

Halbjahresbericht zum 30. September 2019. **Deka-Treasury**

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

The logo for Deka Investments is displayed on a red background with a subtle, wavy texture. The word "Deka" is in a large, white, sans-serif font, with a small square icon to its left. Below it, the word "Investments" is in a smaller, white, sans-serif font.

Deka
Investments

Bericht des Vorstands.

30. September 2019

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Treasury mit dem Teilfonds Deka-Treasury CreditStrategie für den Zeitraum vom 1. April 2019 bis zum 30. September 2019.

In den vergangenen sechs Monaten prägten wiederholt sowohl die geldpolitischen Entscheidungsträger als auch die Akteure im Handelskonflikt der USA mit China die Kapitalmärkte. Insgesamt zeigten die Aktienbörsen eine erstaunliche Widerstandskraft gegen exogene Erschütterungen; bei den Marktteilnehmern manifestierte sich dennoch eine gestiegene Risikoaversion und eine höhere Nachfrage nach sicheren Anlagemöglichkeiten.

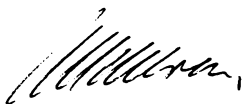
Schwächere konjunkturelle Daten und eine abflauende Weltwirtschaft veranlassten die beiden großen Zentralbanken zu neuen geldpolitischen Lockerungsmaßnahmen: Die US-Notenbank Fed senkte im Juli und September den Leitzins um jeweils 25 Basispunkte und die EZB beschloss das Anleihenankaufprogramm wiederaufzunehmen. Mittlerweile bewegen sich deutsche Bundesanleihen über alle Laufzeiten hinweg im negativen Bereich. 10-jährige US-Treasuries rentierten zum Stichtag mit lediglich 1,7 Prozent ebenfalls auf einem bescheidenen Niveau.

Die weltpolitischen Stürme führten bisher nur zu temporären Unsicherheiten an den Märkten und so tendierte das Gros der etablierten Börsen im Berichtshalbjahr unter Schwankungen aufwärts. Dabei verbuchten vor allem die deutschen Standardwerte – gemessen am DAX – sowie der EURO STOXX 50 erfreuliche Wertsteigerungen. In den USA verzeichneten die Leitindizes Dow Jones Industrial und der marktbreite S&P 500 im Juli ein neues Allzeithoch und auch der japanische Nikkei 225 landete auf Halbjahressicht auf positivem Terrain. Im Zuge des erneut eskalierenden Handelsstreits mit den USA büßte hingegen vor allem der chinesische Hang Seng Index deutlich ein. An den Rohstoffmärkten machte Gold seinem Namen als Krisenwährung alle Ehre und markierte im September ein neues Sechsjahreshoch.

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka International S.A.
Der Vorstand



Holger Hildebrandt



Eugen Lehnertz

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensaufstellung zum 30. September 2019	6
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	18

Deka-Treasury CreditStrategie Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Deka-Treasury CreditStrategie ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, überwiegend in Unternehmensanleihen mit guter bis sehr guter Schuldnerqualität (Investment Grade) zu investieren. Für den Kauf der Unternehmensanleihen existieren Beschränkungen bezüglich der Schuldnerqualität. Investitionen erfolgen vollständig in auf Euro lautende Wertpapiere oder in gegenüber Euro abgesicherten Wertpapieren fremder Währung. Der Fonds ist weitestgehend gegen Zinsänderungsrisiken abgesichert. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden, wobei vor allem Kreditderivate zur Generierung von Zusatzserträgen oder zur Steuerung der Schuldnerisiken des Fonds eingesetzt werden können.

Als Referenzindex wurde der 3-Monats-Euribor mit Zinseszins zum Quartalsultimo zzgl. eines Aufschlags, der sich zu 65 Prozent aus dem Asset Swap Spread des Merrill Lynch Euro Non-Financial Index und zu 35 Prozent aus dem Asset Swap Spread des Merrill Lynch Unsubordinated Euro Financial Index ¹⁾ ergibt, festgelegt.

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

Mit Wirkung zum 1. Mai 2019 ist die Funktion der Verwahr- und Zahlstelle von der DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A. auf die DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main, Niederlassung Luxemburg übergegangen.

Auf Wertpapierebene stand weiterhin das Engagement in Unternehmensanleihen im Vordergrund. Mit Blick auf die Bonität der Anleihen richtete sich der Fokus unverändert auf die Ratingklasse BBB, gefolgt von dem Segment A (Standard & Poor's). Ein Teil der Anleihen verfügte über besondere Ausstattungsmerkmale (z.B. Rating Linked Bonds).

Der Fonds Deka-Treasury CreditStrategie verzeichnete im abgelaufenen Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 1,0 Prozent (Anteilklasse S (A)).

Wichtige Kennzahlen

Deka-Treasury CreditStrategie

Performance *	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Anteilklasse S (A)	1,0%	1,0%	0,9%

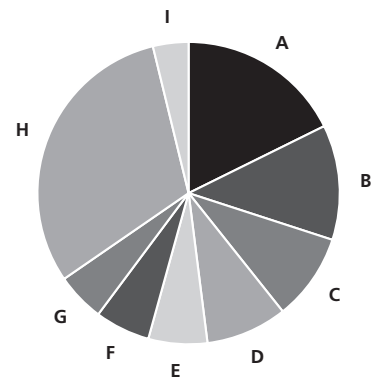
ISIN

Anteilklasse S (A) LU0291722691

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

Fondsstruktur

Deka-Treasury CreditStrategie



A	USA	17,7%
B	Niederlande	12,3%
C	Großbritannien	9,3%
D	Frankreich	8,7%
E	Spanien	6,3%
F	Italien	5,9%
G	Deutschland	5,2%
H	Sonstige Länder	30,8%
I	Barreserve, Sonstiges	3,8%

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

1) Quelle Merrill Lynch, Verwendung mit Genehmigung. MERRILL LYNCH LIZENZIERT DIE MERRILL LYNCH-INDIZES OHNE GEWÄHR, MACHT KEINE ZUSICHERUNGEN IN BEZUG AUF DIESE, ÜBERNIMMT KEINE GARANTIE FÜR DIE QUALITÄT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DER MERRILL LYNCH INDIZES ODER DIE DARIN ENTHALTENEN ODER DAVON ABGELEITETEN DATEN UND ÜBERNIMMT KEINE HAFTUNG IN VERBINDUNG MIT DEREN NUTZUNG

Deka-Treasury CreditStrategie

Vermögensaufstellung zum 30. September 2019.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								100.747.612,98	74,23
Verzinsliche Wertpapiere								100.747.612,98	74,23
EUR								100.747.612,98	74,23
XS1789699607	1,7500 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 18/26	EUR		200.000	0	0	% 103,666	207.332,00	0,15
XS1883355197	1,5000 % Abbott Ireland Financing DAC Notes 18/26	EUR		1.600.000	400.000	0	% 107,936	1.726.976,00	1,26
XS1520899532	1,3750 % AbbVie Inc. Notes 16/24 ¹⁾	EUR		750.000	750.000	0	% 104,840	786.300,00	0,58
XS2025466413	0,6250 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 19/25	EUR		500.000	500.000	0	% 99,562	497.810,00	0,37
XS1967635977	2,3750 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 19/27	EUR		500.000	300.000	200.000	% 109,257	546.282,50	0,40
XS2055651918	1,1250 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 19/28 ¹⁾	EUR		300.000	500.000	200.000	% 99,311	297.931,50	0,22
XS1767087940	0,0000 % ACEA S.p.A. FLR MTN 18/23	EUR		400.000	400.000	0	% 99,434	397.734,00	0,29
XS1799545329	1,8750 % ACS Servicios Comun.y Ener.SL MTN 18/26	EUR		200.000	0	0	% 106,744	213.488,00	0,16
XS2008921947	0,6250 % Aegon Bank N.V. Non-Preferred Nts 19/24	EUR		650.000	650.000	0	% 102,390	665.535,00	0,49
XS2053346297	0,5000 % alstria office REIT-AG Anl. 19/25	EUR		200.000	200.000	0	% 99,198	198.396,00	0,15
XS1843443513	1,7000 % Altria Group Inc. Notes 19/25 ¹⁾	EUR		400.000	0	0	% 104,268	417.070,00	0,31
XS1843443786	3,1250 % Altria Group Inc. Notes 19/31	EUR		300.000	500.000	600.000	% 112,444	337.332,00	0,25
XS0995040051	2,8750 % Anglo American Capital PLC MTN 13/20	EUR		400.000	400.000	0	% 103,266	413.064,00	0,30
BE6285454482	1,5000 % Anheuser-Busch InBev N.V./S.A. MTN 16/25	EUR		400.000	400.000	0	% 107,718	430.870,00	0,32
XS1205616268	1,3750 % APT Pipelines Ltd. MTN 15/22	EUR		400.000	0	0	% 103,421	413.682,00	0,30
BE6311694010	1,0000 % Argenta Spaarbank N.V. Preferred Notes 19/24	EUR		400.000	0	200.000	% 103,759	415.036,00	0,31
XS1875331636	1,1250 % Argentum Netherlands B.V. MT LPN Givaudan 18/25 A	EUR		500.000	0	0	% 105,672	528.357,50	0,39
XS1449707055	1,5000 % Arountown SA Notes 16/24	EUR		500.000	500.000	0	% 104,850	524.250,00	0,39
XS1577951715	1,1510 % Asahi Group Holdings Ltd. Notes 17/25	EUR		400.000	0	150.000	% 104,599	418.396,00	0,31
XS1907120791	2,3500 % AT & T Inc. Notes 17/29	EUR		400.000	0	600.000	% 113,991	455.963,20	0,34
XS2051362312	1,8000 % AT & T Inc. Notes 19/39	EUR		225.000	225.000	0	% 99,245	223.301,25	0,16
XS1812905526	1,2500 % Ausgrid Finance Pty Ltd. MTN 18/25	EUR		1.200.000	0	0	% 104,882	1.258.578,00	0,93
XS1533922263	1,2500 % Avery Dennison Corp. Notes 17/25	EUR		400.000	300.000	0	% 103,979	415.914,00	0,31
XS1117528189	1,7500 % Babcock International Grp PLC MTN 14/22	EUR		800.000	300.000	0	% 103,296	826.364,00	0,61
XS0947658208	2,7500 % Bacardi Ltd. Notes 13/23	EUR		500.000	0	0	% 108,464	542.317,50	0,40
XS1788584321	0,1590 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. FLR Non-Pr. MTN 18/23	EUR		500.000	0	0	% 99,773	498.862,50	0,37
XS1602557495	0,4030 % Bank of America Corp. FLR MTN 17/23	EUR		1.000.000	0	0	% 100,914	1.009.140,00	0,74
XS1991265478	0,8080 % Bank of America Corp. FLR MTN 19/26	EUR		400.000	625.000	225.000	% 102,577	410.306,00	0,30
XS2049584084	0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27 ¹⁾	EUR		600.000	1.000.000	400.000	% 97,055	582.330,00	0,43
XS2002532567	0,6320 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl Notes 19/23	EUR		650.000	650.000	0	% 101,096	657.120,75	0,48
XS1822506272	1,4010 % Becton, Dickinson & Co. Notes 18/23	EUR		600.000	0	600.000	% 103,906	623.433,00	0,46
XS1028954953	3,3750 % Bharti Airtel Intl (NL) B.V. Notes 14/21 Reg.S	EUR		250.000	0	0	% 104,891	262.227,50	0,19
XS0834385923	3,2500 % BHP Billiton Finance Ltd. MTN 12/27 ¹⁾	EUR		300.000	300.000	0	% 123,253	369.759,00	0,27
XS2010445026	0,1250 % BMW Finance N.V. MTN 19/22 ¹⁾	EUR		650.000	650.000	0	% 100,396	652.574,00	0,48
XS1992931508	0,8310 % BP Capital Markets PLC MTN 19/27	EUR		800.000	1.200.000	400.000	% 103,759	830.068,00	0,61
XS1720922175	1,0000 % British Telecommunications PLC MTN 17/24	EUR		500.000	0	0	% 102,795	513.972,50	0,38
XS1752476538	0,7500 % CaixaBank S.A. MTN 18/23	EUR		1.200.000	800.000	200.000	% 102,184	1.226.202,00	0,90
XS2055758804	0,6250 % CaixaBank S.A. Non-Preferred MTN 19/24 ¹⁾	EUR		500.000	500.000	0	% 100,054	500.270,00	0,37
XS2009011771	0,8000 % Capital One Financial Corp. Notes 19/24	EUR		725.000	725.000	0	% 101,984	739.380,38	0,54
XS1713474671	1,2500 % Celanese US Holdings LLC Notes 17/25	EUR		250.000	0	0	% 102,810	257.025,00	0,19
XS1415366720	1,8750 % Ceske Drah AS Notes 16/23	EUR		450.000	450.000	0	% 105,081	472.862,25	0,35
XS1529934801	1,4230 % CETIN Finance B.V. MTN 16/21	EUR		1.000.000	0	0	% 102,959	1.029.590,00	0,76
XS2012102674	0,8750 % Chubb INA Holdings Inc. Notes 19/27	EUR		400.000	400.000	0	% 103,357	413.426,00	0,30
XS1795253134	0,1040 % Citigroup Inc. FLR MTN 18/23	EUR		400.000	0	0	% 100,299	401.196,00	0,30
XS1107727007	2,1250 % Citigroup Inc. MTN 14/26	EUR		400.000	400.000	0	% 112,160	448.640,00	0,33
XS1457608013	0,7500 % Citigroup Inc. MTN 16/23	EUR		500.000	0	0	% 102,552	512.757,50	0,38

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
XS1391085740	1,2500 % CK Hutchison Finance (16) Ltd. Notes 16/23		EUR	500.000	0	0	% 103,809	519.042,50	0,38
XS1616917800	1,3750 % CNH Industrial Finance Euro.SA MTN 17/22		EUR	800.000	0	0	% 103,292	826.336,00	0,61
XS0973209421	2,7500 % CNOOC Curtis Fdg No.1 Pty Ltd. Notes 13/20		EUR	400.000	0	0	% 102,710	410.838,00	0,30
XS1995781546	1,0000 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 19/27 ¹⁾		EUR	1.150.000	1.150.000	0	% 104,869	1.205.987,75	0,89
FR0013264439	2,1250 % Coentr.d.Trans.d'Elec.SA (CTE) Obl. 17/32		EUR	500.000	0	0	% 116,629	583.145,00	0,43
XS2051667181	0,0000 % Continental AG MTN 19/23 Reg.S		EUR	450.000	450.000	0	% 99,551	447.977,25	0,33
XS1956955980	0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. Non-Preferred MTN 19/24		EUR	500.000	200.000	200.000	% 102,465	512.322,50	0,38
XS1943474483	0,6250 % Corporación Andina de Fomento MTN 19/24 ¹⁾		EUR	1.250.000	500.000	0	% 101,778	1.272.225,00	0,94
XS2016807864	0,5000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Non-Pref. MTN 19/24		EUR	800.000	800.000	0	% 101,248	809.984,00	0,60
CH0483180946	1,0000 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 19/27 ¹⁾		EUR	675.000	675.000	0	% 102,998	695.236,50	0,51
XS1218287230	1,2500 % CS Group Funding (GG) Ltd. MTN 15/22		EUR	500.000	0	0	% 103,099	515.492,50	0,38
XS1419674525	1,5540 % DAA Finance PLC Notes 16/28		EUR	400.000	0	0	% 106,036	424.144,00	0,31
DE000A2YNZW8	0,3750 % Daimler AG MTN 19/26		EUR	500.000	500.000	0	% 99,773	498.862,50	0,37
FR0013444502	0,0000 % Dassault Systemes SE Notes 19/22 ¹⁾		EUR	700.000	700.000	0	% 100,366	702.558,50	0,52
XS1300465926	2,7500 % Davide Campari-Milano S.p.A. Notes 15/20		EUR	500.000	0	0	% 102,539	512.695,00	0,38
DE000DL19UR8	1,8750 % Deutsche Bank AG MTN 19/22 ¹⁾		EUR	600.000	300.000	300.000	% 101,968	611.805,00	0,45
XS2050404636	0,2000 % DH Europe Finance II S.à r.L. Notes 19/26		EUR	500.000	775.000	275.000	% 99,620	498.097,50	0,37
XS1291448824	2,2500 % DS Smith PLC MTN 15/22		EUR	600.000	600.000	0	% 105,358	632.148,00	0,47
XS1048589458	2,8750 % Dürr AG Anl. 14/21		EUR	1.000.000	0	0	% 103,812	1.038.115,00	0,76
XS2047500769	0,0000 % E.ON SE MTN 19/24		EUR	500.000	825.000	325.000	% 99,815	499.072,50	0,37
FR0013385655	1,8750 % Edenred S.A. Notes 18/26		EUR	500.000	0	0	% 109,539	547.692,50	0,40
FR0013368545	2,0000 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 18/30		EUR	500.000	0	700.000	% 113,515	567.575,00	0,42
XS1713464102	0,8750 % Elering A.S. Bonds 18/23		EUR	575.000	0	0	% 102,789	591.033,88	0,44
XS1953833750	1,1250 % Elisa Oyj MTN 19/26		EUR	500.000	0	0	% 104,270	521.350,00	0,38
XS1999902502	0,3750 % Emerson Electric Co. Notes 19/24		EUR	500.000	625.000	125.000	% 101,447	507.235,00	0,37
XS1981060624	1,8750 % ERG S.p.A. MTN 19/25		EUR	400.000	775.000	375.000	% 105,528	422.110,00	0,31
XS1982725159	0,3750 % Erste Group Bank AG Pref. MTN 19/24		EUR	400.000	400.000	0	% 101,725	406.898,00	0,30
XS2009943379	1,1250 % Euronext N.V. Notes 19/29		EUR	250.000	250.000	0	% 105,565	263.912,50	0,19
XS1954697923	1,2500 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 19/22		EUR	375.000	0	0	% 102,873	385.773,75	0,28
XS2001270995	0,6250 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 19/22		EUR	575.000	575.000	0	% 101,079	581.204,25	0,43
XS2051914963	0,5000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 19/24		EUR	325.000	325.000	0	% 99,879	324.606,75	0,24
XS1843436574	0,7500 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 19/23		EUR	1.025.000	1.025.000	0	% 102,040	1.045.910,00	0,77
XS1843436228	1,5000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 19/27		EUR	800.000	1.250.000	450.000	% 106,950	855.596,00	0,63
BE0002292614	1,7500 % FLUXYS Belgium S.A. Notes 17/27		EUR	600.000	0	0	% 104,435	626.610,00	0,46
XS1956028168	0,8750 % Fortum Oyj MTN 19/23		EUR	500.000	0	0	% 102,350	511.747,50	0,38
XS1515216650	1,5000 % G4S International Finance PLC MTN 16/23 4		EUR	300.000	300.000	0	% 102,779	308.335,50	0,23
PTGALJOE0008	3,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 14/21		EUR	500.000	0	0	% 103,845	519.222,50	0,38
PTGALLOM0004	1,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 17/23		EUR	400.000	0	0	% 101,532	406.128,00	0,30
PTGGDAOE0001	1,3750 % Galp Gás Natural Distrib. S.A. MTN 16/23		EUR	300.000	0	0	% 104,645	313.935,00	0,23
XS1911645049	2,9490 % Gaz Capital S.A. MT LPN GAZPROM 18/24		EUR	225.000	0	0	% 109,112	245.502,00	0,18
FR0013266343	0,0000 % Gecina S.A. FLR MTN 17/22		EUR	500.000	500.000	0	% 100,400	501.997,50	0,37
XS1506612693	0,8750 % GELF Bond Issuer I S.A. MTN 16/22		EUR	1.000.000	200.000	0	% 102,549	1.025.490,00	0,76
XS1113441080	2,1250 % Gemalto N.V. Notes 14/21		EUR	1.000.000	0	400.000	% 103,568	1.035.675,00	0,76
XS2049548444	0,2000 % General Motors Financial Co. MTN 19/22		EUR	475.000	475.000	0	% 99,770	473.907,50	0,35
XS1623615546	1,5000 % Global Switch Holdings Ltd. MTN 17/24		EUR	200.000	0	0	% 104,145	208.289,00	0,15
XS0880764435	5,2000 % Hera S.p.A. MTN 13/28 ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 138,624	415.872,00	0,31
XS2020608548	0,8750 % Hera S.p.A. MTN 19/27		EUR	425.000	425.000	0	% 103,919	441.653,63	0,33
DE000A2LQ5M4	1,7500 % HOCHTIEF AG MTN 18/25		EUR	350.000	350.000	0	% 107,174	375.109,00	0,28

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
XS1111108673	2,2500 % Holding d'Infrastr. de Transp. Notes 14/25		EUR	500.000	500.000	0	% 109,028	545.137,50	0,40
FR0013420023	0,2500 % HSBC France S.A. MTN 19/24		EUR	400.000	900.000	500.000	% 100,867	403.468,00	0,30
FR0013330099	1,6250 % Indigo Group S.A.S. Bonds 18/28		EUR	400.000	100.000	0	% 108,415	433.660,00	0,32
XS2049154078	0,1000 % ING Groep N.V. FLR MTN 19/25		EUR	600.000	600.000	0	% 98,993	593.958,00	0,44
FR0013430535	1,1250 % In'li S.A. Obl. 19/29		EUR	300.000	300.000	0	% 104,409	313.227,00	0,23
XS2020580945	0,5000 % Internat. Cons. Airl. Group SA Bonds 19/23		EUR	400.000	600.000	200.000	% 99,681	398.724,00	0,29
XS2020581752	1,5000 % Internat. Cons. Airl. Group SA Bonds 19/27		EUR	400.000	600.000	200.000	% 99,654	398.614,00	0,29
XS2022424993	1,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 19/29		EUR	600.000	875.000	275.000	% 105,748	634.488,00	0,47
XS1881533563	1,9500 % Iren S.p.A. MTN 18/25 ¹⁾		EUR	1.000.000	400.000	0	% 108,705	1.087.050,00	0,80
XS1330300341	1,1250 % ISS Global A/S MTN 15/21		EUR	625.000	0	0	% 101,240	632.750,00	0,47
XS2013618421	0,8750 % ISS Global A/S MTN 19/26		EUR	450.000	450.000	0	% 102,089	459.400,50	0,34
XS0496716282	5,3750 % Italcementi Finance S.A. MTN 10/20		EUR	1.200.000	0	0	% 102,490	1.229.874,00	0,91
XS1960248919	1,0900 % JPMorgan Chase & Co. FLR MTN 19/27		EUR	500.000	500.000	0	% 104,446	522.230,00	0,38
ES0000012E69	1,8500 % Königreich Spanien Bonos 19/35		EUR	750.000	1.250.000	1.000.000	% 119,237	894.277,50	0,66
FR0013447604	0,3750 % La Poste MTN 19/27		EUR	300.000	500.000	200.000	% 101,381	304.141,50	0,22
FR0013447638	1,0000 % La Poste MTN 19/34		EUR	300.000	300.000	0	% 103,332	309.996,00	0,23
XS1646530565	2,0000 % Lietuvos energija UAB MTN 17/27		EUR	750.000	0	0	% 108,480	813.600,00	0,60
XS2020670696	0,0000 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 19/22		EUR	1.025.000	1.025.000	0	% 100,200	1.027.044,88	0,76
XS1960678255	1,1250 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 19/27		EUR	400.000	0	275.000	% 106,151	424.604,00	0,31
XS1496343986	1,3980 % mFinance France S.A. MTN 16/20		EUR	500.000	0	0	% 101,273	506.365,00	0,37
FR0013425139	0,6250 % MMS USA Financing Inc. Notes 19/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 100,430	1.004.295,00	0,74
XS1401114811	2,6250 % MOL Magyar Olaj-és Gázipá.Nyrt Notes 16/23		EUR	1.000.000	0	0	% 108,103	1.081.030,00	0,80
XS1813593313	1,6250 % Mondi Finance PLC MTN 18/26		EUR	350.000	350.000	0	% 106,446	372.559,25	0,27
XS1706111876	0,0000 % Morgan Stanley FLR MTN 17/21		EUR	1.000.000	0	0	% 100,218	1.002.180,00	0,74
XS1989375503	0,6370 % Morgan Stanley FLR MTN 19/24		EUR	525.000	525.000	0	% 101,527	533.014,13	0,39
XS2013531228	0,3260 % NatWest Markets PLC FLR MTN 19/21		EUR	750.000	1.025.000	275.000	% 100,373	752.797,50	0,55
XS2048471002	0,1820 % NatWest Markets PLC FLR MTN 19/21		EUR	975.000	975.000	0	% 100,184	976.794,00	0,72
XS1974922442	1,1250 % Norsk Hydro ASA Bonds 19/25		EUR	550.000	775.000	225.000	% 103,095	567.022,50	0,42
PTNOSFOM0000	1,1250 % NOS, SGPS, S.A. Obrigações 18/23		EUR	500.000	0	0	% 102,758	513.790,00	0,38
XS2019814503	0,8000 % Omnicom Finance Holdings PLC Notes 19/27		EUR	525.000	525.000	0	% 100,776	529.074,00	0,39
XS1713466578	0,6000 % PerkinElmer Inc. Notes 18/21		EUR	800.000	0	0	% 100,900	807.200,00	0,59
XS2055627538	0,3750 % Raiffeisen Bank Intl AG MTN S.194 19/26		EUR	500.000	500.000	0	% 100,026	500.130,00	0,37
FR0013322146	0,1450 % RCI Banque S.A. FLR MTN 18/25		EUR	400.000	400.000	0	% 97,288	389.152,00	0,29
FR0013448669	0,2500 % RCI Banque S.A. MTN 19/23		EUR	275.000	275.000	0	% 99,863	274.621,88	0,20
XS1223842847	1,8750 % Redexis Gas Finance B.V. MTN 15/27		EUR	350.000	350.000	0	% 103,861	363.513,50	0,27
XS1189286286	2,5000 % REN Finance B.V. MTN S.2 15/25		EUR	400.000	0	0	% 111,567	446.268,00	0,33
IT0005383309	1,3500 % Republik Italien B.T.P. 19/30		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 104,318	1.043.180,00	0,77
XS1428088626	3,0000 % Republik Kroatien Notes 17/27		EUR	500.000	500.000	0	% 119,353	596.765,00	0,44
XS2031862076	0,1250 % Royal Bank of Canada MTN 19/24		EUR	550.000	550.000	0	% 99,680	548.240,00	0,40
RU000A0ZZVE6	2,8750 % Russische Föderation Notes 18/25 Reg.S		EUR	800.000	300.000	0	% 112,125	897.000,00	0,66
FR0013264884	0,1570 % SAFRAN FLR Obl. 17/21		EUR	400.000	0	0	% 100,354	401.416,00	0,30
XS2010045271	0,0000 % Schlumberger Finance B.V. Notes 19/24		EUR	525.000	525.000	0	% 99,871	524.322,75	0,39
XS0982303785	2,6250 % Sinopec Grp Over.Dev.2013 Ltd. Bonds 13/20 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 102,824	514.117,50	0,38
XS2051660335	0,0000 % Snam S.p.A. MTN 19/24		EUR	425.000	425.000	0	% 99,645	423.491,25	0,31
XS2051660509	1,0000 % Snam S.p.A. MTN 19/34 ¹⁾		EUR	275.000	275.000	0	% 100,168	275.462,00	0,20
FR0013430733	0,8750 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 19/26		EUR	400.000	700.000	300.000	% 102,089	408.356,00	0,30
XS0953958641	3,7500 % SPP Infrastructure Fing B.V. Notes 13/20		EUR	500.000	0	0	% 102,978	514.890,00	0,38
XS1676952481	0,8750 % SSE PLC MTN 17/25		EUR	500.000	500.000	0	% 102,479	512.392,50	0,38

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
XS1402176389	1,2500 % State Grid Overs.Inv.(16) Ltd. Notes 16/22 Reg.S		EUR	750.000	0	0	% 103,263	774.468,75	0,57
XS1582205040	1,1250 % Statkraft AS MTN 17/25		EUR	500.000	0	0	% 105,594	527.970,00	0,39
XS1788494257	0,8750 % Statnett SF MTN 18/25		EUR	400.000	0	0	% 104,692	418.768,00	0,31
XS1812887443	1,6250 % Stockland Trust Management Ltd MTN 18/26		EUR	250.000	0	0	% 105,227	263.066,25	0,19
XS1914502304	2,1250 % Stryker Corp. Notes 18/27		EUR	300.000	0	0	% 113,337	340.011,00	0,25
XS1843449395	3,0000 % Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. Notes 18/30 Reg.S ¹⁾		EUR	500.000	200.000	0	% 119,135	595.675,00	0,44
XS1907150350	1,1250 % Tele2 AB MTN 18/24		EUR	750.000	350.000	0	% 104,120	780.900,00	0,58
XS1571293684	1,8750 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. MTN 17/24		EUR	300.000	0	0	% 106,095	318.285,00	0,23
XS2056395606	0,0000 % Telenor ASA MTN 19/23		EUR	525.000	525.000	0	% 100,391	527.052,75	0,39
XS2049419398	1,1250 % Teollisuuden Voima Oyj MTN 19/26		EUR	250.000	450.000	200.000	% 99,797	249.491,25	0,18
XS1896851224	1,3750 % Tesco Corp. Treas. Serv. PLC MTN 18/23		EUR	600.000	400.000	200.000	% 103,297	619.779,00	0,46
XS1691349523	0,2170 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN 17/23		EUR	400.000	0	0	% 100,307	401.226,00	0,30
XS2043678841	0,1250 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 19/24 ¹⁾		EUR	600.000	1.500.000	900.000	% 99,336	596.016,00	0,44
XS2010044464	0,3750 % TLG IMMOBILIEN AG Anl. 19/22		EUR	300.000	300.000	0	% 100,365	301.095,00	0,22
XS1843435501	1,5000 % TLG IMMOBILIEN AG Anl. 19/26		EUR	300.000	900.000	600.000	% 103,397	310.191,00	0,23
XS1418835002	1,5000 % Transmission Finance DAC MTN 16/23		EUR	200.000	0	0	% 105,348	210.696,00	0,16
XS1239502328	2,0000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd MTN 15/25		EUR	350.000	0	0	% 109,974	384.909,00	0,28
XS1623404412	0,8500 % U.S. Bancorp MTN 17/24		EUR	300.000	0	200.000	% 103,775	311.325,00	0,23
FR0013431715	1,7500 % Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 19/49		EUR	300.000	500.000	200.000	% 105,094	315.282,00	0,23
XS2021993212	1,6250 % UniCredit S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 19/25		EUR	300.000	300.000	0	% 103,108	309.324,00	0,23
XS2017471553	1,2500 % UniCredit S.p.A. FLR Preferred MTN 19/25		EUR	700.000	700.000	0	% 103,277	722.935,50	0,53
XS1979280853	0,8750 % Verizon Communications Inc. Notes 19/27		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 103,167	1.341.171,00	0,99
XS1311331117	2,5000 % Vesteda Finance B.V. MTN 15/22		EUR	400.000	0	0	% 106,890	427.560,00	0,31
FR0013424868	0,6250 % Vivendi S.A. MTN 19/25		EUR	900.000	900.000	0	% 101,890	917.005,50	0,68
XS2002018500	1,6250 % Vodafone Group PLC MTN 19/30		EUR	900.000	900.000	0	% 107,298	965.677,50	0,71
XS2023306140	0,3750 % Volkswagen Bank GmbH MTN 19/22		EUR	500.000	500.000	0	% 100,347	501.732,50	0,37
XS1944390241	1,8750 % Volkswagen Bank GmbH MTN 19/24		EUR	1.200.000	0	0	% 105,446	1.265.346,00	0,93
XS1944390597	2,5000 % Volkswagen Bank GmbH MTN 19/26		EUR	500.000	0	0	% 109,940	549.697,50	0,40
XS2014292937	0,5000 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 19/22		EUR	450.000	450.000	0	% 100,862	453.879,00	0,33
XS1995748172	0,1000 % Volvo Treasury AB MTN 19/22		EUR	450.000	675.000	225.000	% 100,370	451.662,75	0,33
FR0013448032	0,2500 % Worldline S.A. Obl. 19/24		EUR	500.000	500.000	0	% 99,720	498.600,00	0,37
XS1378780891	2,2500 % Xylem Inc. Notes 16/23		EUR	650.000	650.000	0	% 106,400	691.600,00	0,51
XS0979598462	4,0000 % Západoslovenská energetika AS MTN 13/23		EUR	1.000.000	0	0	% 116,357	1.163.570,00	0,86
DE000A14J7G6	2,7500 % ZF North America Capital Inc. Notes 15/23 ¹⁾		EUR	300.000	300.000	0	% 106,694	320.080,50	0,24
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								29.056.099,48	21,40
Verzinsliche Wertpapiere								29.056.099,48	21,40
EUR								28.728.485,63	21,16
XS1148074518	1,8750 % Albemarle Corp. Notes 14/21		EUR	300.000	0	0	% 104,233	312.699,00	0,23
XS1713462585	0,7500 % Autoliv Inc. Notes 18/23		EUR	500.000	0	0	% 101,875	509.375,00	0,38
ES0213307053	0,7500 % Bankia S.A. Preferred Bonos 19/26		EUR	500.000	500.000	0	% 101,215	506.075,00	0,37
ES0313679K13	0,8750 % Bankinter S.A. Preferred Bonos 19/24 ¹⁾		EUR	500.000	0	0	% 103,437	517.182,50	0,38
XS1689523840	1,1250 % Brenntag Finance B.V. Notes 17/25		EUR	300.000	0	0	% 103,656	310.966,50	0,23
XS2051494495	1,1250 % British Telecommunications PLC MTN 19/29		EUR	350.000	500.000	150.000	% 99,610	348.635,00	0,26
XS1064307058	2,7500 % Coca-Cola European Partn. PLC Notes 14/26		EUR	400.000	400.000	0	% 115,006	460.024,00	0,34
XS1084942470	2,2500 % Corp.Nacion.del Cobre de Chile Notes 14/24 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 109,833	549.165,00	0,40
ES0205045018	1,5000 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 17/23		EUR	1.000.000	0	300.000	% 104,457	1.044.570,00	0,77

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
XS1996269061	0,6970 % Eaton Capital Unlimited Co. Notes 19/25		EUR	725.000	725.000	0	% 102,022	739.659,50	0,54
XS2001315766	1,3750 % Euronet Worldwide Inc. Notes 19/26		EUR	800.000	975.000	175.000	% 100,643	805.144,00	0,59
XS1117297512	2,5000 % Expedia Group Inc. Notes 15/22		EUR	1.000.000	250.000	0	% 105,657	1.056.570,00	0,78
XS1621351045	1,3750 % Experian Finance PLC MTN 17/26		EUR	400.000	0	0	% 106,457	425.828,00	0,31
XS1627343186	2,6290 % FCC Aqualia S.A. Notes 17/27		EUR	900.000	900.000	0	% 109,490	985.410,00	0,73
XS1843434017	0,3750 % Fiserv Inc. Notes 19/23		EUR	500.000	500.000	0	% 101,018	505.087,50	0,37
FR0013430840	1,6250 % Groupe VYV UMG Obl. 19/29		EUR	700.000	700.000	0	% 105,933	741.531,00	0,55
XS1843435253	0,2500 % Illinois Tool Works Inc. Notes 19/24		EUR	650.000	1.150.000	500.000	% 101,086	657.055,75	0,48
DE000A1919G4	1,7500 % JAB Holdings B.V. Bonds 18/26		EUR	400.000	0	0	% 106,949	427.794,00	0,32
XS1716208647	0,5000 % JIC Zhixin Ltd. Notes 17/20		EUR	1.000.000	0	0	% 100,351	1.003.510,00	0,74
XS1972557737	0,5000 % LG Chem Ltd. Notes 19/23 Reg.S		EUR	700.000	700.000	0	% 101,292	709.044,00	0,52
XS1974394675	1,6250 % Mexiko MTN 19/26		EUR	600.000	600.000	0	% 104,550	627.300,00	0,46
XS1890709774	0,9800 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. MTN 18/23		EUR	300.000	0	0	% 103,334	310.002,00	0,23
XS2028899727	0,3390 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. MTN 19/24		EUR	350.000	350.000	0	% 100,807	352.822,75	0,26
XS1801906279	0,1440 % Mizuho Financial Group Inc. FLR MTN 18/23		EUR	400.000	0	0	% 100,451	401.802,00	0,30
XS1117296381	2,0000 % Mohawk Industries Inc. Notes 15/22		EUR	300.000	0	0	% 104,090	312.268,50	0,23
XS1197270819	1,6250 % Mondelez International Inc. Notes 15/27		EUR	550.000	550.000	0	% 108,293	595.611,50	0,44
XS2056374353	0,8750 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV Notes 19/31 Reg.S		EUR	275.000	275.000	0	% 99,650	274.037,50	0,20
XS1492457236	1,2500 % Mylan N.V. Notes 16/20		EUR	500.000	0	0	% 101,321	506.605,00	0,37
XS1492457665	2,2500 % Mylan N.V. Notes 16/24		EUR	800.000	800.000	0	% 106,326	850.604,00	0,63
XS2060691040	0,3750 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 19/31		EUR	275.000	275.000	0	% 99,312	273.106,63	0,20
XS1084958989	2,7500 % ONGC Videsh Ltd. Notes 14/21 Reg.S		EUR	750.000	0	0	% 104,482	783.615,00	0,58
XS2013539635	1,0000 % Optus Finance Pty Ltd. MTN 19/29		EUR	425.000	425.000	0	% 104,835	445.548,75	0,33
XS2051788219	1,0000 % Origin Energy Finance Ltd. MTN 19/29		EUR	300.000	300.000	0	% 100,443	301.329,00	0,22
XS1996441066	0,8750 % Rentokil Initial PLC MTN 19/26 ¹⁾		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 102,041	1.224.492,00	0,90
XS2050933899	0,6000 % Republik Kasachstan MTN 19/26 Reg.S ¹⁾		EUR	585.000	585.000	0	% 99,830	584.005,50	0,43
XS2050933626	1,5000 % Republik Kasachstan MTN 19/34 Reg.S		EUR	325.000	325.000	0	% 99,908	324.701,00	0,24
XS1731882186	1,6250 % Roadster Finance DAC MTN 17/29		EUR	500.000	0	250.000	% 102,665	513.322,50	0,38
XS1212470972	3,2500 % Schaeffler Finance B.V. Notes 15/25 Reg.S		EUR	1.500.000	400.000	700.000	% 103,375	1.550.625,00	1,13
XS1321424670	2,2500 % Sky PLC MTN 15/25		EUR	500.000	0	400.000	% 113,181	565.902,50	0,42
XS1165754851	1,5000 % State Grid Eur.Dev.(2014) PLC Bonds S.A 15/22		EUR	750.000	0	0	% 103,392	775.436,25	0,57
XS1621087359	0,0500 % Sumitomo Mitsui Financ. Group FLR MTN 17/22		EUR	500.000	0	0	% 100,410	502.047,50	0,37
XS2058556296	0,1250 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 19/25		EUR	325.000	325.000	0	% 99,626	323.784,50	0,24
XS2058556619	0,8750 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 19/31		EUR	300.000	425.000	125.000	% 100,212	300.636,00	0,22
DE000A2R8NC5	0,1250 % Vonovia Finance B.V. MTN 19/23		EUR	400.000	400.000	0	% 100,184	400.734,00	0,30
DE000A2R8ND3	0,6250 % Vonovia Finance B.V. MTN 19/27		EUR	300.000	300.000	0	% 99,838	299.512,50	0,22
XS2054209320	0,4520 % Wintershall Dea Finance B.V. Notes 19/23		EUR	700.000	1.100.000	400.000	% 100,289	702.023,00	0,52
XS2054209833	0,8400 % Wintershall Dea Finance B.V. Notes 19/25		EUR	1.100.000	1.100.000	0	% 100,208	1.102.288,00	0,81
XS2055079904	1,8230 % Wintershall Dea Finance B.V. Notes 19/31		EUR	500.000	700.000	200.000	% 102,079	510.395,00	0,38
XS2052968596	1,3500 % WPC Eurobond B.V. Notes 19/28		EUR	400.000	400.000	0	% 99,651	398.602,00	0,29
USD								327.613,85	0,24
US571676AC90	3,6000 % Mars Inc. Notes 19/34 144A		USD	325.000	0	0	% 110,235	327.613,85	0,24
Summe Wertpapiervermögen							EUR	129.803.712,46	95,63
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Zinsterminkontrakte								68.790,00	0,05
	EURO Bobl Future (FGBM) Dez. 19	XEUR	EUR	-5.500.000				27.350,00	0,02
	EURO Bund Future (FGBL) Dez. 19	XEUR	EUR	-9.000.000				50.000,00	0,04
	EURO Buxl Future (FGBX) Dez. 19	XEUR	EUR	-300.000				-8.560,00	-0,01
Summe der Zins-Derivate								68.790,00	0,05
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								-969,90	0,00
Offene Positionen									
	USD/EUR 375.000,00	OTC						-969,90	0,00
Summe der Devisen-Derivate								-969,90	0,00
Swaps									
Zinsswaps								-4.772.074,60	-3,51
(Erhalten / Zahlen)									
	IRS 3-Monats-Euribor / 0,3400% EUR / DGZ_FRA 20.01.2022	OTC	EUR	2.000.000				-46.470,75	-0,03
	IRS 3-Monats-Euribor / 0,5990% EUR / DGZ_FRA 22.10.2021	OTC	EUR	3.500.000				-103.990,62	-0,08
	IRS 3-Monats-Euribor / 0,6090% EUR / DGZ_FRA 08.10.2021	OTC	EUR	3.000.000				-89.831,13	-0,07
	IRS 3-Monats-Euribor / 0,7350% EUR / DGZ_FRA 20.01.2027	OTC	EUR	5.000.000				-441.355,81	-0,33
	IRS 3-Monats-Euribor / 1,0090% EUR / DGZ_FRA 08.10.2024	OTC	EUR	3.000.000				-259.972,73	-0,19
	IRS 3-Monats-Euribor / 1,0400% EUR / DGZ_FRA 03.04.2020	OTC	EUR	2.000.000				-27.192,10	-0,02
	IRS 3-Monats-Euribor / 1,5450% EUR / DGZ_FRA 23.10.2020	OTC	EUR	9.000.000				-332.655,82	-0,25
	IRS 3-Monats-Euribor / 1,5860% EUR / DGZ_FRA 26.09.2020	OTC	EUR	7.000.000				-146.736,88	-0,11
	IRS 3-Monats-Euribor / 1,6850% EUR / DGZ_FRA 03.04.2024	OTC	EUR	2.000.000				-218.058,70	-0,16
	IRS 3-Monats-Euribor / 1,9430% EUR / DGZ_FRA 10.02.2020	OTC	EUR	2.000.000				-43.000,09	-0,03
	IRS 3-Monats-Euribor / 2,1430% EUR / DGZ_FRA 23.10.2024	OTC	EUR	2.000.000				-311.457,61	-0,23
	IRS 3-Monats-Euribor / 2.2470% EUR / DGZ_FRA 21.12.2020	OTC	EUR	3.000.000				-154.349,29	-0,11
	IRS 3-Monats-EURIBOR EUR / 0,525% EUR / DGZ_FRA 25.08.2022	OTC	EUR	5.000.000				-159.151,57	-0,12
	IRS 3-Monats-Euribor EUR / 0.005% EUR / DGZ_FRA 17.06.2023	OTC	EUR	3.000.000				-59.275,53	-0,04
	IRS 3-Monats-Euribor EUR / 0.0110% EUR / DGZ_FRA 23.06.2023	OTC	EUR	3.000.000				-59.936,34	-0,04
	IRS 3-Monats-Euribor EUR / 0.3560% EUR / DGZ_FRA 28.11.2022	OTC	EUR	4.000.000				-126.561,51	-0,09
	IRS 3-Monats-Euribor EUR / 0.3780% EUR / DGZ_FRA 25.11.2022	OTC	EUR	3.500.000				-113.604,69	-0,08
	IRS 3-Monats-Euribor EUR / 0.8400% EUR / DGZ_FRA 16.06.2036	OTC	EUR	1.000.000				-132.786,49	-0,10
	IRS EURIBORM03 EUR / -0.01% EUR / DGZ_FRA 05.06.2026	OTC	EUR	2.000.000				-54.124,89	-0,04
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.254% EUR / DGZ_FRA 22.11.2023	OTC	EUR	4.000.000				-138.405,60	-0,10
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.302% EUR / DGZ_FRA 21.03.2023	OTC	EUR	3.000.000				-91.698,09	-0,07
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.359% EUR / GOLDINT_LDN 15.08.2024	OTC	EUR	5.000.000				-213.199,43	-0,16
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.384% EUR / DGZ_FRA 14.07.2024	OTC	EUR	6.000.000				-263.374,44	-0,19
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.429% EUR / DGZ_FRA 21.03.2024	OTC	EUR	3.000.000				-132.935,62	-0,10
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.668% EUR / DGZ_FRA 04.11.2025	OTC	EUR	4.000.000				-299.566,57	-0,22
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.67% EUR / DGZ_FRA 02.06.2027	OTC	EUR	4.000.000				-329.915,81	-0,24
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.77% EUR / DGZ_FRA 22.11.2028	OTC	EUR	2.000.000				-207.576,79	-0,15
	IRS EURIBORM03 EUR / 1.092% EUR / DGZ_FRA 24.04.2030	OTC	EUR	1.500.000				-214.889,70	-0,16
Summe der Swaps								-4.772.074,60	-3,51
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	3.415.356,78			% 100,000	3.415.356,78	2,51
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	17.609,59			% 100,000	19.810,88	0,01

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	7.549,76			% 100,000	6.903,90	0,01
Tagesgelder									
	-0,64 % Landesbank Berlin AG		EUR	2.000.000,00			% 100,000	2.000.000,00	1,46
Summe der Bankguthaben²⁾								EUR 5.442.071,56	3,99
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR 5.442.071,56	3,99
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	780.433,44				780.433,44	0,57
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	304.258,30				304.258,30	0,22
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	676.169,71				676.169,71	0,50
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	1.352,87				1.352,87	0,00
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	4.970.000,00				4.970.000,00	3,65
	Sonstige Forderungen		EUR	1.214,40				1.214,40	0,00
Summe der sonstigen Vermögensgegenstände								EUR 6.733.428,72	4,94
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Erfolgsbezogener Vergütung		EUR	-223.259,73				-223.259,73	-0,16
	Verwaltungsvergütung		EUR	-25.373,86				-25.373,86	-0,02
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-1.240.092,22				-1.240.092,22	-0,91
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-446,43				-446,43	0,00
	Kostenpauschale		EUR	-13.840,28				-13.840,28	-0,01
	Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-57,68				-57,68	0,00
	Verbindlichkeiten aus negativen Einlagezinsen		EUR	-35,56				-35,56	0,00
Summe der sonstigen Verbindlichkeiten								EUR -1.503.105,76	-1,10
Fondsvermögen								EUR 135.771.852,48	100,00
Umlaufende Anteile Klasse S (A)								STK 1.437.897,000	
Anteilwert Klasse S (A)								EUR 94,42	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									95,63
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									-3,46

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

- ¹⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen (siehe Aufstellung).
²⁾ In dieser Position enthalten sind die für sonstige Derivate hinterlegten Sicherheiten.

Gesamtbetrag der bei Derivaten hinterlegten Sicherheiten

Euro-Guthaben bei:

DekaBank Deutsche Girozentrale	4.710.000,00
Goldman Sachs International	260.000,00

Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen

Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung		Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
			befristet	unbefristet	
1,3750 % AbbVie Inc. Notes 16/24	EUR	500.000		524.200,00	
1,1250 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 19/28	EUR	300.000		297.931,50	
1,7000 % Altria Group Inc. Notes 19/25	EUR	36.000		37.536,30	
0,8750 % Bankinter S.A. Preferred Bonos 19/24	EUR	300.000		310.309,50	
0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27	EUR	500.000		485.275,00	
3,2500 % BHP Billiton Finance Ltd. MTN 12/27	EUR	100.000		123.253,00	
0,1250 % BMW Finance N.V. MTN 19/22	EUR	650.000		652.574,00	
0,6250 % Caixabank S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	500.000		500.270,00	
1,0000 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 19/27	EUR	100.000		104.868,50	
0,6250 % Corporación Andina de Fomento MTN 19/24	EUR	1.250.000		1.272.225,00	
1,0000 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 19/27	EUR	492.000		506.750,16	
0,0000 % Dassault Systemes SE Notes 19/22	EUR	700.000		702.558,50	
1,8750 % Deutsche Bank AG MTN 19/22	EUR	400.000		407.870,00	
5,2000 % Hera S.p.A. MTN 13/28	EUR	300.000		415.872,00	
1,9500 % Iren S.p.A. MTN 18/25	EUR	50.000		54.352,50	
0,8750 % Rentokil Initial PLC MTN 19/26	EUR	778.000		793.878,98	
0,6000 % Republik Kasachstan MTN 19/26 Reg.S	EUR	570.000		569.031,00	
1,0000 % Snam S.p.A. MTN 19/34	EUR	275.000		275.462,00	
3,0000 % Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. Notes 18/30 Reg.S	EUR	500.000		595.675,00	
0,1250 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 19/24	EUR	515.000		511.580,40	
2,7500 % ZF North America Capital Inc. Notes 15/23	EUR	300.000		320.080,50	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:				9.461.553,84	9.461.553,84

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen empfangenen Sicherheiten:

Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	2.666.971,94 EUR
Renten und rentenähnliche Wertpapiere	10.823.895,95 EUR

Deka-Treasury CreditStrategie

Kostenanteil des Fonds	4.154,87	44,55
Ertragsanteil der KVG	4.154,87	44,55

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften gerechnet.
Der Ertragsanteil der KVG entspricht maximal dem Kostenanteil des Fonds. Der Kostenanteil der KVG ist auf Ebene des Sondervermögens im Einzelnen nicht bestimmbar.
Geschäftsbedingt gibt es bei Principalgeschäften keine expliziten Kosten durch Dritte. Sofern diese Geschäfte getätigt werden, sind Ertrags- und Kostenanteile Dritter über die in den Wertpapierleihesätzen enthaltenen Margen abgedeckt und damit bereits im Ertragsanteil des Fonds berücksichtigt. Bei Agencygeschäften werden Erträge und Kosten Dritter über eine Gebührenaufteilung (Fee split) definiert. Hier beträgt der Ertragsanteil des Agenten zwischen 20% und 35% vom Bruttoleihesatz.
Kosten Dritter als Agent der KVG werden nicht auf Ebene des Sondervermögens offengelegt.

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

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds
7,29% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps	
Wertpapier-Darlehen	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Deutsche Bank AG	5.686.608,06
DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genosschaftsbank	2.001.360,00
Bayerische Landesbank	1.853.412,09
Kering S.A.	1.170.240,50
Allianz SE	802.487,80
Nestlé S.A.	694.243,64
Berlin Hyp AG	603.921,11
The Goldman Sachs Group Inc.	578.049,62
Danone S.A.	100.545,07

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps
Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps	
Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer	2
Clearstream Banking Frankfurt	10.947.789,06 EUR
J.P.Morgan AG Frankfurt	2.543.078,83 EUR

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

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

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1877937851	2,1950 % 2i Rete Gas S.p.A. MTN 18/25	EUR	0	500.000
XS2026150313	1,0000 % A2A S.p.A. MTN 19/29	EUR	450.000	450.000
XS1883354620	0,8750 % Abbott Ireland Financing DAC Notes 18/23	EUR	0	1.200.000
XS1967635621	1,5000 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 19/24	EUR	0	300.000
FR0013399029	1,7500 % ACCOR S.A. Bonds 19/26	EUR	0	400.000
XS1004236185	3,2500 % Aeroporti di Roma S.p.A. MTN 13/21	EUR	0	400.000
FR0013426368	1,1250 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 19/34	EUR	400.000	400.000
XS2018636600	0,2500 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Notes 19/25	EUR	400.000	400.000
XS1622630132	0,5000 % Allergan Funding SCS Notes 17/21	EUR	0	500.000
XS1909193150	1,5000 % Allergan Funding SCS Notes 18/23	EUR	0	300.000
XS1843444081	1,0000 % Altria Group Inc. Notes 19/23	EUR	0	400.000
XS1957532887	0,3500 % American Honda Finance Corp. MTN 19/22	EUR	0	425.000
BE6301509012	0,0000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. FLR MTN 18/24	EUR	0	400.000
BE6312821612	1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. MTN 19/27	EUR	200.000	950.000
XS1715306012	1,0000 % Arountown SA MTN 17/25	EUR	0	200.000
XS1908273219	1,8750 % Aviva PLC MTN 18/27	EUR	0	500.000
XS1991397545	1,7500 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	400.000	400.000
XS2014287937	0,2500 % Banco Santander S.A. Preferred MTN 19/24	EUR	400.000	400.000

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1873982745	1,5000 % Barclays PLC MTN 18/23	EUR	100.000	500.000
XS1998215393	0,4000 % Baxter International Inc. Notes 19/24	EUR	525.000	525.000
XS1998215559	1,3000 % Baxter International Inc. Notes 19/29	EUR	500.000	500.000
XS2002532484	0,1740 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl Notes 19/21	EUR	625.000	625.000
XS1948612905	0,6250 % BMW Finance N.V. MTN 19/23	EUR	0	300.000
XS2010447238	0,7500 % BMW Finance N.V. MTN 19/26	EUR	475.000	475.000
FR0013398070	2,1250 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 19/27	EUR	0	300.000
FR0013444759	0,1250 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 19/26	EUR	600.000	600.000
XS1112850125	2,3750 % Booking Holdings Inc. Notes 14/24	EUR	0	350.000
XS1527126772	1,1170 % BP Capital Markets PLC MTN 16/24	EUR	0	500.000
XS1637863629	1,0770 % BP Capital Markets PLC MTN 17/25	EUR	0	350.000
XS1992927902	1,2310 % BP Capital Markets PLC MTN 19/31	EUR	725.000	725.000
FR0013429073	0,6250 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	500.000	500.000
BE0002601798	1,2500 % bpost S.A. Notes 18/26	EUR	0	400.000
XS1856833543	0,5000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 18/22	EUR	0	600.000
FR0013412947	0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Preferred MTN 19/26	EUR	800.000	800.000
XS2013574038	1,3750 % Caixabank S.A. Non-Preferred MTN 19/26	EUR	800.000	800.000
XS2010331440	1,6500 % Capital One Financial Corp. Notes 19/29	EUR	275.000	275.000
XS1996435688	1,0000 % CEPSA Finance S.A.U. MTN 19/25	EUR	600.000	600.000
XS1991190361	1,5000 % Ceske Drahv AS Notes 19/26	EUR	300.000	300.000
XS1733226747	1,0000 % Cheung Kong Inf.Fin.BVI Ltd. Notes 17/24	EUR	0	400.000
XS1980064833	1,2500 % Citigroup Inc. MTN 19/29	EUR	500.000	500.000
XS1806124753	1,2500 % CK Hutchison Eur.Fin.(18) Ltd. Notes 18/25	EUR	0	500.000
XS1969600748	1,7500 % CNH Industrial Finance Euro.SA MTN 19/27	EUR	0	300.000
XS1995795504	1,6250 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 19/31	EUR	575.000	575.000
XS1958648294	1,3750 % Colgate-Palmolive Co. Bonds 19/34	EUR	0	300.000
DE000C240N04	0,6250 % Commerzbank AG MTN IHS S.928 19/24	EUR	225.000	225.000
XS1991126431	1,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. Non-Preferred MTN 19/31	EUR	300.000	300.000
XS1958307461	1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Non-Pref. MTN 19/29	EUR	0	300.000
FR0013421815	1,0000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Preferred MTN 19/29	EUR	500.000	500.000
FR0013421369	1,1250 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 19/29	EUR	400.000	400.000
FR0013414091	1,6250 % Crédit Mutuel Arkéa Non-Preferred MTN 19/26	EUR	500.000	500.000
XS1957541953	1,3750 % Danske Bank AS Non-Preferred MTN 19/22	EUR	0	375.000
FR0013444536	0,0000 % Dassault Systemes SE Notes 19/24	EUR	400.000	400.000
FR0013444544	0,1250 % Dassault Systemes SE Notes 19/26	EUR	600.000	600.000
XS2049726990	0,2500 % Deutsche Lufthansa AG MTN 19/24	EUR	600.000	600.000
XS2050404800	0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.L. Notes 19/28	EUR	325.000	325.000
XS2050406177	1,3500 % DH Europe Finance II S.à r.L. Notes 19/39	EUR	250.000	250.000
XS1979262448	0,2500 % DNB Bank ASA Preferred MTN 19/24	EUR	750.000	750.000
XS2009152591	0,8750 % easyJet PLC MTN 19/25	EUR	325.000	325.000
XS1846632104	1,6250 % EDP Finance B.V. MTN 18/26	EUR	0	350.000
BE0002629104	1,3750 % Elia System Operator S.A./N.V. MTN 19/26	EUR	0	400.000
XS1915689746	1,2500 % Emerson Electric Co. Notes 19/25	EUR	0	350.000
XS1937665955	1,5000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 19/25	EUR	0	750.000
XS0906117980	3,2500 % Energa Finance AB MTN 13/20	EUR	0	500.000
XS1811024543	1,6590 % EP Infrastructure a.s. Notes 18/24	EUR	0	350.000
XS2000538343	0,8750 % Erste Group Bank AG Non Preferred MTN 19/26	EUR	600.000	600.000
XS2009861480	1,1250 % ESB Finance DAC MTN 19/30	EUR	275.000	275.000
XS2034629134	1,3000 % Fedex Corp. Notes 19/31	EUR	225.000	225.000
XS1720053229	0,2500 % Ferrari N.V. Notes 17/21	EUR	0	500.000
XS1843435923	2,0000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 19/30	EUR	625.000	625.000
XS0576395478	5,2500 % FMC Finance VII S.A. Notes 11/21	EUR	0	750.000
XS2013574202	1,5140 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 19/23	EUR	500.000	500.000
XS1936208419	2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 19/29	EUR	0	250.000
XS1529684695	1,3750 % Gas Networks Ireland MTN 16/26	EUR	0	400.000
XS1238902057	1,8750 % General Electric Co. Notes 15/27	EUR	500.000	500.000
XS1612542669	0,3750 % General Electric Co. Notes 17/22	EUR	0	400.000
XS2051397961	0,6250 % Glencore Finance (Europe) Ltd. MTN 19/24	EUR	675.000	675.000
XS1401174633	1,0000 % Heineken N.V. MTN 16/26	EUR	800.000	800.000
XS2027377576	1,0000 % Heineken N.V. MTN Tr.2 19/26	EUR	800.000	800.000
DE000A2YN2U2	0,5000 % HOCHTIEF AG MTN 19/27	EUR	775.000	775.000
FR0013444304	0,1000 % HSBC France S.A. MTN 19/27	EUR	500.000	500.000
XS1586214956	0,2900 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 17/22	EUR	0	600.000
XS1917614569	0,4640 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 18/21	EUR	0	750.000
XS1882544205	0,4540 % ING Groep N.V. FLR MT Resolu. Nts 18/23	EUR	0	1.600.000
XS1551306951	1,3750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 17/24	EUR	0	550.000
XS1785340172	1,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 18/28	EUR	300.000	300.000
XS1944456018	0,3750 % Intl Business Machines Corp. Notes 19/23	EUR	0	625.000
XS1945110606	1,2500 % Intl Business Machines Corp. Notes 19/27	EUR	250.000	750.000
XS2032727310	0,8750 % Italgas S.P.A. MTN 19/30	EUR	375.000	375.000
DE000A19HCW0	1,2500 % JAB Holdings B.V. Notes 17/24	EUR	0	500.000
BE0002631126	1,1250 % KBC Groep N.V. MTN 19/24	EUR	300.000	600.000
XS1883278183	0,8750 % Länsförsäkringar Bank AB MTN 18/23	EUR	0	400.000
XS1918000107	1,7500 % London Stock Exchange GroupPLC MTN 18/27	EUR	0	500.000
XS1803247557	1,1250 % Lunar Funding V PLC MT LPN Swisscom 18/26	EUR	0	500.000
XS1596739364	1,3750 % Madrileña Red de Gas Fin. B.V. MTN 17/25	EUR	0	600.000
XS1960678099	0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 19/23	EUR	0	675.000
XS2020670779	0,2500 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 19/25	EUR	800.000	800.000
XS2020671157	1,7500 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 19/49	EUR	475.000	475.000
XS2023644201	0,3750 % Merck Financial Services GmbH MTN 19/27	EUR	800.000	800.000

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2055089960	0,0000 % Metropolitan Life Global Fdg I MTN 19/22	EUR	375.000	375.000
FR0013447075	0,0500 % MMB SCF MT Obl. Foncières 19/29	EUR	400.000	400.000
FR0013425147	1,2500 % MMS USA Financing Inc. Notes 19/28	EUR	800.000	800.000
FR0013425154	1,7500 % MMS USA Financing Inc. Notes 19/31	EUR	400.000	400.000
XS1395010397	1,5000 % Mondi Finance PLC MTN 16/24	EUR	0	350.000
XS1511787407	0,3220 % Morgan Stanley FLR MTN S.G 16/22	EUR	0	500.000
XS1717202730	0,0000 % National Express Group PLC FLR MTN 17/20	EUR	0	450.000
XS1864037541	0,7500 % National Grid North Amer. Inc. MTN 18/23	EUR	0	400.000
XS2004795725	0,3750 % Nationale-Nederlanden Bank NV MTN 19/23	EUR	600.000	600.000
XS1884702207	0,4900 % NatWest Markets PLC FLR MTN 18/21	EUR	0	500.000
XS2002491517	1,0000 % NatWest Markets PLC MTN 19/24	EUR	350.000	350.000
XS1978668298	2,0000 % NIBC Bank N.V. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	400.000	400.000
XS1974922525	2,0000 % Norsk Hydro ASA Bonds 19/29	EUR	250.000	250.000
XS1851313863	1,7500 % O2 Telefónica Dtltd. Finanzier. Anl. 18/25	EUR	0	300.000
XS2019815062	1,4000 % Omnicom Finance Holdings PLC Notes 19/31	EUR	475.000	475.000
XS2022093517	1,0000 % OMV AG MTN 19/34	EUR	300.000	300.000
XS2014288158	0,3750 % OP Yrityspankki Oyj Non-Preferred MTN 19/24	EUR	275.000	275.000
XS1413583839	1,1680 % Opel Finance International BV MTN 16/20	EUR	0	500.000
FR0013396512	1,1250 % Orange S.A. MTN 19/24	EUR	0	1.000.000
FR0013396520	2,0000 % Orange S.A. MTN 19/29	EUR	0	400.000
FR0013444692	1,3750 % Orange S.A. MTN 19/49	EUR	400.000	400.000
XS0841018004	2,8750 % Origin Energy Finance Ltd. MTN 12/19	EUR	0	400.000
XS2035473748	0,1250 % Philip Morris Internat. Inc. Notes 19/26	EUR	650.000	650.000
XS2035474126	0,8000 % Philip Morris Internat. Inc. Notes 19/31	EUR	925.000	925.000
XS2035474555	1,4500 % Philip Morris Internat. Inc. Notes 19/39	EUR	625.000	625.000
XS2049583607	0,6250 % Prologis Euro Finance LLC Notes 19/31	EUR	625.000	625.000
XS1759603761	1,0000 % Prosegur - Cia de Seguridad SA Notes 18/23	EUR	0	400.000
XS1980189028	0,5000 % PSA Banque France S.A. MTN 19/22 Reg.S	EUR	300.000	300.000
XS2015267953	0,6250 % PSA Banque France S.A. MTN 19/24	EUR	300.000	300.000
FR0013309606	0,0720 % RCI Banque S.A. FLR MTN 18/23	EUR	0	400.000
FR0013428414	1,2500 % Renault S.A. MTN 19/25	EUR	500.000	500.000
XS2035620710	0,2500 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 19/27	EUR	300.000	300.000
IT0005366007	1,0000 % Republik Italien B.T.P. 19/22	EUR	1.500.000	2.000.000
XS2013677864	0,5000 % Republik Litauen MTN 19/29	EUR	650.000	650.000
XS1956050923	2,7500 % Republik Zypern MTN 19/34	EUR	0	350.000
XS1989383788	2,7500 % Republik Zypern MTN 19/49	EUR	350.000	350.000
XS1989375412	0,2500 % Royal Bank of Canada MTN 19/24	EUR	200.000	200.000
XS2049823680	1,1250 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB MTN 19/26	EUR	250.000	250.000
XS1956025651	1,0000 % Santander Consumer Finance SA MTN 19/24	EUR	0	300.000
XS1837975736	0,7500 % SBAB Bank AB (publ) MTN 18/23	EUR	0	500.000
XS2015240083	1,5000 % SELP Finance S.a.r.l. Notes 19/26	EUR	150.000	150.000
XS1955187775	0,9000 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 19/28	EUR	0	300.000
XS2049616894	0,5000 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 19/34	EUR	350.000	350.000
XS1986416268	0,8750 % Sika Capital B.V. Notes 19/27	EUR	300.000	300.000
XS1986416698	1,5000 % Sika Capital B.V. Notes 19/31	EUR	225.000	225.000
XS2020568734	0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken MTN 19/24	EUR	600.000	600.000
XS0552569005	4,5000 % Soc. Iniziat. Aut. e Serv.SIAS MTN 10/20	EUR	0	400.000
FR0013410818	1,7500 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 19/29	EUR	0	500.000
BE6315847804	0,5000 % Solvay S.A. Notes 19/29	EUR	400.000	400.000
XS1967582831	0,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA Preferred MTN 19/24	EUR	0	450.000
XS2049582542	0,0500 % Svenska Handelsbanken AB Non-Pref. MTN 19/26	EUR	575.000	575.000
XS2013536029	0,1250 % Svenska Handelsbanken AB Preferred MTN 19/24	EUR	700.000	700.000
DE0005YM7720	1,2500 % Symrise AG Anl. 19/25	EUR	375.000	375.000
XS1843449809	0,6780 % Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. FLR Nts 18/22 Reg.S	EUR	0	1.500.000
XS1946004451	1,0690 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 19/24	EUR	0	400.000
XS2020583618	1,9570 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 19/39	EUR	375.000	375.000
XS2001737324	0,7500 % Telenor ASA MTN 19/26	EUR	575.000	575.000
XS2001738991	1,7500 % Telenor ASA MTN 19/34	EUR	225.000	225.000
XS2002491863	1,5000 % TenneT Holding B.V. MTN 19/39	EUR	425.000	425.000
XS1955024713	0,7500 % The Coca-Cola Co. Notes 19/26	EUR	0	600.000
XS1575979148	2,0000 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC FLR MTN 17/23	EUR	0	600.000
XS1405775708	0,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 16/24	EUR	750.000	750.000
XS2004381674	0,6960 % Total Capital Intl S.A. MTN 19/28	EUR	600.000	600.000
XS2004381245	1,5350 % Total Capital Intl S.A. MTN 19/39	EUR	400.000	400.000
XS1997077364	1,4500 % Transurban Finance Co. Pty Ltd MTN 19/29	EUR	625.000	625.000
XS1810806635	0,6250 % UBS AG (London Branch) MTN 18/23	EUR	0	500.000
XS1374865555	2,0000 % UniCredit S.p.A. MTN 16/23	EUR	0	500.000
XS1979446843	1,5000 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. Preferred MTN 19/24	EUR	400.000	400.000
XS2009891479	0,5000 % Vattenfall AB MTN 19/26	EUR	350.000	350.000
XS1979280937	1,2500 % Verizon Communications Inc. Notes 19/30	EUR	625.000	625.000
XS1854166078	2,0000 % Vesteda Finance B.V. MTN 18/26	EUR	0	300.000
XS2049146215	0,5000 % Vier Gas Transport GmbH MTN 19/34	EUR	500.000	500.000
FR0013424876	1,1250 % Vivendi S.A. MTN 19/28	EUR	600.000	600.000
XS2002017361	0,9000 % Vodafone Group PLC MTN 19/26	EUR	400.000	400.000
XS1972547183	0,6250 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 19/22	EUR	0	500.000
FR0013417128	1,3750 % Wendel SE Obl. 19/26	EUR	400.000	400.000
XS2028104037	1,6250 % Westlake Chemical Corp. Notes 19/29	EUR	300.000	300.000
XS1782806357	1,7500 % Západoslovenská energetika AS MTN 18/28	EUR	0	800.000
GBP				
XS1989383192	2,5000 % Tesco Corp. Treas. Serv. PLC MTN 19/25	GBP	100.000	100.000

Deka-Treasury CreditStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2031923126	3,5000 % Tesco Personal Fin. Gr. PLC MTN 19/25	GBP	375.000	375.000
USD				
US69370RAD98	3,6500 % PT Pertamina (Persero) MTN 19/29 Reg.S	USD	200.000	200.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1405816312	1,8750 % Alimentation Couche-Tard Inc. Notes 16/26 Reg.S	EUR	0	350.000
XS2006277508	0,7500 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 19/27	EUR	750.000	750.000
XS2055190172	1,1250 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/25	EUR	300.000	300.000
ES0313307201	0,8750 % Bankia S.A. Preferred Bonos 19/24	EUR	0	500.000
CH0485252834	1,0000 % Credit Suisse Group AG FLR MTN Tr.2 19/27	EUR	275.000	275.000
ES0305045009	1,3750 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 19/24	EUR	400.000	400.000
XS0783933350	5,8750 % EP Energy A.S. Notes 12/19 Reg.S	EUR	0	425.000
XS2034622048	1,6980 % EP Infrastructure a.s. Notes 19/26	EUR	350.000	350.000
XS1640492648	0,4000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 17/21	EUR	0	800.000
XS1843434280	1,1250 % Fiserv Inc. Notes 19/27	EUR	350.000	350.000
XS1843435170	0,6250 % Illinois Tool Works Inc. Notes 19/27	EUR	900.000	900.000
XS1853426549	1,5000 % Informa PLC MTN 18/23	EUR	0	350.000
XS2042667944	0,6250 % Kerry Group Financial Services Notes 19/29	EUR	400.000	400.000
XS1989759748	0,5000 % Logisor Financing S.à.r.l. MTN 19/21	EUR	325.000	325.000
XS1963744260	0,9000 % McDonald's Corp. MTN 19/26	EUR	0	400.000
XS1974394758	2,8750 % Mexiko MTN 19/39	EUR	150.000	150.000
XS2049630028	0,4020 % Mizuho Financial Group Inc. MTN 19/29	EUR	475.000	475.000
XS1843442622	1,7500 % Nasdaq Inc. Notes 19/29	EUR	0	225.000
XS1691349796	0,9180 % NorteGas Energia Distribuc.SAU MTN 17/22	EUR	0	500.000
XS1963553919	0,7500 % PepsiCo Inc. Notes 19/27	EUR	0	250.000
XS1568874983	3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/24	EUR	0	400.000
XS2012546714	1,4500 % Republik Indonesien Notes 19/26	EUR	450.000	450.000
XS1966038249	1,3750 % Telstra Corp. Ltd. MTN 19/29	EUR	0	175.000
XS2058556536	0,5000 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 19/28	EUR	350.000	350.000
XS2052321093	1,5000 % Verizon Communications Inc. Notes 19/39	EUR	300.000	300.000
USD				
US15089QAJ31	3,5000 % Celanese US Holdings LLC Notes 19/24	USD	250.000	250.000
XS1992085867	4,2500 % ENI S.p.A. Notes 19/29 Reg.S	USD	200.000	200.000
US459200JZ55	3,3000 % Intl Business Machines Corp. Notes 19/26	USD	375.000	375.000
US459200KC42	4,2500 % Intl Business Machines Corp. Notes 19/49	USD	225.000	225.000
US517834AF40	3,9000 % Las Vegas Sands Corp. Notes 19/29	USD	100.000	100.000

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

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

Eigenmittel zum 31. Dezember 2018

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

Vorstand

Holger Hildebrandt
Mitglied des Verwaltungsrats der
Deka Immobilien Luxembourg S.A., Luxemburg

Eugen Lehnertz

Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Stand: 30. September 2019

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

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretender Vorsitzender

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

Unabhängiges Mitglied

Marie-Anne van den Berg, Luxemburg

Verwahr- und Zahlstelle

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

Cabinet de révision agréé für den Fonds und die Verwaltungsgesellschaft

KPMG Luxembourg
Société coopérative
39, avenue John F. Kennedy
1855 Luxembourg,
Luxemburg



Deka International S.A.

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

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