

Deutsche Asset Management S.A.

---

# Deutsche Floating Rate Notes

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](http://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<br>Deutsche Floating Rate Notes ..... | 4  |
| Vermögensaufstellung zum Halbjahresabschluss .....      | 6  |
| TER für Anleger in der Schweiz .....                    | 26 |

# 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 Floating Rate Notes

| Deutsche Floating Rate Notes<br>Wertentwicklung der Anteilklassen (in Euro) |              |                     |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------|---------------------|
| Anteilklasse                                                                | ISIN         | 6 Monate            |
| Klasse LC                                                                   | LU0034353002 | -0,5%               |
| Klasse FC                                                                   | LU1534068801 | -0,4%               |
| Klasse FD                                                                   | LU1644422419 | -0,4%               |
| Klasse IC                                                                   | LU1534073041 | -0,4%               |
| Klasse LD                                                                   | LU1122765560 | -0,5%               |
| Klasse TFC                                                                  | LU1673806201 | -0,4% <sup>1)</sup> |
| Klasse TFD                                                                  | LU1673810575 | -0,4% <sup>1)</sup> |

<sup>1)</sup> Klassen TFC und TFD aufgelegt am 2.1.2018

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft. Stand: 30.6.2018

# Vermögensaufstellung zum Halbjahresabschluss

# Deutsche Floating Rate Notes

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

| Wertpapierbezeichnung                                                                              | Stück<br>bzw. Wgh.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR   | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-------------------------|-----------------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>                                                                |                               |         |                                          |                      |            | <b>7 027 409 164,89</b> | <b>64,50</b>                      |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                                                    |                               |         |                                          |                      |            |                         |                                   |
| 0,0000 % 3M 15/15.05.20 MTN (XS1234366448) . . . . .                                               | EUR                           | 3 000   |                                          |                      | % 100,4600 | 3 013 800,00            | 0,03                              |
| 0,0720 % A.N.Z. Banking Group 14/28.10.19<br>MTN (XS1130526780) . . . . .                          | EUR                           | 12 000  |                                          |                      | % 100,4050 | 12 048 600,00           | 0,11                              |
| 0,4790 % ABN AMRO Bank 14/06.03.19 MTN<br>(XS1040422526) <sup>3)</sup> . . . . .                   | EUR                           | 12 000  |                                          |                      | % 100,4910 | 12 058 920,00           | 0,11                              |
| 0,0990 % ABN AMRO Bank 15/11.03.20 MTN<br>(XS1199643427) . . . . .                                 | EUR                           | 8 500   |                                          |                      | % 100,4320 | 8 536 720,00            | 0,08                              |
| 0,1710 % ABN AMRO Bank 16/14.01.19 MTN<br>(XS1344520728) . . . . .                                 | EUR                           | 15 000  |                                          |                      | % 100,2470 | 15 037 050,00           | 0,14                              |
| 0,0000 % Akzo Nobel 17/08.11.19 MTN<br>(XS1715353105) <sup>3)</sup> . . . . .                      | EUR                           | 7 800   |                                          |                      | % 100,2800 | 7 821 840,00            | 0,07                              |
| 0,2290 % Alfa Laval Treasury International<br>14/12.09.19 MTN (XS1108681625) . . . . .             | EUR                           | 20 800  |                                          |                      | % 100,3790 | 20 878 832,00           | 0,19                              |
| 0,0290 % Allergan Funding 17/01.06.19<br>(XS1622634126) . . . . .                                  | EUR                           | 28 287  | 9 927                                    |                      | % 100,0750 | 28 308 215,25           | 0,26                              |
| 0,1780 % Allianz Finance II 17/07.12.20<br>MTN (DE000A19S4T0) . . . . .                            | EUR                           | 26 800  | 14 700                                   |                      | % 101,0170 | 27 072 556,00           | 0,25                              |
| 5,1250 % America Móvil 13/06.09.73 Cl.A<br>(XS0969340768) . . . . .                                | EUR                           | 24 430  |                                          |                      | % 100,7570 | 24 614 935,10           | 0,23                              |
| 0,0790 % American Honda Finance 15/11.03.19<br>MTN (XS1288342147) . . . . .                        | EUR                           | 26 335  | 8 000                                    |                      | % 100,2150 | 26 391 620,25           | 0,24                              |
| 0,0000 % Anheuser-Busch InBev 15/19.10.18<br>MTN (BE6276038419) . . . . .                          | EUR                           | 7 660   |                                          |                      | % 100,0730 | 7 665 591,80            | 0,07                              |
| 0,4290 % Anheuser-Busch InBev 16/17.03.20<br>MTN (BE6285450449) . . . . .                          | EUR                           | 20 770  |                                          |                      | % 101,0480 | 20 987 669,60           | 0,19                              |
| 0,4260 % APRR 14/31.03.19 MTN (FR0011884899) . . . . .                                             | EUR                           | 23 800  |                                          |                      | % 100,4190 | 23 899 722,00           | 0,22                              |
| 0,3710 % APRR 15/03.01.20 MTN (FR0013054020) . . . . .                                             | EUR                           | 28 500  |                                          |                      | % 100,7350 | 28 709 475,00           | 0,26                              |
| 0,1770 % Archer Daniels Midland 15/24.06.19<br>(XS1249494086) . . . . .                            | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,3120 | 20 062 400,00           | 0,18                              |
| 0,2590 % AT & T 14/04.06.19 (XS1144084099) . . . . .                                               | EUR                           | 32 000  | 7 000                                    |                      | % 100,3660 | 32 117 120,00           | 0,29                              |
| 0,5290 % AT & T 18/05.09.23 Reg S (XS1778824885) . . . . .                                         | EUR                           | 22 160  | 22 160                                   |                      | % 101,1250 | 22 409 300,00           | 0,21                              |
| 0,1740 % B.A.T. Capital 17/16.08.21 MTN<br>(XS1664643746) . . . . .                                | EUR                           | 34 430  |                                          |                      | % 99,8790  | 34 388 339,70           | 0,32                              |
| 0,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria<br>16/25.11.18 (ES03132111Q7) . . . . .                   | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,0770 | 10 007 700,00           | 0,09                              |
| 0,2710 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria<br>17/12.04.22 MTN (XS1594368539) . . . . .               | EUR                           | 10 800  |                                          |                      | % 100,0900 | 10 809 720,00           | 0,10                              |
| 0,2790 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria<br>18/09.03.23 MTN (XS1788584321) <sup>3)</sup> . . . . . | EUR                           | 32 100  | 32 100                                   |                      | % 98,1170  | 31 495 557,00           | 0,29                              |
| 0,6970 % Banco Santander 17/21.03.22<br>MTN (XS1578916261) <sup>3)</sup> . . . . .                 | EUR                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,8390 | 25 209 750,00           | 0,23                              |
| 0,3420 % Bank China (Luxembourg Branch) 17/20.04.20<br>MTN (XS1599275630) . . . . .                | EUR                           | 10 000  | 10 000                                   |                      | % 100,3920 | 10 039 200,00           | 0,09                              |
| 0,5290 % Bank of America 15/14.09.20<br>MTN (XS1290851184) <sup>3)</sup> . . . . .                 | EUR                           | 13 000  |                                          |                      | % 101,2710 | 13 165 230,00           | 0,12                              |
| 0,1720 % Bank of America 16/26.07.19<br>MTN (XS1458405112) . . . . .                               | EUR                           | 19 570  |                                          |                      | % 100,3990 | 19 648 084,30           | 0,18                              |
| 0,4720 % Bank of America 17/07.02.22<br>MTN (XS1560862580) <sup>3)</sup> . . . . .                 | EUR                           | 22 640  |                                          |                      | % 100,6520 | 22 787 612,80           | 0,21                              |
| 0,0470 % Bank of America 17/21.09.21<br>MTN (XS1687279841) . . . . .                               | EUR                           | 18 000  |                                          |                      | % 99,7380  | 17 952 840,00           | 0,16                              |
| 0,3720 % Bank of America 18/25.04.24<br>MTN (XS1811433983) <sup>3)</sup> . . . . .                 | EUR                           | 30 000  | 30 000                                   |                      | % 99,4430  | 29 832 900,00           | 0,27                              |
| 0,1710 % Bank of China (Luxembourg Branch)<br>18/17.04.21 MTN (XS1804840517) . . . . .             | EUR                           | 37 040  | 37 040                                   |                      | % 100,0660 | 37 064 446,40           | 0,34                              |
| 0,1440 % Bank of China (Paris Branch)<br>17/22.11.20 MTN (XS1720540217) . . . . .                  | EUR                           | 18 000  |                                          |                      | % 99,9420  | 17 989 560,00           | 0,17                              |
| 0,1770 % Bank of Montreal 17/28.09.21<br>MTN (XS1691466756) . . . . .                              | EUR                           | 47 100  |                                          |                      | % 100,5290 | 47 349 159,00           | 0,43                              |
| 0,1790 % Bank of Montreal 18/14.03.22<br>MTN (XS1791326728) . . . . .                              | EUR                           | 50 000  | 50 000                                   |                      | % 100,4680 | 50 234 000,00           | 0,46                              |
| 0,1790 % Bank of Montreal 18/15.06.20<br>MTN (XS1838936703) . . . . .                              | EUR                           | 14 500  | 14 500                                   |                      | % 100,5435 | 14 578 807,50           | 0,13                              |
| 0,0590 % Bank of Nova Scotia 15/10.09.18<br>MTN (XS1288483123) . . . . .                           | EUR                           | 18 000  |                                          |                      | % 100,0650 | 18 011 700,00           | 0,17                              |
| 0,0510 % Bank of Nova Scotia 15/14.01.20<br>MTN (XS1166454915) . . . . .                           | EUR                           | 29 000  |                                          |                      | % 100,3760 | 29 109 040,00           | 0,27                              |
| 0,1710 % Bank of Nova Scotia 18/03.04.20<br>MTN (XS1800324441) . . . . .                           | EUR                           | 38 000  | 38 000                                   |                      | % 100,6590 | 38 250 420,00           | 0,35                              |
| 0,3970 % Banque Fédérative Crédit Mu.<br>14/20.03.19 MTN (XS1046498157) . . . . .                  | EUR                           | 19 500  |                                          |                      | % 100,4660 | 19 590 870,00           | 0,18                              |
| 0,0000 % Banque Fédérative Crédit Mu.<br>15/28.08.18 MTN (XS1281799681) . . . . .                  | EUR                           | 18 000  |                                          |                      | % 99,9540  | 17 991 720,00           | 0,17                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                 | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|-----------------------------------|
| 0,1490 % Banque Fédérative Crédit Mu.<br>16/03.06.20 MTN (XS1426782170) <sup>3)</sup> | EUR                           | 35 000  |                                          |                      | % 100,6050 | 35 211 750,00         | 0,32                              |
| 0,1470 % Barclays Bank 01/22.03.21 MTN<br>(XS0126504421)                              | EUR                           | 4 570   |                                          |                      | % 96,7590  | 4 421 886,30          | 0,04                              |
| 0,1220 % Barclays Bank 17/05.07.19 MTN<br>(XS1570778214)                              | EUR                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,3500 | 30 105 000,00         | 0,28                              |
| 0,0790 % Barclays Bank 17/13.03.19 MTN<br>(XS1578083625)                              | EUR                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,2040 | 30 061 200,00         | 0,28                              |
| 0,1290 % Barclays Bank 17/15.09.20 MTN<br>(XS1620536042)                              | EUR                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,3830 | 30 114 900,00         | 0,28                              |
| 0,1210 % Barclays Bank 18/17.01.20 MTN<br>(XS1683852930)                              | EUR                           | 50 000  | 50 000                                   |                      | % 100,3670 | 50 183 500,00         | 0,46                              |
| 0,0000 % BASF 17/15.11.19 MTN (XS1718416586)                                          | EUR                           | 63 160  |                                          |                      | % 100,3240 | 63 364 638,40         | 0,58                              |
| 0,2270 % Bayer Capital 18/26.06.22<br>(XS1840614736) <sup>3)</sup>                    | EUR                           | 16 400  | 16 400                                   |                      | % 100,3530 | 16 457 892,00         | 0,15                              |
| 0,3210 % BMW Finance 16/15.07.19 MTN<br>(XS1363560548)                                | EUR                           | 13 120  |                                          |                      | % 100,5100 | 13 186 912,00         | 0,12                              |
| 0,0000 % BMW Finance 17/22.11.19 MTN<br>(XS1618349804)                                | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,2600 | 10 026 000,00         | 0,09                              |
| 0,0000 % BMW Finance 17/28.12.18 MTN<br>(XS1638160918)                                | EUR                           | 33 000  |                                          |                      | % 100,1220 | 33 040 260,00         | 0,30                              |
| 0,0590 % BMW US Capital 15/18.03.19 MTN<br>(DE000A1Z6M04)                             | EUR                           | 13 530  |                                          |                      | % 100,1770 | 13 553 948,10         | 0,12                              |
| 0,2240 % BNP Paribas 14/20.05.19 MTN<br>(XS1069282827)                                | EUR                           | 7 000   |                                          |                      | % 100,4370 | 7 030 590,00          | 0,06                              |
| 0,0710 % BNP Paribas 15/15.01.20 MTN<br>(XS1167154654)                                | EUR                           | 19 920  |                                          |                      | % 100,4100 | 20 001 672,00         | 0,18                              |
| 0,1760 % BNP Paribas 15/28.08.19 MTN<br>(XS1280841427)                                | EUR                           | 15 300  |                                          |                      | % 100,4630 | 15 370 839,00         | 0,14                              |
| 0,5270 % BNP Paribas 17/22.09.22 MTN<br>(XS1584041252)                                | EUR                           | 19 230  |                                          |                      | % 100,5300 | 19 331 919,00         | 0,18                              |
| 0,0020 % BNP Paribas 18/19.01.23 MTN<br>(XS1756434194) <sup>3)</sup>                  | EUR                           | 46 300  | 46 300                                   |                      | % 97,8620  | 45 310 106,00         | 0,42                              |
| 0,2940 % BNP Paribas 18/22.05.23 MTN<br>(XS1823532996) <sup>3)</sup>                  | EUR                           | 33 160  | 33 160                                   |                      | % 98,9840  | 32 823 094,40         | 0,30                              |
| 0,1790 % BNZ Int. Funding (London B.)<br>14/02.12.19 MTN (XS1145855646)               | EUR                           | 28 000  |                                          |                      | % 100,5660 | 28 158 480,00         | 0,26                              |
| 0,7290 % BPCE 17/07.03.22 MTN (FR0013241130) <sup>3)</sup>                            | EUR                           | 24 000  |                                          |                      | % 101,1780 | 24 282 720,00         | 0,22                              |
| 0,1710 % BPCE 18/11.01.23 MTN (FR0013309317)                                          | EUR                           | 36 000  | 36 000                                   |                      | % 98,3840  | 35 418 240,00         | 0,33                              |
| 0,1770 % BPCE 18/23.03.23 MTN (FR0013323672) <sup>3)</sup>                            | EUR                           | 35 000  | 35 000                                   |                      | % 98,4090  | 34 443 150,00         | 0,32                              |
| 0,0000 % Brunel Resident. Mtge. 1 07/13.01.39<br>Cl.A4A Reg S (XS0289300898)          | EUR                           | 18 000  |                                          |                      | % 100,0000 | 273 873,51            | 0,00                              |
| 0,0290 % Bundesimmobiliengesellschaft<br>17/13.09.19 MTN (XS1681694003)               | EUR                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,3090 | 30 092 700,00         | 0,28                              |
| 0,1770 % Canadian Imperial Bank of Commerce<br>18/22.06.20 MTN (XS1843467702)         | EUR                           | 17 500  | 17 500                                   |                      | % 100,5980 | 17 604 650,00         | 0,16                              |
| 0,5520 % Carrefour Banque 15/19.10.19<br>(XS1301773799) <sup>3)</sup>                 | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,8980 | 20 179 600,00         | 0,19                              |
| 0,1875 % Carrefour Banque 15/20.03.20<br>(XS1206712868)                               | EUR                           | 14 500  |                                          |                      | % 100,3570 | 14 551 765,00         | 0,13                              |
| 0,3520 % Carrefour Banque 16/20.04.21<br>MTN (FR0013155868)                           | EUR                           | 29 000  |                                          |                      | % 100,5370 | 29 155 730,00         | 0,27                              |
| 0,2990 % Carrefour Banque 18/15.06.22<br>MTN (FR0013342664)                           | EUR                           | 24 200  | 24 200                                   |                      | % 99,8860  | 24 172 412,00         | 0,22                              |
| 0,1770 % Cassa Depositi e Prestiti 15/20.03.22<br>MTN (IT0005090995)                  | EUR                           | 6 000   |                                          |                      | % 95,9480  | 5 756 880,00          | 0,05                              |
| 0,2230 % Citigroup 14/11.11.19 MTN (XS1135549167)                                     | EUR                           | 15 000  |                                          |                      | % 100,5130 | 15 076 950,00         | 0,14                              |
| 0,5060 % Citigroup 16/24.05.21 MTN<br>(XS1417876759) <sup>3)</sup>                    | EUR                           | 12 000  |                                          |                      | % 101,2770 | 12 153 240,00         | 0,11                              |
| 0,1770 % Citigroup 18/21.03.23 MTN<br>(XS1795253134) <sup>3)</sup>                    | EUR                           | 37 000  | 37 000                                   |                      | % 99,5970  | 36 850 890,00         | 0,34                              |
| 0,7790 % CLASS/BVV 05/08.06.20 S.173<br>MTN (XS0220432347)                            | EUR                           | 3 000   |                                          |                      | % 99,1200  | 2 973 600,00          | 0,03                              |
| 0,0000 % Coca-Cola 15/09.09.19 (XS1197832832)                                         | EUR                           | 31 910  | 10 000                                   |                      | % 100,3000 | 32 005 730,00         | 0,29                              |
| 0,0000 % Coca-Cola 17/08.03.19 (XS1574667124)                                         | EUR                           | 12 120  |                                          |                      | % 100,1930 | 12 143 391,60         | 0,11                              |
| 0,0000 % Coca-Cola European Partners<br>17/16.11.21 (XS1717567587)                    | EUR                           | 40 000  | 12 000                                   |                      | % 99,9040  | 39 961 600,00         | 0,37                              |
| 0,0000 % Colgate-Palmolive 15/14.05.19<br>MTN (XS1230926609)                          | EUR                           | 9 180   |                                          |                      | % 100,2130 | 9 199 553,40          | 0,08                              |
| 0,4290 % Commerzbank 17/08.03.22 S.880<br>MTN (DE000CZ40L22) <sup>3)</sup>            | EUR                           | 12 000  |                                          |                      | % 100,6820 | 12 081 840,00         | 0,11                              |
| 0,0000 % Coöperatieve Rabobank 15/29.05.20<br>MTN (XS1239520494)                      | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,3980 | 20 079 600,00         | 0,18                              |
| 0,1610 % Coöperatieve Rabobank 17/01.02.19<br>MTN (XS1559357154)                      | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,2700 | 10 027 000,00         | 0,09                              |
| 0,1720 % Coöperatieve Rabobank 17/24.10.19<br>MTN (XS1705802574)                      | EUR                           | 36 000  |                                          |                      | % 100,5460 | 36 196 560,00         | 0,33                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                       | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|-----------------------------------|
| 0,1710 % Coöperatieve Rabobank 18/17.01.20<br>MTN (XS1753787156) .....                      | EUR                           | 20 000  | 20 000                                   |                      | % 100,6100 | 20 122 000,00         | 0,18                              |
| 0,4720 % Credit Agricole (London Br.)<br>17/20.04.22 MTN (XS1598861588) <sup>3)</sup> ..... | EUR                           | 25 500  |                                          |                      | % 100,2930 | 25 574 715,00         | 0,23                              |
| 0,2790 % Credit Agricole 18/06.03.23<br>MTN (XS1787278008) .....                            | EUR                           | 46 200  | 46 200                                   |                      | % 98,9020  | 45 692 724,00         | 0,42                              |
| 0,1210 % Credit Suisse (London Branch)<br>14/16.10.19 MTN (XS1121919333) .....              | EUR                           | 10 270  |                                          |                      | % 100,4440 | 10 315 598,80         | 0,09                              |
| 1,2070 % CS Group Funding (Guernsey)<br>17/20.12.22 MTN (XS1317432620) .....                | EUR                           | 25 000  |                                          |                      | % 102,6480 | 25 662 000,00         | 0,24                              |
| 0,0720 % CW Bank of Australia 15/21.01.20<br>MTN (XS1170317645) <sup>3)</sup> .....         | EUR                           | 29 500  | 5 000                                    |                      | % 100,4600 | 29 635 700,00         | 0,27                              |
| 0,1790 % CW Bank of Australia 18/08.03.23<br>MTN (XS1789454326) .....                       | EUR                           | 70 000  | 70 000                                   |                      | % 100,5660 | 70 396 200,00         | 0,65                              |
| 0,2010 % Daimler 16/14.01.19 MTN<br>(DE000A169GZ7) .....                                    | EUR                           | 10 500  |                                          |                      | % 100,2030 | 10 521 315,00         | 0,10                              |
| 0,1210 % Daimler 17/03.07.24 MTN<br>(DE000A2GSCY9) .....                                    | EUR                           | 32 300  |                                          |                      | % 98,9890  | 31 973 447,00         | 0,29                              |
| 0,2710 % Daimler Canada Finance 18/16.01.20<br>MTN (XS1750116920) .....                     | EUR                           | 25 000  | 25 000                                   |                      | % 100,6730 | 25 168 250,00         | 0,23                              |
| 0,0000 % Daimler International Finance<br>17/11.05.22 MTN (DE000A19HBM3) .....              | EUR                           | 27 200  | 10 400                                   |                      | % 99,5010  | 27 064 272,00         | 0,25                              |
| 0,2740 % Daimler International Finance<br>17/13.11.19 MTN (DE000A19RXA1) .....              | EUR                           | 6 100   |                                          |                      | % 100,6160 | 6 137 576,00          | 0,06                              |
| 0,1710 % Daimler International Finance<br>18/09.04.20 MTN (DE000A19Y1P6) .....              | EUR                           | 20 000  | 20 000                                   |                      | % 100,4900 | 20 098 000,00         | 0,18                              |
| 0,0000 % Daimler International Finance<br>18/11.01.23 MTN (DE000A19UNN9) .....              | EUR                           | 25 800  | 25 800                                   |                      | % 98,7100  | 25 467 180,00         | 0,23                              |
| 0,0010 % Danone 15/14.01.20 MTN<br>(FR0012432904) <sup>3)</sup> .....                       | EUR                           | 24 200  |                                          |                      | % 100,2950 | 24 271 390,00         | 0,22                              |
| 0,0000 % Danone 16/03.11.18 MTN<br>(FR0013216884) <sup>3)</sup> .....                       | EUR                           | 20 300  |                                          |                      | % 100,0920 | 20 318 676,00         | 0,19                              |
| 0,0590 % Danske Bank 15/03.03.20 MTN<br>(XS1196502246) .....                                | EUR                           | 5 000   |                                          |                      | % 100,3920 | 5 019 600,00          | 0,05                              |
| 0,4260 % Danske Bank 17/24.05.19 MTN<br>(XS1620181831) .....                                | EUR                           | 25 700  |                                          |                      | % 100,6290 | 25 861 653,00         | 0,24                              |
| 0,4790 % Deut. Pfandbr.bk. 17/01.12.22<br>R.35288 MTN (DE000A2E4ZJ8) .....                  | EUR                           | 46 000  |                                          |                      | % 101,0700 | 46 492 200,00         | 0,43                              |
| 0,4240 % Deut. Pfandbr.bk. 17/14.02.20<br>R.35272 MTN (DE000A2DASK9) .....                  | EUR                           | 9 600   |                                          |                      | % 100,1350 | 9 612 960,00          | 0,09                              |
| 0,0000 % Deutsche Bahn Finance 14/23.07.20<br>MTN (XS1089831249) .....                      | EUR                           | 5 000   |                                          |                      | % 100,5200 | 5 026 000,00          | 0,05                              |
| 0,0490 % Deutsche Bahn Finance 17/06.12.24<br>MTN (XS1730863260) .....                      | EUR                           | 36 000  | 16 000                                   |                      | % 101,2320 | 36 443 520,00         | 0,33                              |
| 0,2210 % Deutsche Bank 14/15.04.19 MTN<br>(DE000DB7XHM0) .....                              | EUR                           | 24 000  |                                          |                      | % 99,6240  | 23 909 760,00         | 0,22                              |
| 0,1780 % Deutsche Bank 17/07.12.20 MTN<br>(DE000DL19TX8) .....                              | EUR                           | 32 200  |                                          |                      | % 97,6950  | 31 457 790,00         | 0,29                              |
| 0,4740 % Deutsche Bank 17/16.05.22 MTN<br>(DE000DL19TQ2) .....                              | EUR                           | 17 000  |                                          |                      | % 95,9840  | 16 317 280,00         | 0,15                              |
| 0,0210 % Deutsche Telekom Int. Finance<br>16/03.04.20 MTN (XS1382791892) .....              | EUR                           | 31 697  |                                          |                      | % 100,3250 | 31 800 015,25         | 0,29                              |
| 0,0000 % DH Europe Finance 17/30.06.22<br>(XS1637162246) .....                              | EUR                           | 30 490  | 10 000                                   |                      | % 99,9830  | 30 484 816,70         | 0,28                              |
| 0,0000 % DNB Bank 15/13.01.20 MTN<br>(XS1165750198) .....                                   | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,3230 | 10 032 300,00         | 0,09                              |
| 0,0240 % DNB Bank 15/17.08.20 MTN<br>(XS1275834395) .....                                   | EUR                           | 15 000  |                                          |                      | % 100,4490 | 15 067 350,00         | 0,14                              |
| 3,8750 % Engie 13/und. (FR0011531714) .....                                                 | EUR                           | 19 800  | 6 300                                    |                      | % 100,1020 | 19 820 196,00         | 0,18                              |
| 0,0000 % Equinor 15/19.08.19 MTN (XS1190623907) .....                                       | EUR                           | 12 800  |                                          |                      | % 100,2460 | 12 831 488,00         | 0,12                              |
| 0,1390 % F.T. - RMBS Prado IV - 17/15.03.56<br>S.4 Cl.A (ES0305248009) .....                | EUR                           | 11 153  |                                          | 360                  | % 100,7121 | 11 232 794,36         | 0,10                              |
| 0,1770 % FCE Bank 17/26.08.20 MTN<br>(XS1590503279) .....                                   | EUR                           | 17 660  |                                          |                      | % 100,2140 | 17 697 792,40         | 0,16                              |
| 0,0720 % Fédérat.caiss.Desjard Québec<br>15/20.01.20 MTN (XS1170332107) <sup>3)</sup> ..... | EUR                           | 25 400  |                                          |                      | % 100,4300 | 25 509 220,00         | 0,23                              |
| 0,2210 % FedEx 16/11.04.19 (XS1319814817) .....                                             | EUR                           | 25 980  |                                          |                      | % 100,3140 | 26 061 577,20         | 0,24                              |
| 0,0490 % Ford Motor Credit 17/01.12.21<br>MTN (XS1729872652) .....                          | EUR                           | 25 000  | 7 010                                    |                      | % 99,2870  | 24 821 750,00         | 0,23                              |
| 0,3790 % Ford Motor Credit 17/01.12.24<br>MTN (XS1729872736) <sup>3)</sup> .....            | EUR                           | 21 000  |                                          |                      | % 98,1930  | 20 620 530,00         | 0,19                              |
| 0,0980 % Ford Motor Credit 18/07.12.22<br>MTN (XS1767930826) .....                          | EUR                           | 37 500  | 37 500                                   |                      | % 98,2780  | 36 854 250,00         | 0,34                              |
| 0,0000 % France 18/22.08.18 (FR0124909716) <sup>3)</sup> .....                              | EUR                           | 31 000  | 31 000                                   |                      | % 100,0890 | 31 027 590,00         | 0,28                              |
| 0,0000 % France B.T.F. 17/10.10.18<br>(FR0124584733) <sup>3)</sup> .....                    | EUR                           | 40 000  |                                          |                      | % 100,1690 | 40 067 600,00         | 0,37                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                          | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|-----------------------------------|
| 0,0000 % GE Capital European Funding<br>06/17.05.21 MTN (XS0254356057) . . . . .               | EUR                           | 36 500  |                                          |                      | % 99,8480  | 36 444 520,00         | 0,33                              |
| 0,0520 % GE Capital European Funding<br>15/21.01.20 MTN (XS1169331367) <sup>3)</sup> . . . . . | EUR                           | 34 000  |                                          |                      | % 100,2390 | 34 081 260,00         | 0,31                              |
| 0,0560 % Gecina 17/30.06.22 MTN (FR0013266343) . . . . .                                       | EUR                           | 32 900  | 12 000                                   |                      | % 99,6790  | 32 794 391,00         | 0,30                              |
| 0,0000 % General Electric 15/28.05.20<br>(XS1238900515) . . . . .                              | EUR                           | 36 000  |                                          |                      | % 100,0660 | 36 023 760,00         | 0,33                              |
| 0,4010 % General Mills 16/15.01.20 (XS1346107433) . . . . .                                    | EUR                           | 19 350  |                                          |                      | % 100,8530 | 19 515 055,50         | 0,18                              |
| 0,3520 % General Motors Financial 17/15.05.21<br>MTN (XS1609252645) . . . . .                  | EUR                           | 31 800  |                                          |                      | % 100,4540 | 31 944 372,00         | 0,29                              |
| 0,2270 % General Motors Financial 18/26.03.22<br>MTN (XS1792505197) . . . . .                  | EUR                           | 35 430  | 35 430                                   |                      | % 99,7230  | 35 331 858,90         | 0,32                              |
| 0,4220 % Goldman Sachs Group 14/29.10.19<br>MTN (XS1130101931) <sup>3)</sup> . . . . .         | EUR                           | 12 150  |                                          |                      | % 100,6160 | 12 224 844,00         | 0,11                              |
| 0,3760 % Goldman Sachs Group 15/29.05.20<br>MTN (XS1240146891) . . . . .                       | EUR                           | 16 000  |                                          |                      | % 100,6730 | 16 107 680,00         | 0,15                              |
| 0,6720 % Goldman Sachs Group 16/27.07.21<br>MTN (XS1458408306) . . . . .                       | EUR                           | 10 503  |                                          |                      | % 101,4940 | 10 659 914,82         | 0,10                              |
| 0,3090 % Goldman Sachs Group 17/09.09.22<br>MTN (XS1577427526) <sup>3)</sup> . . . . .         | EUR                           | 20 330  |                                          |                      | % 99,8100  | 20 291 373,00         | 0,19                              |
| 0,1360 % Goldman Sachs Group 17/31.12.18<br>MTN (XS1589406633) . . . . .                       | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,1610 | 20 032 200,00         | 0,18                              |
| 0,1290 % Goldman Sachs Group 18/16.12.20<br>MTN (XS1791719534) . . . . .                       | EUR                           | 29 700  | 29 700                                   |                      | % 99,9860  | 29 695 842,00         | 0,27                              |
| 0,1220 % Gosforth Funding 16/24.07.58<br>S.2 Cl.A1A Reg S (XS1396259431) . . . . .             | EUR                           | 2 500   |                                          |                      | % 100,2211 | 1 000 100,97          | 0,01                              |
| 0,1290 % HSBC Bank 18/09.03.20 MTN<br>(XS1789496244) . . . . .                                 | EUR                           | 66 500  | 66 500                                   |                      | % 100,5600 | 66 872 400,00         | 0,61                              |
| 0,2260 % HSBC France 15/27.11.19 MTN<br>(FR0013062684) . . . . .                               | EUR                           | 50 000  | 25 000                                   |                      | % 100,6460 | 50 323 000,00         | 0,46                              |
| 0,2770 % HSBC Holdings 16/21.12.18 MTN<br>(XS1539998135) . . . . .                             | EUR                           | 18 000  |                                          |                      | % 100,1940 | 18 034 920,00         | 0,17                              |
| 0,1720 % HSBC Holdings 17/05.10.23 MTN<br>(XS1681855539) . . . . .                             | EUR                           | 38 640  |                                          |                      | % 99,2630  | 38 355 223,20         | 0,35                              |
| 0,3760 % HSBC Holdings 17/27.09.22 MTN<br>(XS1586214956) <sup>3)</sup> . . . . .               | EUR                           | 27 500  |                                          |                      | % 100,3730 | 27 602 575,00         | 0,25                              |
| 0,0000 % HSH Finanzfonds 14/17.06.19<br>IHS (DE000A110GT5) . . . . .                           | EUR                           | 20 800  | 20 800                                   |                      | % 100,2390 | 20 849 712,00         | 0,19                              |
| 0,2210 % ICBC (Luxembourg Branch) 17/12.10.22<br>MTN (XS1691909334) . . . . .                  | EUR                           | 20 769  |                                          |                      | % 100,0130 | 20 771 699,97         | 0,19                              |
| 0,1790 % Industrial Com.Bk.China (Iond Br)<br>18/14.06.21 MTN (XS1831163396) . . . . .         | EUR                           | 25 000  | 25 000                                   |                      | % 99,9170  | 24 979 250,00         | 0,23                              |
| 0,0840 % ING Bank 14/20.11.19 MTN<br>(XS1143001102) . . . . .                                  | EUR                           | 30 000  | 10 000                                   |                      | % 100,3930 | 30 117 900,00         | 0,28                              |
| 0,1740 % ING Bank 15/20.08.18 MTN<br>(XS1278757825) . . . . .                                  | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,0530 | 10 005 300,00         | 0,09                              |
| 0,1790 % ING Bank 18/02.09.19 MTN<br>(XS1785831741) . . . . .                                  | EUR                           | 50 000  | 50 000                                   |                      | % 100,4970 | 50 248 500,00         | 0,46                              |
| 0,7210 % Intesa Sanpaolo 14/17.04.19<br>MTN (XS1057822766) . . . . .                           | EUR                           | 20 000  | 14 380                                   |                      | % 100,0730 | 20 014 600,00         | 0,18                              |
| 0,7290 % Intesa Sanpaolo 15/15.06.20<br>MTN (XS1246144650) <sup>3)</sup> . . . . .             | EUR                           | 22 200  |                                          |                      | % 99,7780  | 22 150 716,00         | 0,20                              |
| 1,0490 % Intesa Sanpaolo 17/15.03.23<br>(XS1577427872) <sup>3)</sup> . . . . .                 | EUR                           | 32 000  | 32 000                                   |                      | % 98,3130  | 31 460 160,00         | 0,29                              |
| 0,6220 % Intesa Sanpaolo 17/19.04.22<br>MTN (XS1599167589) <sup>3)</sup> . . . . .             | EUR                           | 45 290  | 25 000                                   |                      | % 97,6660  | 44 232 931,40         | 0,41                              |
| 0,0000 % Invest.bk. Schleswig Holstein<br>14/20.11.19 S.1 IHS (DE000A13SL42) . . . . .         | EUR                           | 12 000  |                                          |                      | % 100,6310 | 12 075 720,00         | 0,11                              |
| 0,0000 % Italfinance Securitisation V.2<br>07/14.01.26 Cl.A (IT0004197254) . . . . .           | EUR                           | 67 500  |                                          |                      | % 100,0506 | 2 186 229,17          | 0,02                              |
| 0,2820 % Italy C.C.T. 14/15.06.22 (IT0005104473) . . . . .                                     | EUR                           | 5 000   |                                          |                      | % 96,2490  | 4 812 450,00          | 0,04                              |
| 0,9290 % Italy C.C.T. 14/15.11.19 (IT0005009839) . . . . .                                     | EUR                           | 18 000  |                                          |                      | % 100,4270 | 18 076 860,00         | 0,17                              |
| 0,1590 % John Deere Bank 14/19.03.19<br>MTN (XS1046499981) . . . . .                           | EUR                           | 13 820  |                                          |                      | % 100,2700 | 13 857 314,00         | 0,13                              |
| 0,0220 % John Deere Bank 16/21.04.20<br>MTN (XS1398275112) . . . . .                           | EUR                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,3470 | 25 086 750,00         | 0,23                              |
| 0,0000 % John Deere Bank 17/03.10.22<br>MTN (XS1692846790) . . . . .                           | EUR                           | 30 000  |                                          |                      | % 99,8860  | 29 965 800,00         | 0,28                              |
| 0,0000 % John Deere Cash Management 17/15.09.20<br>MTN (XS1683495052) . . . . .                | EUR                           | 25 500  |                                          |                      | % 100,1690 | 25 543 095,00         | 0,23                              |
| 0,2720 % JPMorgan Chase & Co. 14/07.05.19<br>MTN (XS1064100115) . . . . .                      | EUR                           | 8 000   |                                          |                      | % 100,4190 | 8 033 520,00          | 0,07                              |
| 0,2790 % Jyske Bank 17/01.12.22 MTN<br>(XS1726323436) . . . . .                                | EUR                           | 17 810  |                                          |                      | % 100,8660 | 17 964 234,60         | 0,16                              |
| 0,2260 % KBC Groep 17/24.11.22 MTN<br>(BE0002281500) . . . . .                                 | EUR                           | 36 000  |                                          |                      | % 99,4540  | 35 803 440,00         | 0,33                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                             | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|-----------------------------------|
| 0,0000 % Koninklijke Ahold Delhaize 18/19.03.21<br>(XS1787517199) .....           | EUR                           | 16 500  | 16 500                                   |                      | % 100,1190 | 16 519 635,00         | 0,15                              |
| 0,0000 % Koninklijke Philips 17/06.09.19<br>(XS1671754650) .....                  | EUR                           | 6 740   |                                          |                      | % 100,2850 | 6 759 209,00          | 0,06                              |
| 6,1250 % KPN 13/und. (XS0903872355) .....                                         | EUR                           | 15 000  | 15 000                                   |                      | % 101,1290 | 15 169 350,00         | 0,14                              |
| 0,0110 % LB Baden-Württemberg 17/02.10.19<br>MTN (DE000LB1DZX4) .....             | EUR                           | 51 500  |                                          |                      | % 100,1490 | 51 576 735,00         | 0,47                              |
| 0,0720 % LB Baden-Württemberg 17/09.08.19<br>IHS MTN S.787 (DE000LB1DYL2) .....   | EUR                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,1110 | 30 033 300,00         | 0,28                              |
| 0,1910 % LeasePlan 17/04.11.20 MTN<br>(XS1604200904) .....                        | EUR                           | 7 500   |                                          |                      | % 100,3120 | 7 523 400,00          | 0,07                              |
| 0,1120 % LeasePlan 17/26.10.20 MTN<br>(XS1705885090) .....                        | EUR                           | 46 000  |                                          |                      | % 100,1670 | 46 076 820,00         | 0,42                              |
| 0,1720 % LeasePlan 18/25.01.21 MTN<br>(XS1757442071) .....                        | EUR                           | 26 000  | 26 000                                   |                      | % 100,3440 | 26 089 440,00         | 0,24                              |
| 0,1710 % LeasePlan Corporation 18/11.01.22<br>MTN (XS1748452551) .....            | EUR                           | 48 000  | 48 000                                   |                      | % 100,3150 | 48 151 200,00         | 0,44                              |
| 0,0000 % LHMC Finco 18/20.12.23 Reg S<br>(XS1849559205) .....                     | EUR                           | 5 390   | 5 390                                    |                      | % 98,1850  | 5 292 171,50          | 0,05                              |
| 0,1290 % Lloyds Bank 14/10.09.19 MTN<br>(XS1109333986) .....                      | EUR                           | 18 930  |                                          |                      | % 100,3990 | 19 005 530,70         | 0,17                              |
| 0,1720 % Lloyds Bank 15/09.10.18 MTN<br>(XS1304487710) .....                      | EUR                           | 4 000   |                                          |                      | % 100,1180 | 4 004 720,00          | 0,04                              |
| 0,0000 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton<br>14/14.02.19 MTN (FR0012315133) ..... | EUR                           | 14 500  |                                          |                      | % 100,1290 | 14 518 705,00         | 0,13                              |
| 0,0000 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton<br>17/26.11.18 MTN (FR0013257599) ..... | EUR                           | 12 820  |                                          |                      | % 100,0920 | 12 831 794,40         | 0,12                              |
| 0,0000 % McDonald's 15/26.08.19 MTN<br>(XS1237187718) .....                       | EUR                           | 31 800  |                                          |                      | % 100,2510 | 31 879 818,00         | 0,29                              |
| 0,0000 % McDonald's 17/05.04.19 MTN<br>(XS1591430746) .....                       | EUR                           | 14 100  |                                          |                      | % 100,1850 | 14 126 085,00         | 0,13                              |
| 0,4740 % Mediobanca - Banca Credito Fin.<br>17/18.05.22 MTN (XS1615501837) .....  | EUR                           | 22 480  |                                          |                      | % 96,7200  | 21 742 656,00         | 0,20                              |
| 0,0290 % Molson Coors Brewing 17/15.03.19<br>(XS1712180477) .....                 | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,0650 | 20 013 000,00         | 0,18                              |
| 0,0740 % Morgan Stanley & Co. 18/21.05.21<br>MTN (XS1824289901) .....             | EUR                           | 30 000  | 30 000                                   |                      | % 99,8880  | 29 966 400,00         | 0,28                              |
| 0,3740 % Morgan Stanley 14/19.11.19 MTN<br>(XS1139320151) .....                   | EUR                           | 13 570  |                                          |                      | % 100,6900 | 13 663 633,00         | 0,13                              |
| 0,1790 % Morgan Stanley 16/03.12.19 MTN<br>(XS1529837947) .....                   | EUR                           | 42 000  |                                          |                      | % 100,1530 | 42 064 260,00         | 0,39                              |
| 0,3720 % Morgan Stanley 16/27.01.22 MTN<br>(XS1511787407) .....                   | EUR                           | 13 170  |                                          |                      | % 100,2310 | 13 200 422,70         | 0,12                              |
| 0,3720 % Morgan Stanley 17/08.11.22 MTN<br>(XS1603892065) .....                   | EUR                           | 21 080  |                                          |                      | % 100,0940 | 21 099 815,20         | 0,19                              |
| 0,0520 % Morgan Stanley 17/09.11.21 MTN<br>(XS1706111876) .....                   | EUR                           | 24 000  |                                          |                      | % 99,5170  | 23 884 080,00         | 0,22                              |
| 0,1760 % Mylan 17/24.05.20 (XS1619284372) .....                                   | EUR                           | 27 290  |                                          |                      | % 100,0990 | 27 317 017,10         | 0,25                              |
| 0,1770 % National Australia Bank 14/25.03.19<br>MTN (XS1048519836) .....          | EUR                           | 5 000   |                                          |                      | % 100,3100 | 5 015 500,00          | 0,05                              |
| 0,2420 % National Australia Bank 16/19.04.21<br>MTN (XS1412416486) .....          | EUR                           | 11 070  |                                          |                      | % 101,0100 | 11 181 807,00         | 0,10                              |
| 0,1760 % National Australia Bank 18/27.03.20<br>MTN (XS1799522468) .....          | EUR                           | 30 000  | 30 000                                   |                      | % 100,6360 | 30 190 800,00         | 0,28                              |
| 0,1720 % National Bank of Canada 18/06.04.20<br>MTN (XS1802463718) .....          | EUR                           | 35 000  | 35 000                                   |                      | % 100,6800 | 35 238 000,00         | 0,32                              |
| 0,1710 % Nationwide Building Society<br>15/02.11.18 MTN (XS1315154721) .....      | EUR                           | 27 800  |                                          |                      | % 100,1510 | 27 841 978,00         | 0,26                              |
| 0,2790 % Nationwide Building Society<br>17/06.06.19 MTN (XS1626168626) .....      | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,4590 | 10 045 900,00         | 0,09                              |
| 0,4220 % NatWest Markets 09/08.10.19<br>(NL0009062215) .....                      | EUR                           | 13 000  |                                          |                      | % 99,6860  | 12 959 180,00         | 0,12                              |
| 0,1090 % NatWest Markets 17/08.06.20<br>MTN (XS1627773606) .....                  | EUR                           | 15 299  |                                          |                      | % 100,0300 | 15 303 589,70         | 0,14                              |
| 6,5000 % Naviera Armas 16/31.07.23 Reg<br>S (XS1459821036) <sup>3)</sup> .....    | EUR                           | 4 900   | 4 900                                    |                      | % 100,7490 | 4 936 701,00          | 0,05                              |
| 4,2500 % Naviera Armas 17/15.11.24 Reg<br>S (XS1717590563) .....                  | EUR                           | 5 480   |                                          |                      | % 98,3290  | 5 388 429,20          | 0,05                              |
| 0,2720 % Norddt. Landesbank 17/10.02.20<br>IHS (DE000NLB89N9) .....               | EUR                           | 15 000  |                                          |                      | % 99,9200  | 14 988 000,00         | 0,14                              |
| 0,0000 % Nordea Bank 15/05.06.20 MTN<br>(XS1242968979) .....                      | EUR                           | 38 000  | 20 000                                   |                      | % 100,3510 | 38 133 380,00         | 0,35                              |
| 0,1240 % Nordea Bank 16/22.02.19 MTN<br>(XS1368469570) .....                      | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,2550 | 20 051 000,00         | 0,18                              |
| 0,1760 % Nordea Bank 17/27.09.21 MTN<br>(XS1689534029) .....                      | EUR                           | 46 660  |                                          |                      | % 100,8610 | 47 061 742,60         | 0,43                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                           | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |      |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------|-----------------------|-----------------------------------|------|
| 0,1710 % Nykredit Realkredit 17/01.10.22<br>PF (DK0009515603) .....             | EUR                           | 25 880  | 15 000                                   |                      | %    | 102,0200              | 26 402 776,00                     | 0,24 |
| 0,0000 % OP Yrityspankki 15/11.03.20<br>MTN (XS1199650638) .....                | EUR                           | 18 600  |                                          |                      | %    | 100,2930              | 18 654 498,00                     | 0,17 |
| 0,4290 % OP Yrityspankki 17/13.06.22<br>MTN (XS1629769826) .....                | EUR                           | 30 000  |                                          |                      | %    | 101,6760              | 30 502 800,00                     | 0,28 |
| 0,1740 % OP Yrityspankki 18/22.05.21<br>MTN (XS1823485112) <sup>3)</sup> .....  | EUR                           | 19 500  | 19 500                                   |                      | %    | 100,6650              | 19 629 675,00                     | 0,18 |
| 0,1240 % Paccar Financial Europe 18/18.05.21<br>MTN (XS1823165631) .....        | EUR                           | 18 000  | 18 000                                   |                      | %    | 100,5070              | 18 091 260,00                     | 0,17 |
| 0,0910 % Permanent Master Issuer 15/15.07.42<br>S.1X Cl.A3 (XS1307149432) ..... | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | %    | 100,4650              | 10 046 500,00                     | 0,09 |
| 0,0820 % QNB Finance 16/25.10.18 MTN<br>(XS1508636948) .....                    | EUR                           | 16 000  |                                          |                      | %    | 99,9120               | 15 985 920,00                     | 0,15 |
| 0,1720 % QNB Finance 17/25.01.19 MTN<br>(XS1556193339) .....                    | EUR                           | 21 000  |                                          |                      | %    | 99,8300               | 20 964 300,00                     | 0,19 |
| 0,6790 % RCI Banque 16/18.03.19 MTN<br>(FR0013136330) .....                     | EUR                           | 13 585  |                                          |                      | %    | 100,5490              | 13 659 581,65                     | 0,13 |
| 0,1220 % RCI Banque 17/08.07.20 MTN<br>(FR0013241379) .....                     | EUR                           | 21 770  |                                          |                      | %    | 100,1000              | 21 791 770,00                     | 0,20 |
| 0,3210 % RCI Banque 17/12.04.21 MTN<br>(FR0013250685) .....                     | EUR                           | 16 000  |                                          |                      | %    | 100,2790              | 16 044 640,00                     | 0,15 |
| 0,3490 % RCI Banque 17/14.03.22 MTN<br>(FR0013260486) .....                     | EUR                           | 6 500   |                                          |                      | %    | 99,8480               | 6 490 120,00                      | 0,06 |
| 0,1010 % RCI Banque 18/12.01.23 MTN<br>(FR0013309606) .....                     | EUR                           | 20 540  | 20 540                                   |                      | %    | 98,6020               | 20 252 850,80                     | 0,19 |
| 0,3720 % Repsol International Finance<br>16/06.07.18 MTN (XS1442286008) .....   | EUR                           | 46 000  |                                          |                      | %    | 100,0010              | 46 000 460,00                     | 0,42 |
| 0,1260 % Royal Bank of Canada 14/27.03.19<br>MTN (XS1049207993) .....           | EUR                           | 15 000  | 15 000                                   |                      | %    | 100,2930              | 15 043 950,00                     | 0,14 |
| 0,1020 % Royal Bank of Canada 15/06.08.20<br>MTN (XS1272154565) .....           | EUR                           | 23 680  |                                          |                      | %    | 100,5820              | 23 817 817,60                     | 0,22 |
| 0,0000 % Sanofi 14/10.09.18 MTN (FR0012146751) <sup>3)</sup> .....              | EUR                           | 8 000   |                                          |                      | %    | 100,0340              | 8 002 720,00                      | 0,07 |
| 0,0000 % Sanofi 15/22.03.19 MTN (FR0012969012) ..                               | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | %    | 100,1850              | 20 037 000,00                     | 0,18 |
| 0,3740 % Santander UK 14/13.08.19 MTN<br>(XS1098036939) .....                   | EUR                           | 39 500  |                                          |                      | %    | 100,6320              | 39 749 640,00                     | 0,36 |
| 0,2990 % Santander UK 14/22.05.19 MTN<br>(XS1070235004) .....                   | EUR                           | 21 200  |                                          |                      | %    | 100,4160              | 21 288 192,00                     | 0,20 |
| 0,0770 % Santander UK 18/27.02.20 S.NGN<br>MTN (XS1784284975) .....             | EUR                           | 30 000  | 30 000                                   |                      | %    | 100,3970              | 30 119 100,00                     | 0,28 |
| 0,4540 % Santander UK Group Holdings<br>17/18.05.23 MTN (XS1615065320) .....    | EUR                           | 11 500  | 4 220                                    |                      | %    | 99,5250               | 11 445 375,00                     | 0,11 |
| 0,0000 % SAP 14/20.11.18 MTN (DE000A13SL18) .....                               | EUR                           | 9 700   |                                          |                      | %    | 100,0850              | 9 708 245,00                      | 0,09 |
| 0,0000 % SAP 15/01.04.20 MTN (DE000A14KJE8) <sup>3)</sup> ..                    | EUR                           | 6 980   |                                          |                      | %    | 100,4240              | 7 009 595,20                      | 0,06 |
| 0,0290 % Scania CV 17/06.09.19 MTN<br>(XS1678632487) .....                      | EUR                           | 6 700   |                                          |                      | %    | 100,1860              | 6 712 462,00                      | 0,06 |
| 0,0240 % Scania CV 17/13.02.19 MTN<br>(XS1564405741) .....                      | EUR                           | 16 000  |                                          |                      | %    | 100,1060              | 16 016 960,00                     | 0,15 |
| 0,0720 % Scania CV 17/20.04.20 MTN<br>(XS1599109896) .....                      | EUR                           | 13 000  |                                          |                      | %    | 100,2280              | 13 029 640,00                     | 0,12 |
| 0,3210 % Scentre Management 14/16.07.18<br>MTN (XS1087817422) .....             | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | %    | 100,0180              | 10 001 800,00                     | 0,09 |
| 0,0790 % Shell International Finance<br>15/15.09.19 MTN (XS1292468987) .....    | EUR                           | 27 000  |                                          |                      | %    | 100,4000              | 27 108 000,00                     | 0,25 |
| 0,0000 % Silverstone M. I. 15/21.01.70<br>Cl.2A1 MTN (XS1191556148) .....       | EUR                           | 20 000  | 20 000                                   |                      | %    | 100,1620              | 20 032 406,60                     | 0,18 |
| 0,1490 % Skandin. Enskilda Banken 15/15.09.20<br>MTN (XS1291152624) .....       | EUR                           | 15 000  |                                          |                      | %    | 100,6780              | 15 101 700,00                     | 0,14 |
| 0,4220 % Skandin. Enskilda Banken 16/12.08.19<br>MTN (XS1468872442) .....       | EUR                           | 10 000  |                                          |                      | %    | 100,7100              | 10 071 000,00                     | 0,09 |
| 0,2760 % Skandin. Enskilda Banken 16/26.05.20<br>MTN (XS1419638215) .....       | EUR                           | 36 000  |                                          |                      | %    | 100,8460              | 36 304 560,00                     | 0,33 |
| 0,4210 % Sky 15/01.04.20 MTN (XS1212467911) .....                               | EUR                           | 13 550  |                                          |                      | %    | 100,7170              | 13 647 153,50                     | 0,13 |
| 0,2740 % Snam 17/21.02.22 MTN (XS1568906421) ...                                | EUR                           | 13 930  |                                          |                      | %    | 100,4655              | 13 994 844,15                     | 0,13 |
| 0,1020 % Société Générale 15/22.07.18<br>MTN (XS1264495000) .....               | EUR                           | 8 400   |                                          |                      | %    | 100,0230              | 8 401 932,00                      | 0,08 |
| 0,5210 % Societe Generale 17/01.04.22<br>MTN (XS1586146851) .....               | EUR                           | 22 300  |                                          |                      | %    | 100,3870              | 22 386 301,00                     | 0,21 |
| 0,1290 % Societe Generale 18/06.03.23<br>MTN (FR0013321791) <sup>3)</sup> ..... | EUR                           | 50 000  | 50 000                                   |                      | %    | 97,9750               | 48 987 500,00                     | 0,45 |
| 0,1720 % Standard Chartered Bank 18/24.04.20<br>MTN (XS1821079990) .....        | EUR                           | 25 000  | 25 000                                   |                      | %    | 100,6540              | 25 163 500,00                     | 0,23 |
| 0,0000 % Storm 16/22.04.54 Cl. A1 (XS1336735805) .....                          | EUR                           | 11 000  |                                          |                      | %    | 100,0600              | 2 180 737,66                      | 0,02 |
| 0,0720 % Storm 16/22.04.54 Cl. A2 (XS1336738221) ..                             | EUR                           | 7 000   |                                          |                      | %    | 100,6800              | 7 047 600,00                      | 0,06 |
| 0,1710 % Sumitomo Mitsui Banking 18/16.04.20<br>MTN (XS1807492688) .....        | EUR                           | 36 000  | 36 000                                   |                      | %    | 100,4920              | 36 177 120,00                     | 0,33 |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                              | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|-----------------------------------|
| 0,1290 % Sumitomo Mitsui Financial Group<br>17/14.06.22 MTN (XS1621087359) <sup>3)</sup> . . . . . | EUR                           | 17 900  |                                          |                      | % 99,6410  | 17 835 739,00         | 0,16                              |
| 0,1740 % Swedbank 15/18.08.20 MTN<br>(XS1277337678) <sup>3)</sup> . . . . .                        | EUR                           | 25 500  |                                          |                      | % 100,7460 | 25 690 230,00         | 0,24                              |
| 0,6210 % Swedbank 17/10.01.20 MTN<br>(XS1548503173) . . . . .                                      | EUR                           | 10 200  |                                          |                      | % 101,2410 | 10 326 582,00         | 0,09                              |
| 0,0000 % Thermo Fisher Scientific 17/24.07.19<br>(XS1651071521) . . . . .                          | EUR                           | 16 290  | 4 000                                    |                      | % 100,1240 | 16 310 199,60         | 0,15                              |
| 0,1590 % Toronto-Dominion Bank 15/08.09.20<br>MTN (XS1287714502) <sup>3)</sup> . . . . .           | EUR                           | 29 500  |                                          |                      | % 100,6820 | 29 701 190,00         | 0,27                              |
| 0,0000 % Total Capital International<br>14/19.03.20 MTN (XS1139316555) . . . . .                   | EUR                           | 20 300  |                                          |                      | % 100,4030 | 20 381 809,00         | 0,19                              |
| 0,0000 % Toyota Motor Credit 15/20.07.18<br>MTN (XS1171489476) <sup>3)</sup> . . . . .             | EUR                           | 9 890   |                                          |                      | % 100,0160 | 9 891 582,40          | 0,09                              |
| 0,0220 % Toyota Motor Finance (Netherlands)<br>18/27.04.20 MTN (XS1812086947) . . . . .            | EUR                           | 30 000  | 30 000                                   |                      | % 100,4510 | 30 135 300,00         | 0,28                              |
| 0,1790 % UBS (London Branch) 17/05.09.19<br>MTN (XS1673620107) . . . . .                           | EUR                           | 40 000  | 15 000                                   |                      | % 100,4020 | 40 160 800,00         | 0,37                              |
| 0,1710 % UBS (London Branch) 18/10.01.20<br>MTN (XS1746116299) <sup>3)</sup> . . . . .             | EUR                           | 39 250  | 39 250                                   |                      | % 100,4630 | 39 431 727,50         | 0,36                              |
| 0,3770 % UBS Group Funding (Switzerland)<br>17/20.09.22 (CH0359915425) . . . . .                   | EUR                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,0530 | 25 013 250,00         | 0,23                              |
| 0,6740 % UniCredit 15/19.02.20 MTN (XS1169707087)<br>EUR 15 090                                    | EUR                           | 15 090  |                                          |                      | % 99,9930  | 15 088 943,70         | 0,14                              |
| 0,1010 % United Parcel Service 15/15.07.20<br>(XS1323463056) . . . . .                             | EUR                           | 29 000  |                                          |                      | % 100,5770 | 29 167 330,00         | 0,27                              |
| 0,0000 % United Technologies 17/13.11.19<br>(XS1715323298) . . . . .                               | EUR                           | 20 000  | 20 000                                   |                      | % 100,1670 | 20 033 400,00         | 0,18                              |
| 0,6270 % Vodafone Group 16/25.02.19 MTN<br>(XS1372838083) . . . . .                                | EUR                           | 66 420  | 9 000                                    |                      | % 100,5260 | 66 769 369,20         | 0,61                              |
| 0,0990 % Volkswagen Bank 17/15.06.21<br>MTN (XS1734547919) . . . . .                               | EUR                           | 24 500  | 5 000                                    |                      | % 99,3390  | 24 338 055,00         | 0,22                              |
| 0,3790 % Volkswagen Bank 18/08.12.21<br>MTN (XS1830992563) <sup>3)</sup> . . . . .                 | EUR                           | 19 700  | 19 700                                   |                      | % 100,1640 | 19 732 308,00         | 0,18                              |
| 0,0210 % Volkswagen Financial Services<br>18/11.10.19 MTN (XS1806435324) . . . . .                 | EUR                           | 36 100  | 36 100                                   |                      | % 100,0660 | 36 123 826,00         | 0,33                              |
| 0,2710 % Volkswagen Int. Finance 14/15.04.19<br>MTN (XS1057486471) . . . . .                       | EUR                           | 7 000   |                                          |                      | % 100,2260 | 7 015 820,00          | 0,06                              |
| 0,0000 % Volkswagen Int. Finance 15/16.07.18<br>MTN (XS1167637294) . . . . .                       | EUR                           | 22 400  |                                          |                      | % 100,0040 | 22 400 896,00         | 0,21                              |
| 0,0220 % Volkswagen Leasing 17/06.07.19<br>MTN (XS1642545690) . . . . .                            | EUR                           | 8 400   |                                          |                      | % 100,0900 | 8 407 560,00          | 0,08                              |
| 0,1220 % Volkswagen Leasing 17/06.07.21<br>MTN (XS1642546078) . . . . .                            | EUR                           | 25 500  |                                          |                      | % 99,3980  | 25 346 490,00         | 0,23                              |
| 0,1490 % Volvo Treasury 16/06.09.19 MTN<br>(XS1485660895) . . . . .                                | EUR                           | 21 300  |                                          |                      | % 100,3280 | 21 369 864,00         | 0,20                              |
| 0,0000 % Volvo Treasury 17/03.04.19 MTN<br>(XS1589872875) . . . . .                                | EUR                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,0030 | 20 000 600,00         | 0,18                              |
| 0,0210 % Volvo Treasury 18/04.05.20 MTN<br>(XS1816215674) . . . . .                                | EUR                           | 25 000  | 25 000                                   |                      | % 100,0600 | 25 015 000,00         | 0,23                              |
| 0,0210 % Volvo Treasury 18/10.01.20 MTN<br>(XS1747818000) . . . . .                                | EUR                           | 32 000  | 32 000                                   |                      | % 100,1060 | 32 033 920,00         | 0,29                              |
| 0,0240 % Vonovia Finance 17/20.11.19<br>MTN (DE000A19SE11) . . . . .                               | EUR                           | 19 000  |                                          |                      | % 100,2310 | 19 043 890,00         | 0,17                              |
| 0,1270 % Vonovia Finance 18/22.12.22<br>(DE000A19X793) . . . . .                                   | EUR                           | 41 600  | 41 600                                   |                      | % 99,5380  | 41 407 808,00         | 0,38                              |
| 0,1220 % Wells Fargo & Co. 14/24.04.19<br>MTN (XS1061043797) . . . . .                             | EUR                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,2720 | 25 068 000,00         | 0,23                              |
| 0,0990 % Wells Fargo & Co. 15/02.06.25<br>MTN (XS1240966348) . . . . .                             | EUR                           | 25 710  |                                          |                      | % 100,2540 | 25 775 303,40         | 0,24                              |
| 0,2920 % Wells Fargo & Co. 16/26.04.21<br>MTN (XS1400169428) . . . . .                             | EUR                           | 21 700  |                                          |                      | % 100,5660 | 21 822 822,00         | 0,20                              |
| 0,1720 % Wells Fargo & Co. 17/31.01.22<br>MTN (XS1558022866) <sup>3)</sup> . . . . .               | EUR                           | 25 000  | 10 080                                   |                      | % 99,9380  | 24 984 500,00         | 0,23                              |
| 0,1740 % VW BANK 17/20.11.19 R.393 IHS<br>MTN (DE000A2GSMEO) . . . . .                             | EUR                           | 59 000  |                                          |                      | % 100,4670 | 59 275 530,00         | 0,54                              |
| 0,0000 % WPP Finance 2013 17/18.05.20<br>MTN (XS1612940988) . . . . .                              | EUR                           | 14 000  | 7 280                                    |                      | % 100,0240 | 14 003 360,00         | 0,13                              |
| 0,1270 % WPP Finance 2013 18/20.03.22<br>MTN (XS1794195724) . . . . .                              | EUR                           | 14 580  | 14 580                                   |                      | % 99,6490  | 14 528 824,20         | 0,13                              |
| 2,9644 % Allstate 18/29.03.23 (US020002BF73) . . . . .                                             | USD                           | 18 045  | 18 045                                   |                      | % 100,3260 | 15 539 765,41         | 0,14                              |
| 2,8456 % American Express 18/17.05.21<br>(US025816BV03) . . . . .                                  | USD                           | 18 701  | 18 701                                   |                      | % 100,2350 | 16 090 083,56         | 0,15                              |
| 3,3617 % ANZ New Zealand (Intl.) (LB)<br>17/25.01.22 MTN Reg S (US00182FBD78) . . . . .            | USD                           | 7 000   |                                          |                      | % 101,1210 | 6 075 939,91          | 0,06                              |
| 3,1258 % Bank of China (Singapur Branch)<br>17/11.05.20 MTN (XS1608002082) . . . . .               | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,0940 | 21 479 399,14         | 0,20                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                                 | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR   | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-------------------------|-----------------------------------|
| 3,9625 % Barclays 17/10.01.23 (US06738EAT29) . . . . .                                                | USD                           | 15 000  |                                          |                      | % 101,5520 | 13 075 364,81           | 0,12                              |
| 2,7973 % Barclays Bank 18/11.01.21 (US06739FJK84) . . . . .                                           | USD                           | 20 510  | 20 510                                   |                      | % 99,8440  | 17 577 686,18           | 0,16                              |
| 3,2047 % BP Capital Markets 16/16.09.21<br>(US05565QDE52) . . . . .                                   | USD                           | 8 000   |                                          |                      | % 101,6930 | 6 983 210,30            | 0,06                              |
| 2,9759 % BP Capital Markets 17/19.09.22<br>(US05565QDO82) . . . . .                                   | USD                           | 32 310  |                                          |                      | % 100,8950 | 27 982 124,03           | 0,26                              |
| 2,9706 % Campbell Soup 18/15.03.21<br>(US134429BC21) . . . . .                                        | USD                           | 42 187  | 42 187                                   |                      | % 99,8700  | 36 164 941,55           | 0,33                              |
| 3,3909 % Citigroup 16/08.12.21 (US172967LB51) . . . . .                                               | USD                           | 10 000  |                                          |                      | % 101,3990 | 8 703 776,82            | 0,08                              |
| 2,9571 % CVS Health 18/09.03.20 (US126650DB34) . . . . .                                              | USD                           | 22 059  | 22 059                                   |                      | % 100,4090 | 19 012 207,13           | 0,17                              |
| 3,0471 % CVS Health 18/09.03.21 (US126650DD99) . . . . .                                              | USD                           | 23 077  | 23 077                                   |                      | % 100,4200 | 19 891 779,74           | 0,18                              |
| 3,6056 % Ford Motor Credit 17/28.03.22<br>(US345397YJ68) . . . . .                                    | USD                           | 8 330   |                                          |                      | % 101,0560 | 7 225 720,86            | 0,07                              |
| 2,8928 % General Mills 18/16.04.21 (US370334CB82) . . . . .                                           | USD                           | 16 792  | 16 792                                   |                      | % 100,0390 | 14 419 355,26           | 0,13                              |
| 3,3628 % General Mills 18/17.10.23 (US370334CC65) . . . . .                                           | USD                           | 18 182  | 18 182                                   |                      | % 100,8090 | 15 733 126,51           | 0,14                              |
| 3,5156 % Horse Gallop Finance 18/28.06.21<br>MTN (XS1831431660) . . . . .                             | USD                           | 1 400   | 1 400                                    |                      | % 100,3450 | 1 205 862,66            | 0,01                              |
| 3,1090 % ICBC (Luxembourg Branch) 17/12.10.20<br>MTN (XS1692890343) . . . . .                         | USD                           | 31 500  |                                          |                      | % 100,0400 | 27 049 442,06           | 0,25                              |
| 3,0656 % Industrial Com.Bk.China (Iond Br)<br>18/14.06.21 MTN (XS1830984628) . . . . .                | USD                           | 20 000  | 20 000                                   |                      | % 99,8990  | 17 150 042,92           | 0,16                              |
| 3,4844 % ING Groep 17/29.03.22 (US456837AJ28) . . . . .                                               | USD                           | 8 060   |                                          |                      | % 101,6450 | 7 032 263,52            | 0,06                              |
| 3,2595 % JPMorgan Chase & Co. 17/25.04.23<br>(US46647PAD87) . . . . .                                 | USD                           | 20 160  |                                          |                      | % 100,6540 | 17 417 893,91           | 0,16                              |
| 3,1495 % Mitsubishi UFJ Financial Group<br>17/25.07.22 (US606822AQ75) . . . . .                       | USD                           | 36 000  |                                          |                      | % 100,2560 | 30 980 394,85           | 0,28                              |
| 3,2594 % Mizuho Financial Group 17/28.02.22<br>(US60687YAJ82) . . . . .                               | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,8450 | 17 312 446,35           | 0,16                              |
| 3,5831 % Morgan Stanley 17/08.05.24 MTN<br>(US61744YAG35) <sup>3)</sup> . . . . .                     | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 101,0430 | 21 683 047,21           | 0,20                              |
| 3,5387 % Morgan Stanley 17/20.01.22 MTN<br>(US61746BEE20) . . . . .                                   | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 101,2270 | 17 378 025,75           | 0,16                              |
| 3,2916 % Morgan Stanley 17/22.07.22<br>(US61744YAJ73) . . . . .                                       | USD                           | 15 000  |                                          |                      | % 100,6950 | 12 965 021,46           | 0,12                              |
| 2,9025 % Morgan Stanley 18/10.02.21<br>(US61744YAM03) . . . . .                                       | USD                           | 40 000  | 40 000                                   |                      | % 100,1190 | 34 375 622,32           | 0,32                              |
| 3,3556 % MUFG Bank 15/14.09.18 Reg S<br>(USJ04306AB22) . . . . .                                      | USD                           | 9 000   |                                          |                      | % 100,1770 | 7 738 995,71            | 0,07                              |
| 3,6572 % QNB Finance 18/31.05.21 MTN<br>(XS1824431313) . . . . .                                      | USD                           | 30 960  | 30 960                                   |                      | % 100,3410 | 26 665 728,41           | 0,24                              |
| 2,7488 % Royal Bank of Canada 18/30.04.21<br>MTN (US78013XKH07) <sup>3)</sup> . . . . .               | USD                           | 40 000  | 40 000                                   |                      | % 99,9860  | 34 329 957,08           | 0,32                              |
| 3,8851 % Royal Bank of Scotland Group<br>18/25.06.24 (US780097BH35) . . . . .                         | USD                           | 18 824  | 18 824                                   |                      | % 99,7880  | 16 123 685,08           | 0,15                              |
| 3,4613 % Standard Chartered 16/19.08.19<br>MTN Reg S (XS1480699567) . . . . .                         | USD                           | 16 250  |                                          |                      | % 100,8270 | 14 063 851,93           | 0,13                              |
| 3,3073 % Sumitomo Mitsui Financial Group<br>17/11.01.22 (US86562MAL46) . . . . .                      | USD                           | 18 000  |                                          |                      | % 100,9700 | 15 600 515,02           | 0,14                              |
| 3,2925 % UBS Group Funding (Switzerland)<br>17/15.08.23 Reg S (USH4209UAF33) . . . . .                | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 99,9120  | 21 440 343,35           | 0,20                              |
| 2,8416 % United Overseas Bk Singapore 18/23.04.21<br>MTN Reg S (US91127LAB62) <sup>3)</sup> . . . . . | USD                           | 26 670  | 26 670                                   |                      | % 100,1910 | 22 936 428,93           | 0,21                              |
| 3,3081 % Vodafone Group 18/16.01.24<br>(US92857WBN92) . . . . .                                       | USD                           | 21 186  | 21 186                                   |                      | % 99,6780  | 18 126 850,71           | 0,17                              |
| 3,0456 % Westpac Banking 17/28.06.22<br>(US961214DR19) . . . . .                                      | USD                           | 36 000  |                                          |                      | % 100,2420 | 30 976 068,67           | 0,28                              |
| 2,6225 % Westpac Banking 18/15.05.20<br>(US961214DY69) . . . . .                                      | USD                           | 14 286  | 14 286                                   |                      | % 99,8990  | 12 250 275,66           | 0,11                              |
| 3,0625 % Westpac Banking 18/15.05.23<br>(US961214EA74) . . . . .                                      | USD                           | 25 000  | 25 000                                   |                      | % 99,8780  | 21 433 047,21           | 0,20                              |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>                     |                               |         |                                          |                      |            | <b>1 551 082 879,21</b> | <b>14,23</b>                      |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                                                       |                               |         |                                          |                      |            |                         |                                   |
| 2,9491 % A.N.Z. Banking Group 17/09.11.22<br>MTN 144a (US05252ACZ21) . . . . .                        | USD                           | 22 060  |                                          |                      | % 99,6950  | 18 877 868,67           | 0,17                              |
| 3,0412 % A.N.Z. Banking Group 17/19.05.22<br>MTN 144a (US05252ACV17) . . . . .                        | USD                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,2340 | 25 811 330,47           | 0,24                              |
| 2,7654 % ABN AMRO Bank 18/19.01.21 MTN<br>144a (US00084DAR17) . . . . .                               | USD                           | 32 000  | 32 000                                   |                      | % 99,9150  | 27 444 463,52           | 0,25                              |
| 2,7970 % AIG Global Funding 18/25.06.21<br>144a (US00138CAH16) . . . . .                              | USD                           | 12 058  | 12 058                                   |                      | % 100,0142 | 10 351 679,15           | 0,10                              |
| 2,7644 % Allstate 18/29.03.21 (US020002BE09) . . . . .                                                | USD                           | 9 730   | 9 730                                    |                      | % 99,9780  | 8 350 093,91            | 0,08                              |
| 2,9694 % American Express 18/27.02.23<br>(US025816BT56) . . . . .                                     | USD                           | 50 000  | 50 000                                   |                      | % 99,9310  | 42 888 841,20           | 0,39                              |
| 2,8691 % Apple 17/09.02.22 (US037833CN89) . . . . .                                                   | USD                           | 16 000  |                                          |                      | % 101,2100 | 13 900 085,84           | 0,13                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                   | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|-----------------------------------|
| 3,2644 % AT & T 15/30.06.20 (US00206RCK68) . . . . .                                    | USD                           | 14 200  |                                          |                      | % 101,0030 | 12 311 095,28         | 0,11                              |
| 3,2450 % AT & T 18/15.02.23 Reg S<br>(USU04644CK19) . . . . .                           | USD                           | 18 460  | 18 460                                   |                      | % 100,3380 | 15 899 051,33         | 0,15                              |
| 3,2225 % B.A.T. Capital 17/15.08.22 144a<br>(US05526DAW56) . . . . .                    | USD                           | 17 860  |                                          |                      | % 100,4240 | 15 395 473,30         | 0,14                              |
| 3,1780 % Bank of America 14/01.04.19<br>MTN (US06051GFE44) . . . . .                    | USD                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,4780 | 8 624 721,03          | 0,08                              |
| 2,9580 % Bank of America 17/01.10.21<br>MTN (US06051GGU76) . . . . .                    | USD                           | 40 000  |                                          |                      | % 100,2260 | 34 412 360,52         | 0,32                              |
| 3,0216 % Bank of America 17/21.07.21<br>MTN (US06051GGN34) . . . . .                    | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,3670 | 17 230 386,27         | 0,16                              |
| 3,3592 % Bank of America 17/24.04.23<br>MTN (US06051GGJ22) . . . . .                    | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,8970 | 21 651 716,74         | 0,20                              |
| 2,7416 % Bank of America 18/23.01.22<br>(US06051GGX16) . . . . .                        | USD                           | 22 045  | 22 045                                   |                      | % 99,4370  | 18 816 211,72         | 0,17                              |
| 2,7806 % Bank of Montreal 17/15.06.20<br>MTN (US06367TYM60) . . . . .                   | USD                           | 16 000  |                                          |                      | % 100,2900 | 13 773 733,91         | 0,13                              |
| 2,9592 % Bank of Nova Scotia 17/07.03.22<br>(US064159JF41) . . . . .                    | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,2840 | 17 216 137,34         | 0,16                              |
| 2,9459 % Bank of Nova Scotia 17/19.09.22<br>(US064159KE56) . . . . .                    | USD                           | 50 000  |                                          |                      | % 100,1310 | 42 974 678,11         | 0,39                              |
| 3,0887 % Banque Fédérative Crédit Mu.<br>17/20.07.22 MTN 144a (US06675FAN78) . . . . .  | USD                           | 8 700   |                                          |                      | % 100,1690 | 7 480 431,76          | 0,07                              |
| 4,4625 % Barclays 16/10.08.21 (US06738EAR62) . . . . .                                  | USD                           | 11 000  |                                          |                      | % 103,6460 | 9 786 317,60          | 0,09                              |
| 3,3451 % Bayer US Finance II 18/15.12.23<br>144A (US07274NAG88) . . . . .               | USD                           | 22 905  | 22 905                                   |                      | % 99,9450  | 19 650 130,69         | 0,18                              |
| 2,9651 % Bayer US Finance II 18/25.06.21<br>144a (US07274NAC74) . . . . .               | USD                           | 24 755  | 24 755                                   |                      | % 100,1070 | 21 271 663,39         | 0,20                              |
| 3,3438 % Becton, Dickinson & Co. 17/06.06.22<br>(US075887BU29) . . . . .                | USD                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,2500 | 8 605 150,21          | 0,08                              |
| 3,2094 % Becton, Dickinson & Co. 18/29.12.20<br>(US075887CF43) . . . . .                | USD                           | 28 296  | 28 296                                   |                      | % 99,9000  | 24 264 123,61         | 0,22                              |
| 3,0313 % BNZ Int. Funding (London B.)<br>17/21.02.20 MTN 144a (US05579HAF91) . . . . .  | USD                           | 6 000   |                                          |                      | % 100,4840 | 5 175 141,63          | 0,05                              |
| 3,5494 % BPCE 17/22.05.22 144a (US05583JAB89) . . . . .                                 | USD                           | 10 000  |                                          |                      | % 101,3910 | 8 703 090,13          | 0,08                              |
| 3,0547 % Canadian Imperial Bank Comm.<br>17/16.06.22 (US136069TZ40) . . . . .           | USD                           | 36 000  |                                          |                      | % 100,5060 | 31 057 648,07         | 0,29                              |
| 3,1831 % Capital One National Association<br>17/08.08.22 (US14042RHB06) . . . . .       | USD                           | 36 000  |                                          |                      | % 99,7000  | 30 808 583,69         | 0,28                              |
| 2,9038 % Caterpillar Financial Services<br>17/06.06.22 S.I MTN (US14913QAB59) . . . . . | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,5080 | 21 568 240,34         | 0,20                              |
| 2,8400 % Caterpillar Financial Services<br>18/15.05.23 MTN (US14913Q2M07) . . . . .     | USD                           | 20 000  | 20 000                                   |                      | % 99,8240  | 17 137 167,38         | 0,16                              |
| 3,5529 % Citigroup 16/02.08.21 (US172967KW08) . . . . .                                 | USD                           | 8 000   |                                          |                      | % 101,7640 | 6 988 085,84          | 0,06                              |
| 3,4206 % Citigroup 17/17.05.24 (US172967LL34) . . . . .                                 | USD                           | 24 000  |                                          |                      | % 100,4540 | 20 694 386,27         | 0,19                              |
| 3,3092 % Citigroup 17/24.07.23 (US172967LN99) . . . . .                                 | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,1320 | 17 190 042,92         | 0,16                              |
| 3,3195 % Citigroup 17/25.04.22 (US172967LH22) . . . . .                                 | USD                           | 16 130  |                                          |                      | % 100,8290 | 13 960 272,70         | 0,13                              |
| 3,1294 % Citizens Bank 17/26.05.22 MTN<br>(US17401QAM33) . . . . .                      | USD                           | 34 000  |                                          |                      | % 99,8000  | 29 126 180,26         | 0,27                              |
| 3,4880 % Credit Agricole (London Br.)<br>16/01.07.21 MTN Reg S (US22532MAS17) . . . . . | USD                           | 4 000   |                                          |                      | % 101,9400 | 3 500 085,84          | 0,03                              |
| 3,5356 % Credit Suisse Group 17/14.12.23<br>144a (US225401AE85) . . . . .               | USD                           | 8 890   |                                          |                      | % 100,4340 | 7 664 019,40          | 0,07                              |
| 3,1438 % CW Bank of Australia 16/06.09.21<br>MTN Reg S (US2027A1HX82) . . . . .         | USD                           | 16 000  |                                          |                      | % 100,8960 | 13 856 961,37         | 0,13                              |
| 3,0263 % CW Bank of Australia 17/10.03.22<br>MTN 144a (US2027A0JL44) . . . . .          | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,3410 | 17 225 922,75         | 0,16                              |
| 3,0147 % CW Bank of Australia 17/18.09.22<br>MTN 144a (US2027A0JS96) . . . . .          | USD                           | 36 000  |                                          |                      | % 100,0140 | 30 905 613,73         | 0,28                              |
| 3,2288 % eBay 17/30.01.23 (US278642AT03) . . . . .                                      | USD                           | 17 145  |                                          |                      | % 100,6230 | 14 808 423,48         | 0,14                              |
| 3,4337 % Ford Motor Credit 17/03.08.22<br>(US345397YP29) . . . . .                      | USD                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,2110 | 25 805 407,73         | 0,24                              |
| 3,3306 % Ford Motor Credit 17/09.01.20<br>(US345397YF47) . . . . .                      | USD                           | 7 500   |                                          |                      | % 100,7330 | 6 484 957,08          | 0,06                              |
| 2,8346 % Ford Motor Credit 18/05.04.21<br>(US345397YY36) . . . . .                      | USD                           | 16 154  | 16 154                                   |                      | % 100,3060 | 13 908 524,67         | 0,13                              |
| 3,1631 % General Motors 17/07.08.20<br>(US37045VAM28) . . . . .                         | USD                           | 10 800  |                                          |                      | % 100,4500 | 9 312 103,00          | 0,09                              |
| 3,2716 % General Motors Financial 17/13.04.20<br>(US37045XBU90) . . . . .               | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,6750 | 21 604 077,25         | 0,20                              |
| 3,8977 % General Motors Financial 17/14.01.22<br>(US37045XBR61) . . . . .               | USD                           | 16 000  |                                          |                      | % 102,3710 | 14 059 536,48         | 0,13                              |
| 3,3108 % General Motors Financial 18/05.01.23<br>(US37045XCE40) . . . . .               | USD                           | 36 000  | 36 000                                   |                      | % 100,2130 | 30 967 107,30         | 0,28                              |
| 3,1326 % Goldman Sachs Group 13.12.19<br>(US38145GAK67) . . . . .                       | USD                           | 12 000  |                                          |                      | % 100,5400 | 10 356 051,50         | 0,10                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                       | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in<br>EUR | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|---------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|-----------------------------------|
| 3,3678 % Goldman Sachs Group 17/05.06.23<br>(US38141GWK65) .....                            | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,4740 | 21 560 944,21         | 0,20                              |
| 3,0670 % Goldman Sachs Group 17/27.12.20<br>(US38141GWF70) .....                            | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,3000 | 17 218 884,12         | 0,16                              |
| 3,0800 % Goldman Sachs Group 18/23.02.23<br>(US38141GWU48) .....                            | USD                           | 36 700  | 36 700                                   |                      | % 99,5470  | 31 359 441,20         | 0,29                              |
| 2,8312 % Harley Davidson Fin. Serv.18/21.05.20<br>144a MTN (US41284VAA08) .....             | USD                           | 19 048  | 19 048                                   |                      | % 100,1770 | 16 379 154,47         | 0,15                              |
| 3,1080 % Hyundai Capital America 17/03.04.20<br>MTN 144a (US44891AAN72) .....               | USD                           | 21 000  |                                          |                      | % 100,1000 | 18 043 776,82         | 0,17                              |
| 3,3347 % Hyundai Capital America 17/18.09.20<br>MTN Reg S (US44891CAP86) .....              | USD                           | 9 796   |                                          |                      | % 100,6430 | 8 462 654,25          | 0,08                              |
| 3,1463 % Hyundai Capital America 18/12.03.21<br>MTN 144a (US44891AAT43) .....               | USD                           | 19 737  | 19 737                                   |                      | % 100,0100 | 16 943 325,06         | 0,16                              |
| 2,8071 % Jackson Nation. Lif. Glo. Fun.18/11.06.21<br>MTN 144a (US46849LTA97) .....         | USD                           | 23 530  | 23 530                                   |                      | % 100,0430 | 20 206 109,79         | 0,19                              |
| 3,3166 % JPMorgan Chase & Co. 15/23.01.20<br>(US46625HKB59) .....                           | USD                           | 15 000  |                                          |                      | % 101,1030 | 13 017 553,65         | 0,12                              |
| 3,3477 % JPMorgan Chase & Co. 16/15.01.23<br>(US48128BAC54) .....                           | USD                           | 10 000  |                                          |                      | % 100,8500 | 8 656 652,36          | 0,08                              |
| 2,9803 % JPMorgan Chase & Co. 17/01.06.21<br>(US46647PAG19) .....                           | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,3760 | 17 231 931,33         | 0,16                              |
| 2,8771 % JPMorgan Chase & Co. 17/09.03.21<br>(US46647PAC05) .....                           | USD                           | 25 000  |                                          |                      | % 100,2710 | 21 517 381,97         | 0,20                              |
| 3,0916 % JPMorgan Chase & Co. 18/23.04.24<br>(US46647PAQ90) .....                           | USD                           | 30 000  | 30 000                                   |                      | % 99,4060  | 25 598 111,59         | 0,23                              |
| 2,9225 % Kraft Heinz Foods 17/10.02.21<br>(US50077LAP13) .....                              | USD                           | 20 090  |                                          |                      | % 100,1340 | 17 267 743,00         | 0,16                              |
| 3,1725 % Kraft Heinz Foods 17/10.08.22<br>(US50077LAQ95) .....                              | USD                           | 31 370  |                                          |                      | % 100,7520 | 27 129 529,96         | 0,25                              |
| 3,3394 % Macquarie Group 17/28.11.23<br>MTN 144a (US55608JAJ79) .....                       | USD                           | 78 000  |                                          |                      | % 100,0640 | 66 995 639,48         | 0,61                              |
| 3,4726 % Mizuho Financial Group 16/13.09.21<br>(US60687YAF60) .....                         | USD                           | 21 000  |                                          |                      | % 101,4550 | 18 288 025,75         | 0,17                              |
| 3,2071 % Mizuho Financial Group 17/11.09.22<br>(US60687YAN94) <sup>3)</sup> .....           | USD                           | 34 975  |                                          |                      | % 100,5000 | 30 171 566,52         | 0,28                              |
| 2,9390 % National Australia Bank 18/12.04.23<br>MTN 144a (US6325C0DU23) <sup>3)</sup> ..... | USD                           | 36 000  | 36 000                                   |                      | % 99,4700  | 30 737 510,73         | 0,28                              |
| 3,2316 % Nissan Motor Acceptance 17/13.01.22<br>144a (US654740AV92) .....                   | USD                           | 7 890   |                                          |                      | % 101,1770 | 6 852 244,89          | 0,06                              |
| 2,9916 % Nissan Motor Acceptance 17/13.07.22<br>144a (US654740BA63) .....                   | USD                           | 30 000  |                                          |                      | % 100,0110 | 25 753 905,58         | 0,24                              |
| 3,0256 % Nissan Motor Acceptance 17/28.09.22<br>144a (US654740BE85) .....                   | USD                           | 31 820  |                                          |                      | % 100,1170 | 27 345 261,29         | 0,25                              |
| 5,9771 % Petróleos Mexicanos 18/11.03.22<br>(US71654QCF72) <sup>3)</sup> .....              | USD                           | 7 620   | 7 620                                    |                      | % 106,8030 | 6 985 741,29          | 0,06                              |
| 3,0888 % QUALCOMM 17/30.01.23 (US747525AS26) .....                                          | USD                           | 17 950  |                                          |                      | % 99,7680  | 15 371 979,40         | 0,14                              |
| 2,8338 % Royal Bank of Canada 15/06.03.20<br>MTN (US78012KCC99) .....                       | USD                           | 15 000  |                                          |                      | % 100,4770 | 12 936 952,79         | 0,12                              |
| 2,9447 % Siemens Financieringsmaatsch.<br>17/16.03.22 144a (US82620KAQ67) .....             | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 100,8710 | 17 316 909,87         | 0,16                              |
| 3,2256 % State Street 15/18.08.20 (US857477AR48) .....                                      | USD                           | 12 000  |                                          |                      | % 101,4930 | 10 454 214,59         | 0,10                              |
| 3,0928 % Sumitomo Mitsui Financial Group<br>18/17.01.23 (US86562MAW01) <sup>3)</sup> .....  | USD                           | 32 200  | 32 200                                   |                      | % 99,9640  | 27 629 534,76         | 0,25                              |
| 2,7813 % Tyson Foods 17/21.08.20 (US902494BE29) .....                                       | USD                           | 15 000  |                                          |                      | % 99,9850  | 12 873 605,15         | 0,12                              |
| 3,5500 % UBS Group Funding (Switzerland)<br>17/23.05.23 144a (US90352JAB98) .....           | USD                           | 20 000  |                                          |                      | % 101,1080 | 17 357 596,57         | 0,16                              |
| 3,3347 % Verizon Communications 17/16.03.22<br>(US92343VDX91) .....                         | USD                           | 16 130  |                                          |                      | % 101,5000 | 14 053 175,97         | 0,13                              |
| 3,4692 % Wells Fargo & Co. 17/24.01.23<br>(US949746SL69) .....                              | USD                           | 15 000  |                                          |                      | % 101,3110 | 13 044 334,76         | 0,12                              |
| 3,1873 % Westpac Banking 17/11.01.22<br>(US961214DH37) .....                                | USD                           | 15 250  |                                          |                      | % 100,9570 | 13 215 401,29         | 0,12                              |
| 2,9073 % Westpac Banking 17/11.01.23<br>(US961214DT74) .....                                | USD                           | 27 275  |                                          |                      | % 99,3110  | 23 250 708,37         | 0,21                              |
| <b>Nicht notierte Wertpapiere</b>                                                           |                               |         |                                          |                      |            | <b>497 910 831,36</b> | <b>4,57</b>                       |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                                             |                               |         |                                          |                      |            |                       |                                   |
| 0,0000 % ArcelorMittal 16.07.18 (FR0124855018) .....                                        | EUR                           | 40 000  | 40 000                                   |                      | % 100,0023 | 40 000 920,00         | 0,37                              |
| 0,0000 % ArcelorMittal 20.08.18 (FR0124883267) .....                                        | EUR                           | 20 000  | 20 000                                   |                      | % 100,0029 | 20 000 580,00         | 0,18                              |
| 0,0000 % ArcelorMittal 26.09.18 (FR0125094138) .....                                        | EUR                           | 40 000  | 40 000                                   |                      | % 99,9920  | 39 996 800,00         | 0,37                              |
| 0,0000 % Deutsche Bank (London Br.) 17/18.09.18<br>(XS1739868310) .....                     | EUR                           | 5 000   |                                          |                      | % 100,0575 | 5 002 875,00          | 0,05                              |
| 0,0000 % DXC Capital Funding 10.07.18<br>(XS1751014629) .....                               | EUR                           | 36 000  | 36 000                                   |                      | % 100,0051 | 36 001 836,00         | 0,33                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                                                      | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand        | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs            | Kurswert<br>in<br>EUR   | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------|-------------------------|-----------------------------------|
| 0,0000 % Fresenius Finance Ireland 23.10.18<br>(DE000A2LSCF8) .....                                        | EUR                           | 16 000         | 16 000                                   |                      | % 99,9916       | 15 998 656,00           | 0,15                              |
| 0,0000 % HeidelbergCement 06.07.18<br>(DE000A2LZSW4) .....                                                 | EUR                           | 20 000         | 20 000                                   |                      | % 100,0002      | 20 000 040,00           | 0,18                              |
| 0,0000 % Syngenta Finance 09.07.18<br>(XS1836087384) .....                                                 | EUR                           | 40 000         | 40 000                                   |                      | % 99,9979       | 39 999 160,00           | 0,37                              |
| 0,0000 % Syngenta Finance 25.07.18 (XS1847811152)                                                          | EUR                           | 50 000         | 50 000                                   |                      | % 99,9916       | 49 995 800,00           | 0,46                              |
| 0,0000 % Syngenta Luxembourg Finance<br>23.07.18 (XS1844155694) .....                                      | EUR                           | 40 000         | 40 000                                   |                      | % 99,9898       | 39 995 920,00           | 0,37                              |
| 0,0000 % thyssenkrupp 03.09.18 (DE000A2GYFR4) .....                                                        | EUR                           | 14 000         | 14 000                                   |                      | % 99,9835       | 13 997 690,00           | 0,13                              |
| 0,0000 % Uniper 02.08.18 (XS1852086054) .....                                                              | EUR                           | 25 000         | 25 000                                   |                      | % 99,9979       | 24 999 475,00           | 0,23                              |
| 0,0000 % Uniper 18.07.18 (XS1841487140) .....                                                              | EUR                           | 15 000         | 15 000                                   |                      | % 99,9997       | 14 999 955,00           | 0,14                              |
| 0,0000 % Vodafone Group 06.07.18 (XS1646519675) .....                                                      | EUR                           | 30 000         |                                          |                      | % 100,0034      | 30 001 020,00           | 0,28                              |
| 0,0000 % Volkswagen Int. Finance 09.11.18<br>(XS1720939906) .....                                          | EUR                           | 9 000          |                                          |                      | % 100,0520      | 9 004 680,00            | 0,08                              |
| 0,0000 % Volkswagen Int. Finance 28.01.19<br>(XS1766808908) .....                                          | EUR                           | 12 000         | 12 000                                   |                      | % 100,0731      | 12 008 772,00           | 0,11                              |
| 3,1078 % Mizuho Financial Group 18/05.03.23<br>(US60687YAQ26) <sup>3)</sup> .....                          | USD                           | 50 000         | 50 000                                   |                      | % 99,9950       | 42 916 309,01           | 0,39                              |
| 3,0494 % National Australia Bank 17/22.05.22<br>MTN 144a (US6325C0DQ11) .....                              | USD                           | 25 000         |                                          |                      | % 100,3960      | 21 544 206,01           | 0,20                              |
| 2,7506 % Skandinaviska Enskilda Banken 18/17.05.21<br>MTN 144a (US83051GAH11) <sup>3)</sup> .....          | USD                           | 25 000         | 25 000                                   |                      | % 99,9390       | 21 446 137,34           | 0,20                              |
| <b>Investmentanteile</b>                                                                                   |                               |                |                                          |                      |                 | <b>112 980 864,39</b>   | <b>1,04</b>                       |
| <b>Gruppeneigene Investmentanteile</b>                                                                     |                               |                |                                          |                      |                 | <b>112 980 864,39</b>   | <b>1,04</b>                       |
| Deutsche Institutional Money plus IC<br>(LU0099730524) (0,100%) .....                                      | Stück                         | 7 000          |                                          |                      | EUR 13 975,0700 | 97 825 490,00           | 0,90                              |
| DGLS - Deutsche Managed Euro Ultra Short FI<br>Fund (IE00B98GX142) (0,200%) .....                          | Stück                         | 498            |                                          |                      | EUR 10 035,5000 | 4 996 374,39            | 0,05                              |
| DWS Emerging Markets Bonds (Short) RC<br>(LU1623919500) (0,200%) .....                                     | Stück                         | 100 000        |                                          |                      | EUR 101,5900    | 10 159 000,00           | 0,09                              |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>                                                                            |                               |                |                                          |                      |                 | <b>9 189 383 739,85</b> | <b>84,34</b>                      |
| <b>Derivate</b><br>Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt<br>es sich um verkaufte Positionen |                               |                |                                          |                      |                 |                         |                                   |
| <b>Devisen-Derivate</b>                                                                                    |                               |                |                                          |                      |                 | <b>-75 766 034,52</b>   | <b>-0,70</b>                      |
| <b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>                                                                    |                               |                |                                          |                      |                 |                         |                                   |
| <b>Offene Positionen</b>                                                                                   |                               |                |                                          |                      |                 |                         |                                   |
| USD/EUR 2 725,00 Mio. ....                                                                                 |                               |                |                                          |                      |                 | -75 766 034,52          | -0,70                             |
| <b>Swaps</b>                                                                                               |                               |                |                                          |                      |                 | <b>939 629,10</b>       | <b>0,01</b>                       |
| <b>Credit Default Swaps</b>                                                                                |                               |                |                                          |                      |                 |                         |                                   |
| <b>Protection Seller</b>                                                                                   |                               |                |                                          |                      |                 |                         |                                   |
| Barclays Bank PLC / 100 BP (CITIGR GM GB)<br>20.12.18 (OTC) .....                                          | EUR                           | 25 000         |                                          |                      |                 | 94 539,94               | 0,00                              |
| iTraxx Europe 3 Years / 100 BP (BARC PLC<br>GB) 20.06.20 (OTC) .....                                       | EUR                           | 30 000         |                                          |                      |                 | 446 661,53              | 0,00                              |
| iTraxx Europe 5 Years / 100 BP (BARC PLC<br>GB) 20.06.20 (OTC) .....                                       | EUR                           | 25 000         |                                          |                      |                 | 361 991,69              | 0,00                              |
| UniCredit S.p.A. / 100 BP (SOCGEN MC FR)<br>20.12.18 (OTC) .....                                           | EUR                           | 25 000         |                                          |                      |                 | 36 435,94               | 0,00                              |
| <b>Bankguthaben</b>                                                                                        |                               |                |                                          |                      |                 | <b>1 411 972 213,79</b> | <b>12,96</b>                      |
| <b>Verwahrstelle (täglich fällig)</b>                                                                      |                               |                |                                          |                      |                 |                         |                                   |
| EUR - Guthaben. ....                                                                                       | EUR                           | 272 055 633,04 |                                          |                      | % 100           | 272 055 633,04          | 2,50                              |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen .....                                                               | EUR                           | 106,58         |                                          |                      | % 100           | 106,58                  | 0,00                              |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen                                                                         |                               |                |                                          |                      |                 |                         |                                   |
| Japanische Yen .....                                                                                       | JPY                           | 50 097,00      |                                          |                      | % 100           | 388,33                  | 0,00                              |
| US Dollar .....                                                                                            | USD                           | 1 067 240,00   |                                          |                      | % 100           | 916 085,84              | 0,01                              |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                          | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Bestand        | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs  | Kurswert<br>in<br>EUR    | %-Anteil<br>am Fonds-<br>vermögen |
|--------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|----------------|------------------------------------------|----------------------|-------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Termingeld</b>                                                              |                               |                |                                          |                      |       |                          |                                   |
| EUR - Guthaben (Norddeutsche<br>Landesbank -Girozentrale-, Hannover) . . . . . | EUR                           | 989 000 000,00 |                                          |                      | % 100 | 989 000 000,00           | 9,08                              |
| EUR - Guthaben (Deutsche Bank AG,<br>Frankfurt am Main) . . . . .              | EUR                           | 150 000 000,00 |                                          |                      | % 100 | 150 000 000,00           | 1,38                              |
| <b>Rückzahlungsforderungen aus in Pension<br/>genommenen Wertpapieren</b>      |                               |                |                                          |                      |       | <b>357 909 075,00</b>    | <b>3,28</b>                       |
| BRR Ozime li Clo (DBK) 15.10.30 -0,2% . . . . .                                | EUR                           | 8 588          |                                          |                      | % 100 | 8 588 475,00             | 0,08                              |
| BRR Spain (DBK) 30.07.66 -0,45% . . . . .                                      | EUR                           | 113 430        |                                          |                      | % 100 | 113 430 000,00           | 1,04                              |
| BRR Spain (DBK) 30.07.66 -0,45% . . . . .                                      | EUR                           | 113 430        |                                          |                      | % 100 | 113 430 000,00           | 1,04                              |
| BRR Spain (DBK) 30.07.66 -0,45% . . . . .                                      | EUR                           | 113 430        |                                          |                      | % 100 | 113 430 000,00           | 1,04                              |
| BRR Toro European CLO (DBK) 15.07.30 -0,2% . . . . .                           | EUR                           | 9 031          |                                          |                      | % 100 | 9 030 600,00             | 0,08                              |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                                           |                               |                |                                          |                      |       | <b>12 627 558,52</b>     | <b>0,12</b>                       |
| Zinsansprüche . . . . .                                                        | EUR                           | 12 532 470,89  |                                          |                      | % 100 | 12 532 470,89            | 0,12                              |
| Sonstige Ansprüche . . . . .                                                   | EUR                           | 95 087,63      |                                          |                      | % 100 | 95 087,63                | 0,00                              |
| <b>Summe der Vermögensgegenstände <sup>1)</sup></b>                            |                               |                |                                          |                      |       | <b>10 972 832 216,26</b> | <b>100,71</b>                     |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                              |                               |                |                                          |                      |       | <b>-1 427 378,53</b>     | <b>-0,01</b>                      |
| Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen . . . . .                               | EUR                           | -1 130 184,86  |                                          |                      | % 100 | -1 130 184,86            | -0,01                             |
| Andere sonstige Verbindlichkeiten . . . . .                                    | EUR                           | -297 193,67    |                                          |                      | % 100 | -297 193,67              | 0,00                              |
| <b>Fondsvermögen</b>                                                           |                               |                |                                          |                      |       | <b>10 895 638 803,21</b> | <b>100,00</b>                     |

| Anteilwert bzw.<br>umlaufende Anteile | Stück<br>bzw. Whg. | Anteilwert in der<br>jeweiligen Whg. |
|---------------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| <b>Anteilwert</b>                     |                    |                                      |
| Klasse LC . . . . .                   | EUR                | 84,08                                |
| Klasse LD . . . . .                   | EUR                | 83,11                                |
| Klasse FC . . . . .                   | EUR                | 84,19                                |
| Klasse IC . . . . .                   | EUR                | 84,21                                |
| Klasse FD . . . . .                   | EUR                | 83,63                                |
| Klasse TFC . . . . .                  | EUR                | 99,59                                |
| Klasse TFD . . . . .                  | EUR                | 99,58                                |
| <b>Umlaufende Anteile</b>             |                    |                                      |
| Klasse LC . . . . .                   | Stück              | 37 651 564,605                       |
| Klasse LD . . . . .                   | Stück              | 2 599 628,353                        |
| Klasse FC . . . . .                   | Stück              | 23 254 332,337                       |
| Klasse IC . . . . .                   | Stück              | 60 485 008,015                       |
| Klasse FD . . . . .                   | Stück              | 3 157 300,000                        |
| Klasse TFC . . . . .                  | Stück              | 1 932 163,411                        |
| Klasse TFD . . . . .                  | Stück              | 61 793,018                           |

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

### Marktschlüssel

#### Terminbörsen

OTC = Over the Counter

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 29.06.2018

|                          |     |            |       |   |
|--------------------------|-----|------------|-------|---|
| Japanische Yen . . . . . | JPY | 129,005000 | = EUR | 1 |
| US Dollar . . . . .      | USD | 1,165000   | = EUR | 1 |

# Deutsche Floating Rate Notes

## 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. Preisauskünfte Dritter werden durch andere Preisquellen, modellhafte Rechnungen oder durch andere geeignete Verfahren auf Plausibilität geprüft.

Die in diesem Bericht ausgewiesenen Anlagen werden in geringfügigem Umfang 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 280 578 438,28.

## 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<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Wertpapierbezeichnung                                                                  | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------|-----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------|-----------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>                                                    |                               |                          |                             | 0,0510 % Daimler Canada Finance 16/18.01.18<br>MTN (DE000A18VXA3) . . . . .            | EUR                           |                          | 10 000                      |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                                        |                               |                          |                             | 0,1690 % DekaBank DGZ 16/01.02.18<br>IHS MTN (XS1354256643) . . . . .                  | EUR                           |                          | 9 400                       |
| 1,2790 % A.P.Møller-Mærsk 16/18.03.19<br>MTN (XS1381690574) . . . . .                  | EUR                           |                          | 4 910                       | 0,5710 % Deutsche Bank 16/13.04.18<br>MTN (DE000DL19SS0) . . . . .                     | EUR                           |                          | 26 400                      |
| 0,1720 % Achmea Bank 15/18.05.18<br>MTN (XS1234553391) . . . . .                       | EUR                           |                          | 17 000                      | 0,1610 % Deutsche Hypothekenbank 16/11.01.18<br>S.457 IHS MTN (DE000DHY4572) . . . . . | EUR                           |                          | 12 000                      |
| 0,0000 % Air Liquide Finance 15/30.06.18<br>MTN (FR0012820835) . . . . .               | EUR                           |                          | 10 000                      | 0,0200 % Deutsche Hypothekenbank 16/26.01.18<br>S.459 IHS MTN (DE000DHY4598) . . . . . | EUR                           |                          | 30 000                      |
| 3,2500 % Allander 13/und. (XS0997535520) . . . . .                                     | EUR                           |                          | 21 950                      | 6,5000 % ENEL 13/10.01.74 (XS0954675129) . . . . .                                     | EUR                           | 10 000                   | 10 000                      |
| 0,0510 % Anheuser-Busch InBev 14/29.03.18<br>MTN (BE6265140077) . . . . .              | EUR                           |                          | 7 150                       | 3,5000 % ENI 10/29.01.18 MTN (XS0563739696) . . . . .                                  | EUR                           |                          | 10 600                      |
| 5,7500 % ArcelorMittal 12/29.03.18<br>MTN (XS0765621569) . . . . .                     | EUR                           |                          | 7 300                       | 0,1410 % FCE Bank 15/10.02.18 MTN<br>(XS1186131634) . . . . .                          | EUR                           |                          | 4 200                       |
| 0,5230 % AT & T 17/04.09.23 (XS1629866606) . . . . .                                   | EUR                           |                          | 22 160                      | 0,0000 % France 18/30.05.18 (FR0124747504) . . . . .                                   | EUR                           | 25 000                   | 25 000                      |
| 6,8750 % Aviva 08/22.05.38 MTN<br>(XS0364908375) . . . . .                             | EUR                           |                          | 28 000                      | 0,0000 % France B.T.F. 17/14.03.18<br>(FR0124584683) . . . . .                         | EUR                           |                          | 25 000                      |
| 0,1740 % B.A.T. International Finance<br>14/06.03.18 MTN (XS1043096400) . . . . .      | EUR                           |                          | 13 900                      | 4,6250 % Glencore Finance (Europe)<br>12/03.04.18 MTN (XS0767815599) . . . . .         | EUR                           | 10 000                   | 10 000                      |
| 0,5110 % Bank of America 06/28.03.18<br>MTN (XS0249443879) . . . . .                   | EUR                           |                          | 15 500                      | 0,1710 % Honeywell International<br>16/22.02.18 (XS1366026323) . . . . .               | EUR                           | 57 630                   | 70 700                      |
| 0,6710 % Bank of China 15/30.06.18<br>MTN (XS1253376518) . . . . .                     | EUR                           |                          | 11 200                      | 3,7500 % Hutchison Whampoa Europe<br>Finance (13) 13/und. (XS0930010524) . . . . .     | EUR                           |                          | 30 917                      |
| 0,0000 % Banque Fédérative Crédit Mu.<br>16/19.01.18 MTN (XS1346986752) . . . . .      | EUR                           |                          | 50 000                      | 6,1250 % ING Bank 08/29.05.23 MTN<br>(XS0366066149) . . . . .                          | EUR                           |                          | 21 400                      |
| 0,0790 % BMW Finance 16/29.01.18<br>MTN (XS1352958091) . . . . .                       | EUR                           |                          | 10 000                      | 0,2080 % Intesa Sanpaolo Bank Ireland<br>16/14.06.18 MTN (XS1434220627) . . . . .      | EUR                           |                          | 12 000                      |
| 0,0000 % BMW US Capital 15/20.04.18<br>MTN (DE000A1ZZ002) . . . . .                    | EUR                           |                          | 10 560                      | 0,2110 % Intesa Sanpaolo Bank Luxembourg<br>16/13.04.18 MTN (XS1395187641) . . . . .   | EUR                           |                          | 10 000                      |
| 0,3320 % BPCE 13/28.05.18 MTN<br>(FR0011496447) . . . . .                              | EUR                           |                          | 5 000                       | 0,0000 % Mercedes-Benz Japan 14/15.06.18<br>MTN (XS1153305435) . . . . .               | EUR                           |                          | 12 000                      |
| 0,0000 % Caixabank 06/09.01.18 PF<br>(ES0414970220) . . . . .                          | EUR                           |                          | 15 000                      | 0,0810 % National Australia Bank<br>13/24.01.18 MTN (XS0878868321) . . . . .           | EUR                           |                          | 5 000                       |
| 0,4375 % Carrefour Banque 14/21.03.18<br>(XS1047514408) . . . . .                      | EUR                           |                          | 25 000                      | 0,0000 % National Australia Bank<br>15/16.01.18 MTN (XS1167324596) . . . . .           | EUR                           |                          | 15 000                      |
| 0,0000 % Caterpillar International Finance<br>15/13.05.18 MTN (XS1232143310) . . . . . | EUR                           |                          | 5 700                       | 0,0710 % Norddt. Landesbank 15/21.03.18<br>IHS S.2012 (DE000NLB8JY1) . . . . .         | EUR                           |                          | 45 000                      |
| 1,0710 % Citigroup 04/10.02.19 (XS0185490934) . . . . .                                | EUR                           |                          | 13 800                      | 0,1710 % Nordea Bank 13/22.05.18<br>MTN (XS0935835313) . . . . .                       | EUR                           |                          | 10 000                      |
| 0,0000 % Coöperatieve Rabobank 16/15.01.18<br>MTN (XS1345314956) . . . . .             | EUR                           |                          | 16 600                      | 0,1710 % Nykredit Realkredit 17/01.10.22<br>S.DEC PF (DK0009516338) . . . . .          | EUR                           | 15 000                   | 15 000                      |
| 0,2750 % Covestro 16/10.03.18 MTN<br>(XS1377821464) . . . . .                          | EUR                           |                          | 19 550                      | 6,7500 % OMV 11/und. (XS0629626663) . . . . .                                          | EUR                           | 11 250                   | 18 900                      |
| 0,1550 % Daimler 16/09.03.18 MTN<br>(DE000A2AAL15) . . . . .                           | EUR                           |                          | 41 000                      | 7,8750 % Origin Energy Finance 11/16.06.71<br>(XS0615236774) . . . . .                 | EUR                           | 22 000                   | 22 000                      |
|                                                                                        |                               |                          |                             | 0,0000 % QNB Finance 17/18.05.18<br>MTN (XS1615214779) . . . . .                       | EUR                           |                          | 25 000                      |

## Deutsche Floating Rate Notes

| Wertpapierbezeichnung                                                     | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge |
|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------|-----------------------------|
| 6,9340 % Royal Bank of Scotland 08/09.04.18<br>MTN (XS0356705219) .....   | EUR                           |                          | 30 700                      |
| 0,2210 % Santander UK 16/12.02.18<br>S.B-1478 MTN (XS1363002459) .....    | EUR                           |                          | 18 000                      |
| 0,0000 % SBAB Bank 15/27.06.18 MTN<br>(XS1241559910) .....                | EUR                           |                          | 10 680                      |
| 0,2830 % Societe Generale 13/07.06.18<br>MTN (XS0940651432) .....         | EUR                           |                          | 6 400                       |
| 0,3510 % Swedbank 15/26.03.18 MTN<br>(XS1207477628) .....                 | EUR                           |                          | 5 000                       |
| 0,1620 % Volvo Treasury 16/03.05.18<br>MTN (XS1403265694) .....           | EUR                           | 5 000                    | 17 000                      |
| 0,1320 % Volvo Treasury 16/20.06.18<br>MTN (XS1435165045) .....           | EUR                           | 5 000                    | 17 000                      |
| 3,2450 % AT & T 17/14.02.23 (US00206REJ77) ..                             | USD                           |                          | 18 460                      |
| 2,0446 % Bank of Tokyo-Mitsubishi<br>15/05.03.18 Reg S (USJ0423YCA04) ... | USD                           |                          | 10 000                      |
| 3,2849 % QNB Finance 16/20.05.18<br>MTN (XS1405950129) .....              | USD                           |                          | 12 000                      |
| 2,3713 % Standard Chartered 15/17.04.18<br>Reg S (XS1219971857) .....     | USD                           |                          | 14 300                      |
| 1,8635 % Toronto-Dominion Bank 15/13.03.18<br>MTN (US89114QB239) .....    | USD                           |                          | 10 000                      |

### An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

#### Verzinsliche Wertpapiere

|                                                                                       |     |  |        |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-----|--|--------|
| 3,0281 % Baxalta 16/22.06.18 (US07177MAJ27) ..                                        | USD |  | 16 665 |
| 5,9771 % Petroleos Mexicanos (PEMEX)<br>16/11.03.22 MTN Reg S<br>(US71656MBN83) ..... | USD |  | 7 620  |
| 2,2236 % Siemens Financieringsmaatsch.<br>15/25.05.18 Reg S (USN82008AA63) .....      | USD |  | 7 500  |
| 1,9392 % Sumitomo Mitsui Banking<br>15/16.01.18 (US865622BP87) .....                  | USD |  | 12 000 |
| 2,3736 % Westpac Banking 15/25.05.18<br>(US961214CN14) .....                          | USD |  | 12 000 |

#### Nicht notierte Wertpapiere

#### Verzinsliche Wertpapiere

|                                                                                  |     |         |         |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----|---------|---------|
| 0,0000 % B.A.T. International Finance<br>22.01.18 (XS1743635440) .....           | EUR |         | 50 000  |
| 0,0000 % Casino, Guichard-Perrachon<br>16.04.18 (FR0124887169) .....             | EUR | 50 000  | 50 000  |
| 0,0000 % DXC Capital Funding 10.01.18<br>(XS1642635764) .....                    | EUR |         | 36 000  |
| 0,0000 % Electricité de France 13.03.18<br>(FR0124660079) .....                  | EUR |         | 40 000  |
| 0,0000 % Fresenius Finance Ireland<br>16.01.18 (DE000A2GTDQ1) .....              | EUR |         | 30 000  |
| 0,0000 % Fresenius Finance Ireland<br>18.06.18 (DE000A2GTET3) .....              | EUR | 25 000  | 25 000  |
| 0,0000 % HeidelbergCement 21.05.18<br>(DE000A16E062) .....                       | EUR | 50 000  | 50 000  |
| 0,0000 % Iberdrola Internationa 23.04.18<br>(XS1782638206) .....                 | EUR | 50 000  | 50 000  |
| 0,0000 % Iberdrola International<br>22.01.18 (XS1742282723) .....                | EUR |         | 80 000  |
| 0,0000 % Iberdrola International<br>22.02.18 (XS1756676364) .....                | EUR | 80 000  | 80 000  |
| 0,0000 % Kraft Heinz Foods 08.06.18<br>(XS1790937236) .....                      | EUR | 50 000  | 50 000  |
| 0,0000 % Kraft Heinz Foods 11.01.18<br>(XS1646902293) .....                      | EUR |         | 25 500  |
| 0,0000 % Kraft Heinz Foods 22.03.18<br>(XS1758539362) .....                      | EUR | 100 000 | 100 000 |
| 0,0000 % Kraft Heinz Foods 22.06.18<br>(XS1798888407) .....                      | EUR | 100 000 | 100 000 |
| 0,1710 % LeasePlan Corporation 18/11.01.22<br>S.MAR (XS1791592444) .....         | EUR | 48 000  | 48 000  |
| 0,0000 % Orange 03.01.18 (FR0124792856) .....                                    | EUR |         | 20 000  |
| 0,0000 % Qatar National Bank (London Branch)<br>22.01.18 CD (XS1743744499) ..... | EUR |         | 50 000  |

| Wertpapierbezeichnung                                                  | Stück<br>bzw. Whg.<br>in 1000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------|-----------------------------|
| 0,0000 % Repsol International Finance<br>09.02.18 (XS1749054018) ..... | EUR                           | 100 000                  | 100 000                     |
| 0,0000 % Repsol International Finance<br>24.01.18 (XS1707745748) ..... | EUR                           |                          | 25 000                      |
| 0,0000 % Repsol International Finance<br>29.03.18 (XS1787418455) ..... | EUR                           | 40 000                   | 40 000                      |
| 0,0000 % Repsol International Finance<br>30.04.18 (XS1802320793) ..... | EUR                           | 40 000                   | 40 000                      |
| 0,0000 % Repsol International Finance<br>31.05.18 (XS1816463902) ..... | EUR                           | 40 000                   | 40 000                      |
| 0,0000 % Syngenta Finance 21.06.18<br>(XS1836087202) .....             | EUR                           | 40 000                   | 40 000                      |
| 0,0000 % Syngenta Finance 25.06.18<br>(XS1830142938) .....             | EUR                           | 50 000                   | 50 000                      |
| 0,0000 % Uniper 18.06.18 (XS1824210147) .....                          | EUR                           | 25 000                   | 25 000                      |
| 0,0000 % Uniper 28.06.18 (XS1829905402) .....                          | EUR                           | 25 000                   | 25 000                      |
| 0,0000 % Volkswagen Int. Finance<br>02.02.18 (XS1659720236) .....      | EUR                           |                          | 10 000                      |
| 0,0000 % Volkswagen Int. Finance<br>28.03.18 (XS1596854544) .....      | EUR                           |                          | 5 000                       |
| 0,0000 % Vonovia Finance 16.04.18<br>(XS1738491924) .....              | EUR                           |                          | 5 000                       |

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

Volumen in 1000

#### Terminkontrakte

#### Devisenterminkontrakte

#### Verkauf von Devisen auf Termin

EUR/USD EUR 2 268 364

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

Volumen in 1000

unbefristet EUR 656 436

Gattung: 0,0720 % A.N.Z. Banking Group 14/28.10.19 MTN (XS1130526780), 0,0000 % Akzo Nobel 17/08.11.19 MTN (XS1715353105), 3,2500 % Alliander 13/und. (XS0997535520), 0,0000 % Anheuser-Busch InBev 15/19.10.18 MTN (BE6276038419), 0,4260 % APRR 14/31.03.19 MTN (FR0011884899), 0,2590 % AT & T 14/04.06.19 (XS1144084099), 0,5230 % AT & T 17/04.09.23 (XS1629866606), 0,1740 % B.A.T. International Finance 14/06.03.18 MTN (XS1043096400), 0,2710 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 17/12.04.22 MTN (XS1594368539), 0,2790 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 18/09.03.23 MTN (XS1788584321), 0,6970 % Banco Santander 17/21.03.22 MTN (XS1758916261), 0,3420 % Bank China (Luxembourg Branch) 17/20.04.20 MTN (XS1599275630), 0,4720 % Bank of America 17/07.02.22 MTN (XS1560862580), 0,3720 % Bank of America 18/25.04.24 MTN (XS1811433983), 0,1770 % Bank of Montreal 17/28.09.21 MTN (XS1691466756), 0,1790 % Bank of Montreal 18/14.03.22 MTN (XS1791326728), 0,0510 % Bank of Nova Scotia 15/14.01.20 MTN (XS1166454915), 0,2270 % Bayer Capital 18/26.06.22 (XS1840614736), 0,1760 % BNP Paribas 15/28.08.19 MTN (XS1280841427), 0,5270 % BNP Paribas 17/22.09.22 MTN (XS1584041252), 0,0020 % BNP Paribas 18/19.01.23 MTN (XS1756434194), 0,2940 % BNP Paribas 18/22.05.23 MTN (XS1823532996), 0,1790 % BNZ Int. Funding (London B.) 14/02.12.19 MTN (XS1145855646), 0,7290 % BPCE 17/07.03.22 MTN (FR0013241130), 0,1770 % BPCE 18/23.03.23 MTN (FR0013323672), 0,3520 % Carrefour Banque 16/20.04.21 MTN (FR0013155868), 0,1770 % Cassa Depositi e Prestiti 15/20.03.22 MTN (IT0005090995), 0,2230 % Citigroup 14/11.11.19 MTN

## Deutsche Floating Rate Notes

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

Volumen in 1000

(XS1135549167), 0,5060 % Citigroup 16/24.05.21 MTN (XS1417876759), 0,1770 % Citigroup 18/21.03.23 MTN (XS1795253134), 0,0000 % Colgate-Palmolive 15/14.05.19 MTN (XS1230926609), 0,4290 % Commerzbank 17/08.03.22 S.880 MTN (DE000CZ40L22), 0,0000 % Coöperatieve Rabobank 15/29.05.20 MTN (XS1239520494), 0,2750 % Covestro 16/10.03.18 MTN (XS1377821464), 0,4720 % Credit Agricole (London Br.) 17/20.04.22 MTN (XS1598861588), 0,2790 % Credit Agricole 18/06.03.23 MTN (XS1787278008), 0,2010 % Daimler 16/14.01.19 MTN (DE000A169GZ7), 0,1210 % Daimler 17/03.07.24 MTN (DE000A2GSCY9), 0,0000 % Daimler International Finance 17/11.05.22 MTN (DE000A19HBM3), 0,0000 % Daimler International Finance 18/11.01.23 MTN (DE000A19UNN9), 0,0000 % Danone 16/03.11.18 MTN (FR0013216884), 0,2210 % Deutsche Bank 14/15.04.19 MTN (DE000DB7XHM0), 0,5710 % Deutsche Bank 16/13.04.18 MTN (DE000DL19SS0), 0,4740 % Deutsche Bank 17/16.05.22 MTN (DE000DL19TQ2), 0,0210 % Deutsche Telekom Int. Finance 16/03.04.20 MTN (XS1382791892), 3,8750 % Engie 13/und. (FR0011531714), 0,0000 % Equinor 15/19.08.19 MTN (XS1190623907), 0,2210 % FedEx 16/11.04.19 (XS1319814817), 0,3790 % Ford Motor Credit 17/01.12.24 MTN (XS1729872736), 0,0980 % Ford Motor Credit 18/07.12.22 MTN (XS1767930826), 0,0000 % France 18/30.05.18 (FR0124747504), 0,0000 % France B.T.F. 17/10.10.18 (FR0124584733), 0,0000 % France B.T.F. 17/14.03.18 (FR0124584683), 0,0000 % GE Capital European Funding 06/17.05.21 MTN (XS0254356057), 0,0520 % GE Capital European Funding 15/21.01.20 MTN (XS1169331367), 0,3520 % General Motors Financial 17/15.05.21 MTN (XS1609252645), 0,2270 % General Motors Financial 18/26.03.22 MTN (XS1792505197), 0,4220 % Goldman Sachs Group 14/29.10.19 MTN (XS1130101931), 0,6720 % Goldman Sachs Group 16/27.07.21 MTN (XS1458408306), 0,3090 % Goldman Sachs Group 17/09.09.22 MTN (XS1577427526), 0,1290 % Goldman Sachs Group 18/16.12.20 MTN (XS1791719534), 0,1720 % HSBC Holdings 17/05.10.23 MTN (XS1681855539), 0,3760 % HSBC Holdings 17/27.09.22 MTN (XS1586214956), 0,2210 % ICBC (Luxembourg Branch) 17/12.10.22 MTN (XS1691909334), 0,7210 % Intesa Sanpaolo 14/17.04.19 MTN (XS1057822766), 0,7290 % Intesa Sanpaolo 15/15.06.20 MTN (XS1246144650), 1,0490 % Intesa Sanpaolo 17/15.03.23 (XS1577427872), 0,6220 % Intesa Sanpaolo 17/19.04.22 MTN (XS1599167589), 0,1590 % John Deere Bank 14/19.03.19 MTN (XS1046499981), 0,0000 % John Deere Cash Management 17/15.09.20 MTN (XS1683495052), 0,2720 % JPMorgan Chase & Co. 14/07.05.19 MTN (XS1064100115), 0,2790 % Jyske Bank 17/01.12.22 MTN (XS1726323436), 0,2260 % KBC Groep 17/24.11.22 MTN (BE0002281500), 6,1250 % KPN 13/und. (XS0903872355), 0,0000 % McDonald's 17/05.04.19 MTN (XS1591430746), 0,4740 % Mediobanca - Banca Credito Fin. 17/18.05.22 MTN (XS1615501837), 0,1790 % Morgan Stanley 16/03.12.19 MTN (XS1529837947), 0,3720 % Morgan Stanley 17/08.11.22 MTN (XS1603892065), 0,2420 % National Australia Bank 16/19.04.21 MTN (XS1412416486), 6,5000 % Naviera Armas 16/31.07.23 Reg S (XS1459821036), 4,2500 % Naviera Armas 17/15.11.24 Reg S (XS1717590563), 0,2720 % Norddt. Landesbank 17/10.02.20 IHS (DE000NLB89N9), 0,1710 % Nykredit Realkredit 17/01.10.22 PF (DK0009515603), 0,1740 % OP Yrityspankki 18/22.05.21 MTN (XS1823485112), 0,3210 % RCI Banque 17/12.04.21 MTN (FR0013250685), 0,0000 % Sanofi 14/10.09.18 MTN (FR0012146751), 0,4540 % Santander UK Group Holdings 17/18.05.23 MTN (XS1615065320), 0,5210 % Societe Generale 17/01.04.22 MTN (XS1586146851), 0,1290 % Societe Generale 18/06.03.23 MTN (FR0013321791), 0,1290 % Sumitomo Mitsui Financial Group 17/14.06.22 MTN (XS1621087359), 0,1740 % Swedbank 15/18.08.20 MTN (XS1277337678), 0,0000 % Thermo Fisher Scientific 17/24.07.19 (XS1651071521), 0,0000 % Total Capital International 14/19.03.20 MTN (XS1139316555), 0,0000 % Toyota Motor Credit 15/20.07.18 MTN (XS1171489476), 0,1710 % UBS (London Branch) 18/10.01.20 MTN (XS1746116299), 0,3770 % UBS Group Funding (Switzerland) 17/20.09.22 (CH0359915425), 0,6740 % UniCredit 15/19.02.20 MTN (XS1169707087), 0,1010 % United Parcel Service 15/15.07.20

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

Volumen in 1000

(XS1323463056), 0,0000 % United Technologies 17/13.11.19 (XS1715323298), 0,0990 % Volkswagen Bank 17/15.06.21 MTN (XS1734547919), 0,3790 % Volkswagen Bank 18/08.12.21 MTN (XS1830992563), 0,2710 % Volkswagen Int. Finance 14/15.04.19 MTN (XS1057486471), 0,0000 % Volkswagen Int. Finance 15/16.07.18 MTN (XS1167637294), 0,0220 % Volkswagen Leasing 17/06.07.19 MTN (XS1642545690), 0,1270 % Vonovia Finance 18/22.12.22 (DE000A19X793), 0,1220 % Wells Fargo & Co. 14/24.04.19 MTN (XS1061043797), 0,2920 % Wells Fargo & Co. 16/26.04.21 MTN (XS1400169428), 0,1720 % Wells Fargo & Co. 17/31.01.22 MTN (XS1558022866), 3,3617 % ANZ New Zealand (Intl.) (LB) 17/25.01.22 MTN Reg S (US00182FBD78), 2,8691 % Apple 17/09.02.22 (US037833CN89), 2,7806 % Bank of Montreal 17/15.06.20 MTN (US06367TYM60), 4,4625 % Barclays 16/10.08.21 (US06738EAR62), 3,9625 % Barclays 17/10.01.23 (US06738EAT29), 3,3195 % Citigroup 17/25.04.22 (US172967LH22), 3,5356 % Credit Suisse Group 17/14.12.23 144a (US225401AE85), 3,0263 % CVW Bank of Australia 17/10.03.22 MTN 144a (US2027A0JL44), 3,0147 % CVW Bank of Australia 17/18.09.22 MTN 144a (US2027A0JS96), 3,3108 % General Motors Financial 18/05.01.23 (US37045XCE40), 3,3347 % Hyundai Capital America 17/18.09.20 MTN Reg S (US44891CAP86), 3,1078 % Mizuho Financial Group 18/05.03.23 (US60687Y AQ26), 2,9390 % National Australia Bank 18/12.04.23 MTN 144a (US6325C0DU23), 5,9771 % Petroleos Mexicanos (PEMEX) 16/11.03.22 MTN Reg S (US71656MBN83), 5,9771 % Petróleos Mexicanos 18/11.03.22 (US71654QCF72), 2,7488 % Royal Bank of Canada 18/30.04.21 MTN (US78013XKH07), 3,2925 % UBS Group Funding (Switzerland) 17/15.08.23 Reg S (USH4209UAF33), 2,9073 % Westpac Banking 17/11.01.23 (US961214DT74), 3,0456 % Westpac Banking 17/28.06.22 (US961214DR19)

### Pensionsgeschäfte (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Pensionsgeschäftes vereinbarten Wertes)

1000 in Pension genommen

(Basiswerte: Adagio Iv Clo 17/15.10.29 S.X Cl. A1R Flr, Cairn CLO V 17/20.07.30 S.15-5X Cl.AR, Contego CLO II 17/15.11.26 S.2X Cl.AR, CP Comboios de Portugal 10/05.03.30, CVC Cordatus Loan Fund V 17/21.07.30 AR Reg S, Dryden 32 Euro CLO 2014 14/24.08.26 Cl.C Reg S, Dryden 32 Euro CLO 2014 17/26S.32X Cl.BBVR Reg S, Harvest CLO 17/26.06.30 S.11X Cl.AR, Italy 18/01.03.23, Italy B.T.P. 09/01.03.20, Italy B.T.P. 10/15.09.21 INFL, Italy B.T.P. 14/01.12.19, Italy B.T.P. 16/01.03.67, Jubilee CLO 17/25.07.30 S.19 Cl.A2 144a, Nykredit Realkredit 17/01.10.22 S.DEC PF, Ozlme li Clo 17/15.10.30 S.2X Cl.A2, Spain 13/31.10.44, Spain 14/31.01.20, Spain 16/30.07.66, Spain 17/30.11.27 INFL, Spain 18/30.04.28, St. Paul's CLO VI 16/22.07.29 S.6X Cl.A1, St. Pauls CLO 17/15.01.28 S.3X Cl.DRNE, Tikehau CLO 17/04.08.28 S.1X Cl.A1R, Toro Euro.Clo 17/15.04.30 S.3X Cl.A Flr, Toro European CLO 16/17.10.28 S.2X Cl.A Reg S, Toro European CLO 17/15.07.30 S.1X Cl.ARE)

Volumen in  
EUR 4 600 781

## Deutsche Floating Rate Notes

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               |                                           |                             |                    |
|                                       | <b>1. Verwendete Vermögensgegenstände</b> |                             |                    |
| absolut                               | 280 578 438,28                            | 357 909 075,00              | -                  |
| in % des Fondsvermögens               | 2,58                                      | 3,28                        | -                  |
|                                       | <b>2. Die 10 größten Gegenparteien</b>    |                             |                    |
| <b>1. Name</b>                        | Morgan Stanley & Co. International PLC    | Deutsche Bank AG, Frankfurt |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 89 882 662,37                             | 340 290 000,00              |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Großbritannien                            | Bundesrepublik Deutschland  |                    |
| <b>2. Name</b>                        | Citigroup Global Markets Ltd., London     | Deutsche Bank AG, London    |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 35 546 551,00                             | 17 619 075,00               |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Großbritannien                            | Großbritannien              |                    |
| <b>3. Name</b>                        | Barclays Bank PLC, London                 |                             |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 34 628 825,00                             |                             |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Großbritannien                            |                             |                    |
| <b>4. Name</b>                        | HSBC Bank PLC                             |                             |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 28 504 117,70                             |                             |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Großbritannien                            |                             |                    |
| <b>5. Name</b>                        | Nomura International PLC                  |                             |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 24 396 225,91                             |                             |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Großbritannien                            |                             |                    |
| <b>6. Name</b>                        | Deutsche Bank AG, Frankfurt               |                             |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 23 888 772,84                             |                             |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Bundesrepublik Deutschland                |                             |                    |
| <b>7. Name</b>                        | BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris         |                             |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 15 767 510,00                             |                             |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Frankreich                                |                             |                    |
| <b>8. Name</b>                        | Merrill Lynch International Ltd.          |                             |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 10 880 952,59                             |                             |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Großbritannien                            |                             |                    |
| <b>9. Name</b>                        | J.P. Morgan Securities PLC                |                             |                    |
| <b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b> | 9 192 285,43                              |                             |                    |
| <b>Sitzstaat</b>                      | Großbritannien                            |                             |                    |

## Deutsche Floating Rate Notes

|                                           |                      |  |  |
|-------------------------------------------|----------------------|--|--|
| <b>10. Name</b>                           | Zürcher Kantonalbank |  |  |
| <b>Bruttovolumen<br/>offene Geschäfte</b> | 2 574 746,78         |  |  |
| <b>Sitzstaat</b>                          | Schweiz              |  |  |

### 3. Art(en) von Abwicklung und Clearing

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

|            |            |   |
|------------|------------|---|
| zweiseitig | zweiseitig | - |
|------------|------------|---|

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

|                            |                |                |   |
|----------------------------|----------------|----------------|---|
| <b>unter 1 Tag</b>         | -              | -              | - |
| <b>1 Tag bis 1 Woche</b>   | -              | -              | - |
| <b>1 Woche bis 1 Monat</b> | -              | -              | - |
| <b>1 bis 3 Monate</b>      | -              | -              | - |
| <b>3 Monate bis 1 Jahr</b> | -              | -              | - |
| <b>über 1 Jahr</b>         | -              | -              | - |
| <b>unbefristet</b>         | 280 578 438,28 | 357 909 075,00 | - |

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

**Bankguthaben**  
**Schuldverschreibungen**  
**Aktien**  
**Sonstige**

|                 |               |   |   |
|-----------------|---------------|---|---|
| <b>Art(en):</b> |               |   |   |
| -               | -             | - | - |
| 129 474 215,37  | 17 715 108,92 | - | - |
| 154 280 454,91  | -             | - | - |
| 19 389 559,16   | -             | - | - |

#### 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 Floating Rate Notes

|                                                                                                                           |                                              |                         |   |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------|---|
| <b>6. Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten</b>                                                                         |                                              |                         |   |
| Währung(en):                                                                                                              | EUR; USD; JPY; GBP; NZD; DKK; AUD            | EUR                     | - |
| <b>7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)</b>                                                  |                                              |                         |   |
| 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                                                                                                               | 303 144 229,44                               | 17 715 108,92           | - |
| <b>8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)</b>                                                               |                                              |                         |   |
| <b>Ertragsanteil des Fonds</b>                                                                                            |                                              |                         |   |
| absolut                                                                                                                   | 180 633,89                                   | -1 537 199,82           | - |
| in % der Bruttoerträge                                                                                                    | 60,00                                        | 100,00                  | - |
| Kostenanteil des Fonds                                                                                                    | -                                            | -                       | - |
| <b>Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft</b>                                                                          |                                              |                         |   |
| absolut                                                                                                                   | 120 422,09                                   | -                       | - |
| in % der Bruttoerträge                                                                                                    | 40,00                                        | -                       | - |
| Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft                                                                                  | -                                            | -                       | - |
| <b>Ertragsanteil Dritter</b>                                                                                              |                                              |                         |   |
| absolut                                                                                                                   | -                                            | -                       | - |
| in % der Bruttoerträge                                                                                                    | -                                            | -                       | - |
| Kostenanteil Dritter                                                                                                      | -                                            | -                       | - |
| <b>9. Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps</b> |                                              |                         |   |
| absolut                                                                                                                   | -                                            | -                       | - |
| <b>10. Verleihe Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds</b>                                    |                                              |                         |   |
| Summe                                                                                                                     | 280 578 438,28                               |                         |   |
| Anteil                                                                                                                    | 3,05                                         |                         |   |
| <b>11. Die 10 größten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps</b>                                 |                                              |                         |   |
| 1. Name                                                                                                                   | European Financial Stability Facility (EFSF) | Toro European CLO 4 DAC |   |
| Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)                                                                                 | 37 365 607,43                                | 9 037 719,99            |   |
| 2. Name                                                                                                                   | Banco Santander Totta S.A.                   | Ozlme li Dac            |   |
| Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)                                                                                 | 33 689 769,50                                | 8 560 830,03            |   |

## Deutsche Floating Rate Notes

|                                                  |                                                   |                 |  |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|--|
| <b>3. Name</b>                                   | European Union                                    | French Republic |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 23 428 239,88                                     | 116 558,90      |  |
| <b>4. Name</b>                                   | French Republic                                   |                 |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 10 475 735,87                                     |                 |  |
| <b>5. Name</b>                                   | ConvaTec Group PLC                                |                 |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 8 506 311,85                                      |                 |  |
| <b>6. Name</b>                                   | William Hill PLC                                  |                 |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 8 506 310,38                                      |                 |  |
| <b>7. Name</b>                                   | ZPG PLC                                           |                 |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 8 506 310,37                                      |                 |  |
| <b>8. Name</b>                                   | ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. |                 |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 8 506 310,04                                      |                 |  |
| <b>9. Name</b>                                   | Merlin Properties SOCIMI S.A.                     |                 |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 8 506 308,83                                      |                 |  |
| <b>10. Name</b>                                  | Japan Material Co. Ltd.                           |                 |  |
| <b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b> | 8 506 300,09                                      |                 |  |

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

|               |   |
|---------------|---|
| <b>Anteil</b> | - |
|---------------|---|

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

|                                      |   |     |
|--------------------------------------|---|-----|
| <b>gesonderte Konten / Depots</b>    | - | -   |
| <b>Sammelkonten / Depots</b>         | - | -   |
| <b>andere Konten / Depots</b>        | - | -   |
| <b>Verwahrart bestimmt Empfänger</b> | - | 100 |

## Deutsche Floating Rate Notes

---

### 14. Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps

Gesamtzahl Verwahrer/  
Kontoführer

|   |   |   |
|---|---|---|
| 2 | 1 | - |
|---|---|---|

1. Name

|                  |                   |  |
|------------------|-------------------|--|
| Bank of New York | State Street Bank |  |
|------------------|-------------------|--|

verwahrter Betrag absolut

|                |               |  |
|----------------|---------------|--|
| 160 030 369,68 | 17 715 108,92 |  |
|----------------|---------------|--|

2. Name

|                   |  |  |
|-------------------|--|--|
| State Street Bank |  |  |
|-------------------|--|--|

verwahrter Betrag absolut

|                |  |  |
|----------------|--|--|
| 143 113 859,76 |  |  |
|----------------|--|--|

# TER für Anleger in der Schweiz

| Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio (TER)) für Fonds mit Registrierung in der Schweiz im Zeitraum vom 1.7.2017 bis 30.6.2018 |              |              |                     |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|--------------|---------------------|
| Fonds                                                                                                                           | Anteilklasse | ISIN         | TER <sup>1)2)</sup> |
| Deutsche Floating Rate Notes                                                                                                    | Klasse LC    | LU0034353002 | 0,22                |
|                                                                                                                                 | Klasse FC    | LU1534068801 | 0,12                |
|                                                                                                                                 | Klasse FD    | LU1644422419 | 0,11                |
|                                                                                                                                 | Klasse IC    | LU1534073041 | 0,10                |
|                                                                                                                                 | Klasse LD    | LU1122765560 | 0,20                |
|                                                                                                                                 | Klasse TFC   | LU1673806201 | 0,12                |
|                                                                                                                                 | Klasse TFD   | LU1673810575 | 0,12                |

<sup>1)</sup> Die Gesamtkostenquote drückt die Summe der Kosten und Gebühren (ohne Transaktionskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens innerhalb eines Jahres aus (TER inkl. erfolgsabhängiger Vergütung gemäss SFAMA-Richtlinie).

<sup>2)</sup> Der TER-Ausweis in den Vermögensaufstellungen und Ertrags- und Aufwandsrechnungen zu den Jahresberichten kann hiervon abweichen, da er nach BVI-Methode ermittelt wurde.

**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

