A.P.Møller-Mærsk 12/28.08.19							
MTN (XS0821175717)	EUR	6 867		4 433	%	104,1415	0,33
1,7500 % A.P.Møller-Mærsk 16/18.03.21							
MTN (XS1381693248) ³⁾	EUR	10 000			%	103,9440	0,48
0,7500 % ABN AMRO Bank 15/09.06.20 MTN							
(XS1244060486)	EUR	10 000			%	101,5550	0,47
2,5000 % Achmea 13/19.11.20 MTN (XS0995111761) ..	EUR	4 000			%	105,6730	0,20
1,5000 % Akelius Residential Property							
16/23.01.22 (XS1523975859)	EUR	3 100			%	102,2060	0,15
0,0000 % América Móvil/Koninklijke KPN							
15/28.05.20 (XS1238034695)	EUR	30 000			%	98,3620	1,36
1,1250 % APRR 14/15.01.21 MTN (FR0012300820) ..	EUR	2 000			%	102,5300	0,09
0,4260 % APRR 14/31.03.19 MTN (FR0011884899) ..	EUR	5 000			%	100,4190	0,23
0,3710 % APRR 15/03.01.20 MTN (FR0013054020) ..	EUR	10 000			%	100,7350	0,47
0,3210 % Asahi Group Holdings 17/19.09.21							
(XS1577953760)	EUR	5 000			%	100,0010	0,23
4,0000 % Banco Santander 13/24.01.20							
MTN (XS0877984459)	EUR	4 000			%	106,3020	0,20
1,6250 % Bank of America 15/14.09.22							
MTN (XS1290850707)	EUR	10 000			%	104,2510	0,48
0,4720 % Bank of America 17/07.02.22							
MTN (XS1560862580)	EUR	10 000			%	100,6520	0,46
1,0000 % Becton, Dickinson & Co. 16/15.12.22							
(XS1531345376)	EUR	10 000			%	100,0350	0,46
4,0000 % Bharti Airtel Int. (Netherlands)							
13/10.12.18 (XS0997979249)	EUR	5 000			%	101,5010	0,23
0,6250 % British Telecommunications 16/10.03.21							
MTN (XS1377680381)	EUR	6 000			%	101,0650	0,28
0,6250 % Commerzbank 15/14.03.19 S.854							
MTN (DE000CZ40K31)	EUR	10 000			%	100,5530	0,46
0,2010 % Daimler 16/14.01.19 MTN (DE000A169GZ7)	EUR	10 000			%	100,2030	0,46
5,0000 % Deutsche Bank 10/24.06.20 MTN							
(DE000DB5DCW6) ³⁾	EUR	10 000			%	105,4110	0,49
1,2500 % Deutsche Bank 14/08.09.21 MTN							
(DE000DB7XJB9)	EUR	19 900			%	99,1540	0,91
1,0000 % Deutsche Bank 16/18.03.19 MTN							
(DE000DL19SQ4)	EUR	10 000			%	100,3110	0,46
0,0210 % Deutsche Telekom Int. Finance							
16/03.04.20 MTN (XS1382791892)	EUR	5 000			%	100,3250	0,23
0,0000 % EDP Finance 08/12.11.23 MTN							
(XS0399353506)	EUR	7 950	7 950		%	93,4465	0,34
3,2500 % Energa Finance 13/19.03.20 MTN							
(XS0906117980)	EUR	7 150			%	105,3120	0,35
3,3750 % Glencore Finance (Europe) 13/30.09.20							
MTN (XS0974877150)	EUR	5 000			%	106,9700	0,25
1,2500 % Glencore Finance (Europe) 15/17.03.21							
MTN (XS1202846819)	EUR	10 000			%	101,9170	0,47

Deutsche Bank Zins & Dividende

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
0,3090 % Goldman Sachs Group 17/09.09.22 MTN (XS1577427526) ³⁾	EUR	10 000			% 99,8100	9 981 000,00	0,46
4,3750 % Intesa Sanpaolo 12/15.10.19 MTN (XS0842828120)	EUR	10 000			% 104,7370	10 473 700,00	0,48
1,0490 % Intesa Sanpaolo 17/15.03.23 (XS1577427872)	EUR	15 000	15 000		% 98,3130	14 746 950,00	0,68
0,4500 % Italy 16/01.06.21 (IT0005175598) ³⁾	EUR	30 000			% 98,2120	29 463 600,00	1,36
0,6500 % Italy B.T.P. 15/01.11.20 (IT0005142143)	EUR	18 320			% 99,4410	18 217 591,20	0,84
1,0000 % LeasePlan 16/08.04.20 MTN (XS1392460397)	EUR	7 000			% 101,5870	7 111 090,00	0,33
1,0000 % LeasePlan 16/24.05.21 MTN (XS1418631930)	EUR	8 000			% 101,2440	8 099 520,00	0,37
0,7500 % Lloyds Banking Group 16/09.11.21 MTN (XS1517181167) ³⁾	EUR	5 214			% 101,2450	5 278 914,30	0,24
2,3750 % Metropolitan Life Gl. Fdg. I 12/30.09.19 MTN (XS0834640541)	EUR	6 618			% 103,1220	6 824 613,96	0,32
2,7500 % Michelin Luxembourg 12/20.06.19 MTN (XS0794392588)	EUR	2 000			% 102,7760	2 055 520,00	0,09
0,3720 % Morgan Stanley 16/27.01.22 MTN (XS1511787407)	EUR	10 000			% 100,2310	10 023 100,00	0,46
3,2500 % Motability Operations Group 12/30.11.18 MTN (XS0742069643)	EUR	1 932			% 101,4430	1 959 878,76	0,09
1,2500 % Mylan 16/23.11.20 (XS1492457236)	EUR	10 000			% 102,2330	10 223 300,00	0,47
3,8750 % NASDAQ 13/07.06.21 (XS0942100388)	EUR	3 500			% 110,3340	3 861 690,00	0,18
1,8750 % Orange 13/03.09.18 MTN (FR0011560069) ..	EUR	6 000			% 100,3150	6 018 900,00	0,28
2,8750 % Origin Energy Finance 12/11.10.19 MTN (XS0841018004)	EUR	4 000			% 103,6320	4 145 280,00	0,19
2,0000 % Pernod-Ricard 14/22.06.20 (FR0011798115) ..	EUR	4 000			% 104,0240	4 160 960,00	0,19
3,8500 % Portugal 05/15.04.21 (PTOTEOE0007) ³⁾ ..	EUR	18 000			% 110,5520	19 899 360,00	0,92
0,6250 % RCI Banque 16/10.11.21 MTN (FR0013218153)	EUR	10 000			% 100,5700	10 057 000,00	0,46
0,3720 % Repsol International Finance 16/06.07.18 MTN (XS1442286008)	EUR	3 000			% 100,0010	3 000 030,00	0,14
0,5000 % Repsol International Finance 17/23.05.22 (XS1613140489) ³⁾	EUR	13 000			% 100,4110	13 053 430,00	0,60
1,6250 % Royal Bank of Scotland Group 14/25.06.19 MTN (XS1080952960)	EUR	9 610			% 101,5530	9 759 243,30	0,45
1,8750 % Ryanair 14/17.06.21 MTN (XS1077584024) ³⁾	EUR	4 000			% 104,4890	4 179 560,00	0,19
1,0000 % Santander Consumer Bank 16/25.02.19 MTN (XS1369254310)	EUR	10 000			% 100,7210	10 072 100,00	0,47
0,8750 % Santander UK 15/25.11.20 MTN (XS1325080890)	EUR	3 000			% 101,7500	3 052 500,00	0,14
0,3210 % Scentre Management 14/16.07.18 MTN (XS1087817422)	EUR	5 000			% 100,0180	5 000 900,00	0,23
4,7500 % SES 11/11.03.21 MTN (XS0600056641)	EUR	4 000			% 112,1520	4 486 080,00	0,21
1,6250 % Standard Chartered 13/20.11.18 MTN (XS0995417846)	EUR	4 000			% 100,7140	4 028 560,00	0,19
1,1250 % Telecom Italia 15/26.03.22 Cv (XS1209185161)	EUR	10 000			% 95,2560	9 525 600,00	0,44
2,5000 % Teollisuuden Voima 14/17.03.21 MTN (XS1043513529) ³⁾	EUR	15 000			% 104,5350	15 680 250,00	0,72
0,3750 % Teva Pharma. Finance Neth. II 16/25.07.20 (XS1439749109)	EUR	20 000			% 97,5730	19 514 600,00	0,90
5,1250 % Turkey 10/18.05.20 (XS0503454166)	EUR	5 000			% 104,4770	5 223 850,00	0,24
4,3500 % Turkey 13/12.11.21 (XS0993155398) ³⁾	EUR	20 000			% 103,6850	20 737 000,00	0,96
1,1250 % UBS (London Branch) 15/30.06.20 MTN (XS1254428540)	EUR	7 500			% 102,3290	7 674 675,00	0,35
0,1490 % Volvo Treasury 16/06.09.19 MTN (XS1485660895)	EUR	10 000			% 100,3280	10 032 800,00	0,46
1,6250 % Vonovia Finance 15/15.12.20 MTN (DE000A18V138)	EUR	2 000			% 103,7110	2 074 220,00	0,10
0,0000 % British Land (Jersey) 15/09.06.20 S. BLND (XS1242977889) ³⁾	GBP	25 000			% 96,1875	27 168 540,28	1,26
7,7500 % Imperial Brands Finance 09/24.06.19 MTN (XS0435179618)	GBP	5 000			% 106,2070	5 999 717,55	0,28
3,2500 % Baidu 13/06.08.18 (US056752AC24)	USD	970			% 100,0723	833 220,01	0,04
2,4500 % BNP Paribas 14/17.03.19 MTN (US05574LXH67)	USD	6 710			% 99,7114	5 743 032,15	0,27
3,3750 % China Overseas Finance (Cayman) III 13/29.10.18 (XS0984184316)	USD	1 980			% 100,0910	1 701 117,42	0,08
2,1500 % Citigroup 15/30.07.18 (US172967JW27)	USD	400			% 99,9760	343 265,09	0,02
4,3750 % Colombia 11/12.07.21 (US195325BN40)	USD	930			% 102,0250	814 448,50	0,04
2,7500 % Export-Import Bank of India 15/12.08.20 MTN (XS1165130219)	USD	2 010			% 97,9410	1 689 797,51	0,08

Deutsche Bank Zins & Dividende

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
7,2500 % Israel Electric 08/15.01.19 MTN Reg S (US46507NAA81)	USD	1 923		3 077	%	102,2130	1 687 172,52	0,08
6,8750 % Israel Electric 13/21.06.23 MTN Reg S (US46507NAE04)	USD	10 000			%	110,9760	9 525 836,91	0,44
2,8750 % Korea Gas 13/29.07.18 MTN Reg S (US50066CAF68)	USD	1 950			%	99,9916	1 673 678,63	0,08
2,6250 % Korea Western Power 14/22.09.19 MTN (XS1111470198)	USD	10 000			%	99,1960	8 514 678,11	0,39
4,8000 % Kuwait Projects 14/05.02.19 MTN (XS1026105806)	USD	940			%	100,7430	812 861,97	0,04
2,7500 % Latvia 12/12.01.20 Reg S (XS0863522149) . .	USD	3 470			%	99,4270	2 961 473,73	0,14
2,8000 % Morgan Stanley 15/16.06.20 MTN (US61761JB325)	USD	5 000			%	99,2297	4 258 785,67	0,20
5,5000 % Namibia 11/03.11.21 Reg S (XS0686701953)	USD	1 620			%	100,9580	1 403 879,48	0,06
3,6250 % Oman 16/15.06.21 Reg S (XS1405781342) ³⁾	USD	15 000			%	97,1050	12 502 789,70	0,58
3,5000 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) 13/18.07.18 MTN (US71654QBJ04)	USD	1 710			%	100,1060	1 469 367,04	0,07
5,2500 % PETRONAS Capital 09/12.08.19 Reg S (USY68856AH99)	USD	1 580			%	102,4396	1 389 309,60	0,06
6,5500 % Qatar 09/09.04.19 Reg S (XS0423038875) . .	USD	5 000			%	102,9670	4 419 184,55	0,20
2,3750 % Qatar 16/02.06.21 Reg S (XS1405781698) ³⁾	USD	5 000			%	96,7110	4 150 686,70	0,19
2,1250 % QNB Finance 16/07.09.21 MTN (XS1485745704)	USD	5 000			%	94,9030	4 073 090,13	0,19
6,4000 % Royal Bank of Scotland Group 09/21.10.19 (US780097AW11)	USD	10 000			%	103,7884	8 908 877,17	0,41
2,6250 % Sabic Capital II 13/03.10.18 (XS0971431613)	USD	6 710			%	99,9570	5 757 180,00	0,27
2,4000 % Standard Chartered 14/08.09.19 144a (US853254AS94)	USD	1 740			%	99,0903	1 479 975,30	0,07
6,2500 % Türkiye Garanti Bankası 11/20.04.21 Reg S (USM8931TAA71) ³⁾	USD	10 402			%	99,5500	8 888 575,97	0,41
5,3750 % Türkiye İhracat Kredi Bankası 16/08.02.21 Reg S (XS1345632811)	USD	5 000			%	97,2790	4 175 064,38	0,19
4,7500 % Ventas Realty 11/01.06.21 (US92276MAW55)	USD	10 000			%	103,1056	8 850 264,81	0,41
Sonstige Beteiligungswertpapiere								
Roche Holding Profitsh. (CH0012032048)	Stück	66 925	3 504	82 185	CHF	219,5500	12 702 298,47	0,59
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							95 235 081,65	4,40
Aktien								
BCE (new) (CA05534B7604)	Stück	568 394	26 628	55 878	CAD	53,5000	19 747 437,50	0,91
Verzinsliche Wertpapiere								
4,3750 % Ares Capital 13/15.01.19 Cv (US04010LAM54)	USD	10 000			%	100,6239	8 637 244,64	0,40
1,8000 % Bank of Montreal 15/31.07.18 MTN (US06366RU787)	USD	600			%	99,9528	514 778,17	0,02
1,9500 % Bank of Nova Scotia 16/15.01.19 (US064159HC38)	USD	600			%	99,6432	513 183,71	0,02
2,6750 % Becton, Dickinson & Co. 14/15.12.19 (US075887BE86)	USD	4 356			%	99,3495	3 714 733,05	0,17
4,7500 % Express Scripts Holding 13/15.11.21 (US30219GAE89)	USD	8 000			%	103,2927	7 093 062,52	0,33
6,0000 % Macquarie Group 10/14.01.20 MTN Reg S (US55608KAB17)	USD	5 000			%	104,0435	4 465 384,72	0,21
3,1500 % Mylan 17/15.06.21 (US62854AAM62)	USD	10 000			%	98,8017	8 480 835,02	0,39
3,5000 % Origin Energy Finance 13/09.10.18 Reg S (USQ7162LAE40)	USD	10 000			%	100,0627	8 589 075,97	0,40
2,7500 % Sinopec Group Overseas Develop. 14/10.04.19 Reg S (USG82003AC11)	USD	4 000			%	99,7308	3 424 233,82	0,16
3,0000 % Synchrony Financial 14/15.08.19 (US87165BAB99)	USD	5 000			%	99,8167	4 283 979,48	0,20
3,0000 % VEREIT 13/01.08.18 Cv (US02917TAA25) . .	USD	30 000			%	100,0779	25 771 133,05	1,19
Nicht notierte Wertpapiere							2 114 119,61	0,10
Verzinsliche Wertpapiere								
5,7500 % Motiva Enterprises 10/15.01.20 Reg S (USU61999AB13)	USD	2 387		2 378	%	103,1818	2 114 119,61	0,10

Deutsche Bank Zins & Dividende

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Investmentanteile						104 401 887,66	4,82
Gruppeneigene Investmentanteile						104 401 887,66	4,82
Deutsche Floating Rate Notes LC (LU0034353002) (0,200%)	Stück	650 000			EUR 84,0900	54 658 500,00	2,52
Deutsche Global Liquidity - Managed Euro Fund - Z (IE00BZ3FDF20) (0,000%)	Stück	283	6 253	10 332	EUR 9 904,2229	2 802 895,08	0,13
Deutsche Institutional Money plus IC (LU0099730524) (0,100%)	Stück	1 822	4 430	9 190	EUR 13 975,0700	25 462 577,54	1,18
Deutsche Invest I Euro High Yield Corporates LD (LU0616839766) (1,100%)	Stück	1			EUR 115,4600	76,55	0,00
Deutsche Invest I Multi Asset Income FC (LU1186220148) (0,600%)	Stück	139 475			EUR 103,6700	14 459 373,25	0,67
DGLS - Deutsche Managed Euro Ultra Short FI Fund (IE00B98GX142) (0,200%)	Stück	200			EUR 10 035,5000	2 007 100,00	0,09
DWS Emerging Markets Bonds (Short) LC (LU0599900635) (0,600%)	Stück	49 539			EUR 101,1600	5 011 365,24	0,23
Summe Wertpapiervermögen						2 084 790 974,60	96,31
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Aktienindex-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						2 529 380,97	0,12
Aktienindex-Terminkontrakte							
EURO STOXX 50 SEP 18 (EURX) EUR	Stück	-11 890				903 640,00	0,04
FTSE 100 INDEX SEP 18 (IPE) GBP	Stück	-2 630				166 623,14	0,01
TOPIX INDEX SEP 18 (OSE) JPY	Stück	-870 000				329 370,62	0,02
S&P500 EMINI SEP 18 (CME) USD	Stück	-24 700				1 129 747,21	0,05
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						-1 545 000,00	-0,07
Zinsterminkontrakte							
EURO-BOBL SEP 18 (EURX)	EUR	-250 000				-1 325 000,00	-0,06
EURO-SCHATZ SEP 18 (EURX)	EUR	-275 000				-220 000,00	-0,01
Devisen-Derivate						-1 149 623,16	-0,06
Devisenterminkontrakte (Verkauf)							
Offene Positionen							
AUD/EUR 28,95 Mio.						252 878,00	0,01
GBP/EUR 40,43 Mio.						425 666,42	0,02
JPY/EUR 2 551,46 Mio.						-88 720,31	0,00
USD/EUR 311,63 Mio.						-1 739 447,27	-0,08
Swaps						191 545,09	0,01
Credit Default Swaps							
Protection Seller							
iTraxx Europe 5 Years / 100 BP (CITIGR GM GB) 20.06.23 (OTC)	EUR	11 000				145 193,16	0,01
Total Return Swaps							
Swap 3MUSDLibor/JPTCUS98(JPM) 24.08.2017-24.08.2018 (OTC) ⁷⁾	USD	5 000				46 351,93	0,00

Deutsche Bank Zins & Dividende

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Bankguthaben						73 979 183,45	3,42
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	34 850 989,16			% 100	34 850 989,16	1,61
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	9 861 172,58			% 100	9 861 172,58	0,46
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Australische Dollar	AUD	2 611 438,59			% 100	1 657 056,75	0,08
Kanadische Dollar	CAD	2 259 880,53			% 100	1 467 550,19	0,07
Schweizer Franken	CHF	893 787,32			% 100	772 671,12	0,04
Hongkong Dollar	HKD	8 914 286,12			% 100	975 203,47	0,05
Japanische Yen	JPY	843 806 408,00			% 100	6 540 881,42	0,30
Südkoreanische Won	KRW	903 415 010,00			% 100	696 429,27	0,03
Neuseeländische Dollar	NZD	2 040 570,56			% 100	1 185 447,79	0,05
Singapur Dollar	SGD	102 330,52			% 100	64 458,14	0,00
Taiwanesisches Dollar	TWD	119 325 963,28			% 100	3 368 444,38	0,16
US Dollar	USD	14 607 794,25			% 100	12 538 879,18	0,58
Sonstige Vermögensgegenstände						8 637 527,01	0,40
Zinsansprüche	EUR	4 977 455,28			% 100	4 977 455,28	0,23
Dividendenansprüche	EUR	3 233 711,36			% 100	3 233 711,36	0,15
Quellensteueransprüche	EUR	342 987,97			% 100	342 987,97	0,02
Sonstige Ansprüche	EUR	83 372,40			% 100	83 372,40	0,00
Summe der Vermögensgegenstände 1)						2 170 807 155,54	100,28
Sonstige Verbindlichkeiten						-2 701 356,26	-0,13
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-2 415 780,32			% 100	-2 415 780,32	-0,11
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-285 575,94			% 100	-285 575,94	-0,01
Fondsvermögen						2 164 732 631,70	100,00
Anteilwert						100,05	
Umlaufende Anteile						21 637 005,817	

Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX	=	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
IPE	=	ICE Futures Europe
OSE	=	Osaka Securities Exchange - Options and Futures
CME	=	Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Options Market Division (IOM)
OTC	=	Over the Counter

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 29.06.2018

Australische Dollar	AUD	1,575950	=	EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,539900	=	EUR	1
Schweizer Franken	CHF	1,156750	=	EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,451850	=	EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,885100	=	EUR	1
Hongkong Dollar	HKD	9,140950	=	EUR	1
Japanische Yen	JPY	129,005000	=	EUR	1
Südkoreanische Won	KRW	1 297,210000	=	EUR	1
Norwegische Kronen	NOK	9,485150	=	EUR	1
Neuseeländische Dollar	NZD	1,721350	=	EUR	1
Schwedische Kronen	SEK	10,408850	=	EUR	1
Singapur Dollar	SGD	1,587550	=	EUR	1
Taiwanesisches Dollar	TWD	35,424650	=	EUR	1
US Dollar	USD	1,165000	=	EUR	1

Deutsche Bank Zins & Dividende

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft abgestimmt sind und sich so weit als möglich auf Marktparameter stützen. Diese Vorgehensweise unterliegt einem permanenten Kontrollprozess. Preisankünfte Dritter werden durch andere Preisquellen, modellhafte Rechnungen oder durch andere geeignete Verfahren auf Plausibilität geprüft.

Die in diesem Bericht ausgewiesenen Anlagen werden nicht zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

In Klammern sind die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Fondsvermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Fondsvermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile („Zielfonds“) hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein.

Fußnoten

- 1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.
- 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 115 526 729,25.
- 7) Swaps im Sinne der EU-Verordnung 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				0,1710 % Honeywell International 16/22.02.18 (XS1366026323)	EUR		1 400
Aktien				6,2500 % HSBC Holdings 08/19.03.18 MTN (XS0353643744)	EUR		5 000
Schaeffler Pref. (DE000SHA0159)	Stück		304 329	0,3210 % Nationwide Building Society 16/23.03.18 MTN (XS1385392888)	EUR		5 000
SES Cl.A FDR (LU0088087324)	Stück		203 066	0,5000 % Nationwide Building Society 16/29.10.19 MTN (XS1402175811)	EUR		5 000
Unibail-Rodamco (FR0000124711)	Stück		114 353	2,8750 % RCI Banque 13/22.01.18 MTN (XS0905797113)	EUR		5 000
Henderson Land Development Co. (HK0012000102)	Stück		886 000	0,7500 % UBS (London Branch) 08/18.04.18 MTN (XS0359388690)	EUR		3 500
HKT Trust and HKT (HK0000093390)	Stück		3 778 000	4,6250 % Teollisuuden Voima 12/04.02.19 MTN (XS0740810881)	EUR		4 000
The Wharf Holdings (HK0004000045)	Stück		572 000	6,0000 % UBS (London Branch) 08/18.04.18 MTN (XS0359388690)	EUR		3 500
Wharf Real Estate Investment Co. (KYG9593A1040)	Stück		572 000	0,4300 % WPP Finance 2013 15/23.03.18 MTN (XS1205534297)	EUR		4 000
ITOCHU Corp. (JP3143600009)	Stück		350 000				
Subaru (JP3814800003)	Stück		152 700				
Atlas Copco Cl.A (Free) (SE0006886750)	Stück	102 603	102 603	2,5000 % Abu Dhabi National Energy 12/12.01.18 Reg S (XS0863523972) . . .	USD		5 000
Atlas Copco Red. Shares Cl.A (SE0011166636)	Stück	102 603	102 603	6,8750 % Bank of America 08/25.04.18 MTN (US59018YN641)	USD		400
AT & T (US00206R1023)	Stück		492 705	2,6250 % Bestgain Real Estate 13/13.03.18 Reg S (XS0898415004)	USD		1 780
Helmerich & Payne (US4234521015)	Stück		94 350	6,8750 % CITIC 12/21.01.18 MTN (XS0758793342)	USD		900
Kohl's Corp. (US5002551043)	Stück		81 454	6,1500 % Goldman Sachs Group 08/01.04.18 (US38141GFM15)	USD		600
Macy's (US55616P1049)	Stück		81 454	5,6250 % Israel Electric 13/21.06.18 MTN Reg S (US46507NAD21)	USD		1 620
Target Corp. (US87612E1064)	Stück		155 465	3,1250 % Itau Corpbanca 13/15.01.18 (US21987AAB61)	USD		3 500
The Procter & Gamble (US7427181091)	Stück	14 574	92 306	2,0000 % KEB Hana Bank 13/02.04.18 MTN (XS0907884422)	USD		2 000
Verzinsliche Wertpapiere				6,6250 % Morgan Stanley 08/04.01.18 MTN (US6174466Q77)	USD		600
0,0510 % Anheuser-Busch InBev 14/29.03.18 MTN (BE6265140077)	EUR		1 500	2,5000 % ONGC Videsh 13/07.05.18 (XS0927643030)	USD		1 750
0,5000 % Commerzbank 15/03.04.18 S.843 MTN (DE000CZ40KN6)	EUR		4 000	2,1250 % QNB Finance 12/14.02.18 MTN (XS0854469599)	USD		6 760
0,2750 % Covestro 16/10.03.18 MTN (XS1377821464)	EUR		1 764	0,0000 % Shizuoka Bank 13/25.04.18 Cv (XS0914326417)	USD		7 700
0,1210 % Credit Suisse (London Branch) 16/19.02.18 MTN (XS1366341433)	EUR		5 000	1,7500 % State Grid Overseas Investment 13/22.05.18 Reg S (USG8449VAA47) . . .	USD		2 000
2,1250 % Daimler 12/27.06.18 MTN (DE000A1PGQY7)	EUR		1 250	3,3750 % Tencent Holdings 12/05.03.18 Reg S (USG87572AD85)	USD		1 700
0,5710 % Deutsche Bank 16/13.04.18 MTN (DE000DL19SS0)	EUR		13 000				
1,0000 % Eastern Creation II Inv. Holdings 15/13.03.18 MTN (XS1198095686)	EUR		2 000				
4,6250 % Glencore Finance (Europe) 12/03.04.18 MTN (XS0767815599)	EUR		4 000				

Deutsche Bank Zins & Dividende

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------------	--------------------------	-----------------------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,7500	% CNOOC Finance 2013 13/09.05.18 (US12625GAB05)	USD	3 100
1,9500	% CNPC General Capital 13/16.04.18 Reg S (USG22004AD07)	USD	1 760
2,3750	% Ford Motor Credit 13/16.01.18 (US34540UAA79)	USD	600
2,3750	% Freeport-McMoRan 13/15.03.18 (US35671DBD66)	USD	5 000
5,7500	% Oracle 08/15.04.18 (US68389XAC92) ..	USD	400

Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumina der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Volumen in 1000

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: Euro STOXX 50 Price Euro, FTSE 100 Index, S&P 500 Index, Tokyo Stock Price (TOPIX) Index)	EUR	137 160
---	-----	---------

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BOBL JUN 18, EURO-SCHATZ JUN 18)	EUR	633 403
--	-----	---------

Devisenterminkontrakte

Kauf von Devisen auf Termin

EUR/GBP	EUR	203 541
EUR/USD	EUR	262 614

Verkauf von Devisen auf Termin

EUR/GBP	EUR	450 781
---------	-----	---------

Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes)

unbefristet

Volumen in 1000

EUR 586 347

Gattung: 1,7500 % A.P.Møller-Mærsk 16/18.03.21
MTN (XS1381693248), 1,5000 % Akelius Residential
Property 16/23.01.22 (XS1523975859), 1,1250 % APRR
14/15.01.21 MTN (FR0012300820), 0,4720 % Bank of
America 17/07.02.22 MTN (XS1560862580), 1,0000 %
Becton, Dickinson & Co. 16/15.12.22 (XS1531345376),
4,0000 % Bharti Airtel Int. (Netherlands) 13/10.12.18
(XS0997979249), 0,6250 % British Telecommunications
16/10.03.21 MTN (XS1377680381), 0,6250 % Commerzbank
15/14.03.19 S.854 MTN (DE000CZ40K31), 0,1210 % Credit
Suisse (London Branch) 16/19.02.18 MTN (XS1366341433),
5,0000 % Deutsche Bank 10/24.06.20 MTN (DE000DB5DCW6),
1,2500 % Deutsche Bank 14/08.09.21 MTN (DE000DB7XJB9),
1,0000 % Deutsche Bank 16/18.03.19 MTN (DE000DL19SQ4),
0,3090 % Goldman Sachs Group 17/09.09.22 MTN
(XS1577427526), 6,2500 % HSBC Holdings 08/19.03.18
MTN (XS0353643744), 4,3750 % Intesa Sanpaolo 12/15.10.19
MTN (XS0842828120), 1,0000 % LeasePlan 16/24.05.21
MTN (XS1418631930), 0,7500 % Lloyds Banking Group
16/09.11.21 MTN (XS1517181167), 2,7500 % Michelin
Luxembourg 12/20.06.19 MTN (XS0794392588), 1,2500 % Mylan
16/23.11.20 (XS1492457236), 3,8500 % Portugal 05/15.04.21
(PTOTEOE0007), 0,5000 % Repsol International Finance
17/23.05.22 (XS1613140489), 1,0000 % Santander Consumer
Bank 16/25.02.19 MTN (XS1369254310), 4,7500 % SES
11/11.03.21 MTN (XS0600056641), 1,1250 % Telecom Italia
15/26.03.22 Cv (XS1209185161), 2,5000 % Teollisuuden Voima
14/17.03.21 MTN (XS1043513529), 0,3750 % Teva Pharma.
Finance Neth. II 16/25.07.20 (XS1439749109), 5,1250 %
Turkey 10/18.05.20 (XS0503454166), 4,3500 % Turkey
13/12.11.21 (XS0993155398), 0,0000 % British Land (Jersey)
15/09.06.20 S. BLND (XS1242977889), BCE (new)
(CA05534B7604), Enbridge (CA29250N1050), Gap
(US3647601083), Helmerich & Payne (US4234521015),
Novartis Reg. (CH0012005267), Royal Dutch Shell Cl.
A (GB00B03MLX29), Sanofi (FR0000120578), SES Cl.A
FDR (LU0088087324), Target Corp. (US87612E1064), The
Toronto-Dominion Bank (CA8911605092), TransCanada
(CA89353D1078), Unilever (NL0000009355), 4,3750 %
Colombia 11/12.07.21 (US195325BN40), 5,6250 % Israel
Electric 13/21.06.18 MTN Reg S (US46507NAD21), 5,5000 %
Namibia 11/03.11.21 Reg S (XS0686701953), 3,6250 % Oman
6/15.06.21 Reg S (XS1405781342), 5,2500 % PETRONAS
Capital 09/12.08.19 Reg S (USY68856AH99), 6,5500 % Qatar
09/09.04.19 Reg S (XS0423038875), 2,3750 % Qatar
16/02.06.21 Reg S (XS1405781698), 6,2500 % Türkiye Garanti
Bankasi 11/20.04.21 Reg S (USM8931TAA71), 5,3750 % Türkiye
İhracat Kredi Bankasi 16/08.02.21 Reg S (XS1345632811)

Deutsche Bank Zins & Dividende

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (WpFinGesch.) und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
	1. Verwendete Vermögensgegenstände		
absolut	115 526 729,25	-	46 351,93
in % des Fondsvermögens	5,34	-	0,00
	2. Die 10 größten Gegenparteien		
1. Name	Société Générale S.A.		J.P. Morgan Securities PLC
Bruttovolumen offene Geschäfte	33 743 652,19		46 351,93
Sitzstaat	Frankreich		Großbritannien (ohne Guernsey, Jersey, Insel Man)
2. Name	BNP Paribas S.A., Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	29 463 600,00		
Sitzstaat	Frankreich		
3. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	18 572 736,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
4. Name	Deutsche Bank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	16 589 563,09		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
5. Name	Citigroup Global Markets Ltd., London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	6 682 047,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	UniCredit Bank AG		
Bruttovolumen offene Geschäfte	6 596 475,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
7. Name	Morgan Stanley & Co. International PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	2 841 805,97		
Sitzstaat	Großbritannien		
8. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 036 850,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

Deutsche Bank Zins & Dividende

10. Name

Bruttovolumen
offene Geschäfte

Sitzstaat

3. Art(en) von Abwicklung und Clearing

(z.B. zweiseitig, dreiseitig,
zentrale Gegenpartei)

zweiseitig	-	zweiseitig
------------	---	------------

4. Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag

1 Tag bis 1 Woche

1 Woche bis 1 Monat

1 bis 3 Monate

3 Monate bis 1 Jahr

über 1 Jahr

unbefristet

-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	46 351,93
-	-	-
-	-	-
115 526 729,25	-	-

5. Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten

Bankguthaben

Schuldverschreibungen

Aktien

Sonstige

Art(en):		
-	-	300 000,00 *)
82 065 677,57	-	-
39 477 622,27	-	-
598 454,38	-	-
Qualität(en):		
Dem Fonds werden – soweit Wertpapier-Darlehensgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte oder Geschäfte mit OTC-Derivaten (außer Währungstermingeschäften) abgeschlossen werden - Sicherheiten in einer der folgenden Formen gestellt: - liquide Vermögenswerte wie Barmittel, kurzfristige Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente gemäß Definition in Richtlinie 2007/16/EG vom 19. März 2007, Akkreditive und Garantien auf erstes Anfordern, die von erstklassigen, nicht mit dem Kontrahenten verbundenen Kreditinstituten ausgegeben werden, beziehungsweise von einem OECD-Mitgliedstaat oder dessen Gebietskörperschaften oder von supranationalen Institutionen und Behörden auf kommunaler, regionaler oder internationaler Ebene begebene Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit - Anteile eines in Geldmarktinstrumente anlegenden Organismus für gemeinsame Anlagen (nachfolgend „OGA“), der täglich einen Nettoinventarwert berechnet und der über ein Rating von AAA oder ein vergleichbares Rating verfügt - Anteile eines OGAW, der vorwiegend in die unter den nächsten beiden Gedankenstrichen aufgeführten Anleihen / Aktien anlegt - Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit, die ein Mindestrating von niedrigem Investment-Grade aufweisen - Aktien, die an einem geregelten Markt eines Mitgliedstaats der Europäischen Union oder an einer Börse eines OECD-Mitgliedstaats zugelassen sind oder gehandelt werden, sofern diese Aktien in einem wichtigen Index enthalten sind. Die Verwaltungsgesellschaft behält sich vor, die Zulässigkeit der oben genannten Sicherheiten einzuschränken. Des Weiteren behält sich die Verwaltungsgesellschaft vor, in Ausnahmefällen von den oben genannten Kriterien abzuweichen. Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds/Teilfonds.		

Deutsche Bank Zins & Dividende

6. Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten	
Währung(en):	EUR; USD; GBP; JPY; NZD; CHF - EUR *)
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)	
unter 1 Tag	- - -
1 Tag bis 1 Woche	- - -
1 Woche bis 1 Monat	- - -
1 bis 3 Monate	- - -
3 Monate bis 1 Jahr	- - -
über 1 Jahr	- - -
unbefristet	122 141 754,22 - 300 000,00 *)
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)	
Ertragsanteil des Fonds	
absolut	200 607,27 - -35 261,31
in % der Bruttoerträge	60,00 - 100,00
Kostenanteil des Fonds	- - -
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft	
absolut	133 737,87 - -
in % der Bruttoerträge	40,00 - -
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	- - -
Ertragsanteil Dritter	
absolut	- - -
in % der Bruttoerträge	- - -
Kostenanteil Dritter	- - -
9. Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps	
absolut	- - -
10. Verleihe Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds	
Summe	115 526 729,25
Anteil	5,54
11. Die 10 größten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps	
1. Name	French Republic
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	31 380 143,30
2. Name	Peugeot S.A.
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	22 116 693,51

Deutsche Bank Zins & Dividende

3. Name	Brandenburg, Land		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9 250 722,97		
4. Name	European Stability Mechanism (ESM)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	6 824 451,69		
5. Name	Työttömyysvakuutusrahasto (TVR)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5 118 106,38		
6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 758 175,00		
7. Name	European Financial Stability Facility (EFSF)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 318 627,66		
8. Name	European Union		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 206 030,65		
9. Name	Hessen, Land		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2 913 717,00		
10. Name	Bpifrance Financement S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2 769 873,03		

12. Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps

Anteil	-
---------------	---

13. Verwahrart begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps (In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps)

gesonderte Konten / Depots	-	-
Sammelkonten / Depots	-	-
andere Konten / Depots	-	-
Verwahrart bestimmt Empfänger	-	100

Deutsche Bank Zins & Dividende

14. Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	1
1. Name	State Street Bank		State Street Bank
verwahrter Betrag absolut	98 556 413,73		300 000,00 *)
2. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	23 585 340,49		

**Verwaltungsgesellschaft, Zentralverwaltung,
Transferstelle, Registerstelle und
Hauptvertriebsstelle**

Deutsche Asset Management S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg
Eigenkapital per 31.12.2017: 285,7 Mio. Euro
vor Gewinnverwendung

Aufsichtsrat

Holger Naumann
Vorsitzender
Deutsche Asset Management
Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Nathalie Bausch (bis zum 31.1.2018)
Deutsche Bank Luxembourg S.A.,
Luxemburg

Yves Dermaux (bis zum 5.6.2018)
Deutsche Bank AG,
London

Stefan Kreuzkamp
Deutsche Asset Management
Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Frank Krings
Deutsche Bank Luxembourg S.A.,
Luxemburg

Dr. Matthias Liermann
Deutsche Asset Management
Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Vorstand

Manfred Bauer
Vorsitzender
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg

Nathalie Bausch (seit dem 1.2.2018)
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg

Ralf Rauch (bis zum 30.4.2018)
Deutsche Asset Management
Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Barbara Schots
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg

Abschlussprüfer

KPMG Luxembourg
Société coopérative
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Verwahrstelle

State Street Bank Luxembourg S.C.A.
49, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Fondsmanager

Deutsche Asset Management
Investment GmbH
Mainzer Landstraße 11-17
D-60329 Frankfurt am Main

Vertriebs-, Zahl- und Informationsstelle

LUXEMBURG
Deutsche Bank Luxembourg S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg

Deutsche Asset Management S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg
Tel.: +352 4 21 01-1
Fax: +352 4 21 01-9 00

