
DB Advisors SICAV

Halbjahresbericht 2020

- DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy
- DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy
- DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy
- DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (SICAV)
nach Luxemburger Recht



Hinweise für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Für den Teilfonds **DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy** ist keine Anzeige nach § 310 KAGB bei der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht erstattet worden, d.h. der Teilfonds darf in der Bundesrepublik Deutschland somit nicht vertrieben werden.

Die Satzung, der Verkaufsprospekt, die „Wesentlichen Anlegerinformationen“, Halbjahres- und Jahresberichte, Ausgabe- und Rücknahmepreise sind kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft, den Zahl- und Informationsstellen sowie im Internet unter www.dws.com erhältlich.

Der Verwaltungsgesellschaftsvertrag, der Verwahrstellenvertrag, der Fondsmanagementvertrag und Beratungsverträge können an jedem Bankarbeitstag in Frankfurt am Main während der üblichen Geschäftszeiten in der Geschäftsstelle der nachfolgend angegebenen Zahl- und Informationsstellen eingesehen werden. Bei den Zahl- und Informationsstellen werden darüber hinaus die jeweils aktuellen Nettoinventarwerte je Anteil sowie die Ausgabe- und Rückgabepreise der Anteile zur Verfügung gestellt.

Rücknahme- und Umtauschanträge können bei den deutschen Zahlstellen eingereicht werden. Sämtliche Zahlungen (Rücknahmeerlöse, etwaige Ausschüttungen und sonstige Zahlungen) können durch die deutschen Zahlstellen an die Anteilinhaber ausgezahlt werden.

Sonstige Mitteilungen an die Anteilinhaber werden im Internet unter www.dws.com 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.

Zahl- und Informationsstelle für Deutschland ist:

Deutsche Bank AG
Taunusanlage 12
60325 Frankfurt am Main, Deutschland
und deren Filialen

Inhalt

Halbjahresbericht 2020
vom 1.1.2020 bis 30.6.2020

Hinweise	2
Beschreibung der Pools und Overlays	3
Halbjahresbericht DB Advisors SICAV	
DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy	8
DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy	28
DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy	42
DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy	49

Hinweise

Die in diesem Bericht genannten Fonds sind Teilfonds einer SICAV (Société d'Investissement à Capital Variable) nach 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 DWS Investment S.A. kostenfrei reinvestiert werden. Angaben zur bisherigen Wert-

entwicklung 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 2020** wieder (sofern nichts anderes angegeben ist).

Verkaufsprospekte

Der Kauf von Fondsanteilen erfolgt auf Grundlage des zzt. gültigen Verkaufsprospekts sowie des Dokuments „Wesentliche Anlegerinformationen“ und der Satzung der SICAV, ergänzt durch den jeweiligen letzten geprüften Jahresbericht und zusätzlich durch den jeweiligen

Halbjahresbericht, falls ein solcher jüngeren Datums als der letzte Jahresbericht vorliegt.

Ausgabe- und Rücknahmepreise

Die jeweils gültigen Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie alle sonstigen Informationen für die Aktionäre 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.

Coronakrise

Seit Januar 2020 hat sich das Coronavirus ausgebreitet und in der Folgezeit zu einer ernsten, wirtschaftlichen Krise geführt, deren konkrete Auswirkungen auf die Konjunktur, einzelne Märkte und Branchen aufgrund des hohen Grads an Unsicherheit aktuell noch nicht verlässlich abschätzbar sind. Angesichts dessen hat sich der Verwaltungsrat der SICAV nach Gesprächen mit den wichtigsten Dienstleistern davon überzeugt, dass die getroffenen Maßnahmen und Pläne zur Sicherstellung der Fortführung des Geschäftsbetriebs die derzeit absehbaren bzw. laufenden operativen Risiken eindämmen und gewährleisten, dass die Tätigkeiten der jeweiligen Teilfonds nicht unterbrochen werden. Der Ausbruch und die Dynamik der globalen Ausbreitung des Virus haben jedoch dazu geführt, dass die möglichen Auswirkungen im Jahr 2020 mit bedeutenden Unsicherheiten behaftet und zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts nicht abschließend beurteilbar sind. Der Verwaltungsrat trägt dafür Sorge, dass die Verwaltungsgesellschaft alle als angemessen erachteten Maßnahmen ergreift, um die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen.

Sofern im Besonderen Teil des Verkaufsprospektes für einen bestimmten Teilfonds nicht etwas anderes festgelegt ist, werden Anteile an den Teilfonds des Umbrella-Fonds DB Advisors SICAV nur an Gesellschaften ausgegeben, bei denen es sich um i) Institute für die betriebliche Altersversorgung oder ähnliche Anlageinstrumente handelt oder um ii) Organismen, die die von ihnen gehaltenen Mittel zur Bereitstellung von Altersversorgungsleistungen an ihre Angestellten anlegen, was in Bezug auf die jeweiligen Teilfonds oder Anteilklassen noch näher angegeben sein kann.

Die Gesellschaft behält sich das Recht vor, Anteile von Anlegern zum Rücknahmepreis zurückzukaufen, sofern ein Anleger diese Voraussetzung nicht erfüllt.

Beschreibung der Pools und Overlays

Dem Umbrellafonds DB Advisors SICAV liegt eine Asset Pooling-Struktur zu Grunde. Diese Struktur erlaubt es, dass die Teilfonds der SICAV in Pools und Overlays investieren, die sich sowohl in der Anlagestrategie als auch im Investment-universum unterscheiden können. Ziel ist es, dem Investor zu ermöglichen, über die Teilfonds in die Pools und Overlays zu investieren, wobei der Teilfonds als „Asset Allocation Manager“ funktioniert.

Die DB Advisors SICAV verfügt derzeit über vier aktive Teilfonds, den DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy, den DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy, den DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy und den DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy.

Der Teilfonds DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy ist in folgenden Pools und Overlays investiert:

Pools

Euroland Government Bonds

Art des Portfolios

Euroland Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

50% Markit iBoxx EUR Sovereign AAA-AA ex France 15y+ quality weighted index, 50% Markit iBoxx EUR Germany 15y+

Corporate Bonds Euroland

Art des Portfolios

Euroland Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

Verbindlichkeitsstruktur der Pensionszusagen

ESG Corporate Bonds Euroland

Art des Portfolios

Global Fixed Income (ESG)

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

iBoxx Euro Corporate

Alternative Investments

Art des Portfolios

Alternative Investments

Anlageziel

Absolute Return

Benchmark

Euribor 3 months + 250 BP

Emerging Markets Sovereign Bonds

Art des Portfolios

Global Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

100% JP Morgan EMBIG Diversified Investment Grade (hedged in EUR)

USD Investment Grade Corporate Bonds

Art des Portfolios

Investment Grade Corporate Bonds benannt in USD

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

Verbindlichkeitsstruktur der Pensionszusagen

Passive EM Sovereign Bonds

Art des Portfolios

Emerging Markets Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

50% JPM EMBI Plus customized (hedged in EUR) und 50% JPM GBI EM diversified (unhedged in EUR)

Overlays

IRS Overlay

Art des Portfolios

Durations-Overlay

Anlageziel

Absicherung von Zinsrisiken

Benchmark

entfällt

ILS Overlay

Art des Portfolios

Inflations-Overlay

Anlageziel

Absicherung von Inflationsrisiken

Benchmark

entfällt

TAA

Art des Portfolios

Tactical Asset Allocation Overlay

Anlageziel

Absicherung von Kapitalmarktrisiken

Benchmark

entfällt

Credit Overlay

Art des Portfolios

Credit Overlay

Anlageziel

Absicherung von Kreditrisiken

Benchmark

entfällt

Der Teilfonds DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy ist in folgenden Pools und Overlays investiert:

Pools

Government Bonds

Art des Portfolios

EUR fixed income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

Markit iBoxx EUR Sovereign AAA-AA ex France 15y+ quality weighted index

Corporate Bonds

Art des Portfolios

Global Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

iBoxx EUR Corporates ex Periphery

High-Yield & Convertibles

Art des Portfolios

Alternative Investments

Anlageziel

Absolute Return

Benchmark

entfällt

USD Investment Grade Corporate Bonds II

Art des Portfolios

Investment Grade Corporate Bonds benannt in USD

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

Bloomberg Barclays US Corporates Total Return, hedged in Euro

Emerging Markets Bonds

Art des Portfolios

Emerging Markets Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

100% JPMorgan EMBI Global Diversified Investment Grade, hedged in EUR

Overlays

IRS Overlay II

Art des Portfolios

Durations-Overlay

Anlageziel

Absicherung von Zinsrisiken

Benchmark

entfällt

TAA II

Art des Portfolios

Tactical Asset Allocation Overlay

Anlageziel

Absicherung von Zinsrisiken

Benchmark

entfällt

Der Teilfonds DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy ist in folgenden Pools und Overlays investiert:

Pools

Euroland Government Bonds PB

Art des Portfolios

Euroland Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Liability Benchmark

Benchmark

Verbindlichkeitsstruktur der Pensionszusagen

EUR Corporate Bonds PB

Art des Portfolios

Euroland Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

Verbindlichkeitsstruktur der Pensionszusagen

ILS Overlay PB (seit 28. Mai 2019)

Art des Portfolios

Inflations-Overlay

Anlageziel

Absicherung von Inflationsrisiken

Benchmark

entfällt

Overlays

IRS Overlay PB

Art des Portfolios

Durations-Overlay

Anlageziel

Absicherung von Zinsrisiken

Benchmark

entfällt

Der Teilfonds DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy ist in folgenden Pools und Overlays investiert:

Pools

EU Government Bonds BSPK

Art des Portfolios

Euroland Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

Verbindlichkeitsstruktur der Pensionszusagen

EU Corporate Bonds BSPK

Art des Portfolios

Euroland Fixed Income

Anlageziel

Outperformance der Benchmark

Benchmark

Verbindlichkeitsstruktur der Pensionszusagen

ILS Overlay BSPK (seit 28. Mai 2019)

Art des Portfolios

Inflations-Overlay

Anlageziel

Absicherung von Inflationsrisiken

Benchmark

entfällt

Overlays

IRS Overlay BSPK

Art des Portfolios

Durations-Overlay

Anlageziel

Absicherung von Zinsrisiken

Benchmark

entfällt

Halbjahresbericht

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

DB ADVISORS ENHANCED FIXED INCOME STRATEGY

Wertentwicklung im Überblick

ISIN	6 Monate
LU0416541984	2,6%

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

Stand: 30.6.2020

Angaben auf Euro-Basis

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensübersicht zum 30.6.2020

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen (Emittenten)		
Unternehmen	4 775 307 551,41	74,80
Zentralregierungen	1 312 555 286,81	20,52
Summe Anleihen	6 087 862 838,22	95,32
2. Derivate	30 477 328,24	0,48
3. Bankguthaben	321 766 097,75	5,04
4. Sonstige Vermögensgegenstände	60 640 828,09	0,95
II. Verbindlichkeiten		
1. Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-51 973 739,46	-0,81
2. Sonstige Verbindlichkeiten	-61 917 863,23	-0,98
III. Fondsvermögen	6 386 855 489,61	100,00

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

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensaufstellung zum 30.6.2020

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						6 016 567 999,78	94,21
Verzinsliche Wertpapiere							
0,01 %	Brazil Letras do Tesouro Nacional 2017/2021	EUR 590 000	130 000		% 977,081	934 779,22	0,01
0,01 %	Brazil Letras do Tesouro Nacional 2018/2022	BRL 880 000	5 340 000	5 080 000	% 956,978	1 365 561,24	0,02
0,01 %	Brazil Letras do Tesouro Nacional 2018/2022	BRL 640 000	100 000		% 932,432	967 662,54	0,01
0,01 %	Brazil Letras do Tesouro Nacional 2020/2024	BRL 520 000	4 390 000	3 870 000	% 841,173	709 275,84	0,01
10 %	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 2012/2023	BRL 1 120 000	180 000	20 000	% 1 135,529	2 062 257,32	0,03
10 %	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 2014/2025	BRL 920 000	850 000	580 000	% 1 168,757	1 743 566,31	0,03
10 %	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 2016/2027	BRL 670 000	890 000	700 000	% 1 182,976	1 285 219,81	0,02
10 %	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 2018/2029	BRL 360 000	110 000	50 000	% 1 198,687	699 736,98	0,01
0,01 %	Spain Letras del Tesoro 2019/2023	BRL 1 250 000	1 120 000	750 000	% 873,567	1 770 650,45	0,03
4,7 %	Czech Republic Government Bond 2007/2022	CZK 38 000 000	16 000 000	2 500 000	% 110,233	1 572 243,76	0,02
5,7 %	Czech Republic Government Bond 2009/2024	CZK 33 500 000	9 100 000	2 000 000	% 120,884	1 519 975,15	0,02
3,85 %	Czech Republic Government Bond 2010/2021	CZK 20 000 000			% 104,872	787 252,78	0,01
2,5 %	Czech Republic Government Bond 2013/2028	CZK 36 000 000			% 114,273	1 544 076,76	0,02
2,4 %	Czech Republic Government Bond 2014/2025	CZK 34 700 000			% 109,518	1 426 387,92	0,02
1 %	Czech Republic Government Bond 2015/2026	CZK 39 000 000	5 000 000	6 000 000	% 102,346	1 498 159,37	0,02
0,95 %	Czech Republic Government Bond 2015/2030	CZK 25 000 000			% 101,326	950 792,10	0,01
2 %	Czech Republic Government Bond 2017/2033	CZK 28 300 000	28 300 000		% 113,521	1 205 828,06	0,02
2,75 %	Czech Republic Government Bond 2018/2029	CZK 28 000 000	1 800 000		% 117,439	1 234 221,71	0,02
8,9 %	Dominican Republic International Bond (MTN) 2018/2023	DOP 11 200 000			% 93,138	158 832,37	0,00
9,75 %	Dominican Republic International Bond (MTN) 2019/2026	DOP 15 000 000			% 89,573	204 578,68	0,00
1,5 %	3M Co. 2016/2031	EUR 20 363 000			% 111,280	22 659 844,59	0,35
0,5 %	AbbVie, Inc. -Reg- 2020/2021	EUR 380 000	380 000		% 100,015	380 055,10	0,01
7,125 %	ABN AMRO Bank NV (MTN) 2012/2022	EUR 240 000			% 112,824	270 776,40	0,00
0,6 %	ABN AMRO Bank NV (MTN) 2020/2027	EUR 700 000	700 000		% 98,764	691 344,50	0,01
1,75 %	ACEA SpA (MTN) 2019/2028	EUR 220 000	220 000		% 106,152	233 533,30	0,00
1,5 %	Adecco International Financial Services BV (MTN) 2015/2022	EUR 12 000			% 102,565	12 307,74	0,00
2,125 %	Aeroports de Paris (MTN) 2020/2026	EUR 500 000	500 000		% 107,503	537 515,00	0,01
1 %	Aeroports de Paris (MTN) 2020/2029	EUR 700 000	700 000		% 98,521	689 643,50	0,01
2,75 %	Aeroports de Paris (MTN) 2020/2030	EUR 400 000	400 000		% 113,634	454 536,00	0,01
2,125 %	Aeroports de Paris 2018/2038 **	EUR 11 800 000			% 106,889	12 612 843,00	0,20
1,125 %	Aeroports de Paris 2019/2034	EUR 18 400 000			% 96,943	17 837 512,00	0,28
1,5 %	Aeroports de Paris 2020/2032	EUR 14 100 000	600 000		% 100,199	14 128 059,00	0,22
1,25 %	AIB Group PLC (MTN) 2019/2024	EUR 590 000			% 100,123	590 725,70	0,01
0,625 %	Air Liquide Finance SA (MTN) 2019/2030	EUR 16 400 000			% 103,122	16 911 926,00	0,26
1,375 %	Air Liquide Finance SA 2020/2030 **	EUR 3 500 000	3 500 000		% 109,380	3 828 282,50	0,06
0,8 %	Air Products and Chemicals Inc 2020/2032	EUR 10 030 000	10 030 000		% 100,728	10 102 968,25	0,16
1,375 %	Airbus Finance BV 2016/2031	EUR 11 649 000			% 101,865	11 866 253,85	0,19
1,125 %	Albemarle New Holding GmbH (MTN) 2019/2025	EUR 390 000			% 98,399	383 754,15	0,01
1,625 %	Albemarle New Holding GmbH (MTN) 2019/2028	EUR 720 000			% 95,715	689 144,40	0,01
1 %	Alliander NV 2018/perpetual *	EUR 800 000			% 102,384	819 068,00	0,01
0,875 %	Alliander NV 2019/2032	EUR 13 679 000			% 106,122	14 516 428,38	0,23
1 %	Allianz Finance II BV (MTN) 2011/2041 *	EUR 200 000			% 104,680	209 359,00	0,00
0,5 %	Allianz Finance II BV (MTN) 2020/2031	EUR 31 000 000	41 000 000	10 000 000	% 100,866	31 268 460,00	0,49
1,375 %	Allianz Finance II BV 2016/2031	EUR 28 200 000			% 109,759	30 951 897,00	0,48
1 %	Allianz SE 2015/2045 *	EUR 400 000			% 104,326	417 302,00	0,01
1,125 %	Amcor UK Finance PLC (MTN) 2020/2027	EUR 400 000	800 000	400 000	% 100,979	403 914,00	0,01
0,55 %	American Honda Finance Corp. (MTN) 2018/2023	EUR 520 000			% 100,126	520 652,60	0,01
1,95 %	American Honda Finance Corp. 2020/2024	EUR 250 000	250 000		% 105,562	263 905,00	0,00
2,125 %	Anheuser-Busch InBev SA (MTN) 2020/2027	EUR 260 000	260 000		% 108,383	281 794,50	0,00
1,15 %	Anheuser-Busch InBev SA/NV (MTN) 2018/2027	EUR 780 000			% 102,454	799 137,30	0,01
3,25 %	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2013/2033	EUR 7 205 000			% 118,619	8 546 498,95	0,13
2,75 %	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2016/2036	EUR 53 310 000	9 550 000		% 110,579	58 949 664,90	0,92
1,65 %	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2019/2031	EUR 800 000			% 103,271	826 164,00	0,01
3,7 %	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2020/2040	EUR 11 960 000	400 000		% 121,430	14 522 968,20	0,23
1,375 %	Apple Inc 2017/2029 **	EUR 28 784 000			% 110,101	31 691 471,84	0,50
0,5 %	Apple, Inc. 2019/2031	EUR 35 430 000	30 000 000	15 000 000	% 102,112	36 178 104,45	0,57
1,875 %	APRR SA 2016/2031	EUR 15 000 000			% 111,224	16 683 600,00	0,26
1,625 %	APRR SA 2017/2032	EUR 10 300 000			% 109,570	11 285 658,50	0,18
1,125 %	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA (MTN) 2018/2025	EUR 600 000			% 104,254	625 521,00	0,01
1 %	Arkema SA (MTN) 2019/perpetual *	EUR 400 000			% 100,423	401 692,00	0,01
1 %	Arkema SA 2020/perpetual *	EUR 500 000	500 000		% 94,399	471 995,00	0,01
1 %	Aroundtown SA (MTN) 2017/2025	EUR 600 000			% 99,732	598 389,00	0,01
1 %	ASR Nederland NV 2019/2049 *	EUR 500 000			% 104,131	520 652,50	0,01
1 %	Assicurazioni Generali SpA (MTN) 2016/2048 *	EUR 365 000	365 000		% 112,106	409 185,08	0,01
5,125 %	Assicurazioni Generali SpA 2009/2024	EUR 1 800 000			% 119,539	2 151 702,00	0,03
2,45 %	AT&T Inc 2015/2035	EUR 12 596 000			% 106,429	13 405 733,86	0,21
3,15 %	AT&T Inc 2017/2036 **	EUR 17 960 000			% 113,359	20 359 276,40	0,32
1,95 %	AT&T Inc 2019/2023	EUR 155 000			% 103,559	160 516,45	0,00

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
2,05 % AT&T Inc 2020/2032	EUR	310 000	310 000		104,161	322 899,10	0,00
0,25 % AT&T, Inc. (MTN) 2019/2026	EUR	640 000			96,461	617 347,20	0,01
3,375 % AT&T, Inc. 2014/2034	EUR	13 908 000			119,159	16 572 564,18	0,26
1,8 % AT&T, Inc. 2019/2039	EUR	16 080 000			93,908	15 100 406,40	0,24
2,6 % AT&T, Inc. 2020/2038	EUR	7 750 000	7 750 000		105,866	8 204 615,00	0,13
0,625 % AusNet Services Holdings Pty Ltd. (MTN) 2020/2030	EUR	9 870 000	9 870 000		100,910	9 959 817,00	0,16
3,15 % Austria Government Bond 2012/2044	EUR	5 040 000	380 000		168,868	8 510 922,00	0,13
1,375 % Autoroutes du Sud de la France SA 2019/2031	EUR	18 100 000			108,952	19 720 221,50	0,31
0,625 % Aviva PLC (MTN) 2016/2023	EUR	220 000			101,182	222 600,40	0,00
1 % AXA SA 2014/2049 *	EUR	600 000			109,296	655 773,00	0,01
0,375 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA (MTN) 2019/2026	EUR	700 000			98,853	691 967,50	0,01
1 % Banco de Sabadell SA 2020/2023 *	EUR	300 000	300 000		100,687	302 061,00	0,00
0,3 % Banco Santander SA (MTN) 2019/2026	EUR	300 000			99,756	299 266,50	0,00
1,375 % Banco Santander SA (MTN) 2020/2026	EUR	400 000	400 000		101,785	407 138,00	0,01
1,125 % Banco Santander SA (MTN) 2020/2027	EUR	500 000	500 000		100,663	503 315,00	0,01
1 % Bank of America Corp (MTN) 2020/2029 *	EUR	310 000	310 000		119,793	371 356,75	0,01
0,75 % Bank of America Corp. (MTN) 2016/2023	EUR	560 000			101,143	566 400,80	0,01
0,875 % Bankia SA (MTN) 2019/2024	EUR	500 000			99,526	497 627,50	0,01
0,75 % Bankia SA (MTN) 2019/2026	EUR	700 000			96,975	678 825,00	0,01
0,875 % Bankinter SA (MTN) 2019/2024	EUR	500 000			101,349	506 745,00	0,01
0,625 % Bankinter SA (MTN) 2020/2027	EUR	700 000	700 000		94,573	662 011,00	0,01
2,625 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2014/2024	EUR	500 000			109,246	546 227,50	0,01
0,5 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2018/2022	EUR	500 000			100,996	504 977,50	0,01
1,25 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2020/2030	EUR	11 500 000	300 000		102,968	11 841 320,00	0,18
1 % Barclays PLC (MTN) 2019/2025	EUR	480 000			97,967	470 239,20	0,01
1 % Barclays PLC (MTN) 2020/2025 *	EUR	370 000	740 000	370 000	107,552	397 942,40	0,01
2,875 % BASF SE 2013/2033	EUR	15 500 000			123,452	19 134 982,50	0,30
0,875 % BASF SE 2016/2031	EUR	14 049 000			103,723	14 571 974,03	0,23
1,625 % BASF SE 2017/2037 **	EUR	23 941 000			111,053	26 587 198,73	0,42
1,5 % BASF SE 2018/2030	EUR	14 387 000		1 940 000	110,719	15 929 142,53	0,25
0,01 % Belfius Bank SA (MTN) 2019/2026	EUR	700 000			96,947	678 625,50	0,01
4,25 % Belgium Government Bond 2010/2041	EUR	8 300 000	2 470 000	3 100 000	175,985	14 606 713,50	0,23
1,625 % Berkshire Hathaway Inc 2015/2035	EUR	18 720 000			112,924	21 139 279,20	0,33
0,75 % BMW Finance NV (MTN) 2017/2024	EUR	500 000			101,874	509 370,00	0,01
0,375 % BMW Finance NV (MTN) 2019/2027	EUR	710 000			98,069	696 286,35	0,01
1,5 % BMW Finance NV (MTN) 2019/2029 **	EUR	25 879 000			105,118	27 203 487,22	0,43
0,125 % BMW Finance NV 2019/2022	EUR	580 000			99,778	578 712,40	0,01
0,875 % BMW Finance NV 2020/2032	EUR	13 250 000	13 250 000		101,558	13 456 435,00	0,21
1 % BNP Paribas Cardif SA (MTN) 2017/2024	EUR	500 000			99,371	496 852,50	0,01
1,375 % BNP Paribas SA (MTN) 2019/2029	EUR	28 000 000			104,434	29 241 520,00	0,46
1 % BNP Paribas SA (MTN) 2020/2028 *	EUR	800 000	800 000		97,418	779 344,00	0,01
1 % BNP Paribas SA (MTN) 2020/2029 *	EUR	500 000	500 000		101,227	506 135,00	0,01
0,5 % BNZ International Funding Ltd/London (MTN) 2017/2023	EUR	560 000			100,742	564 155,20	0,01
1,104 % BP Capital Markets PLC 2019/2034	EUR	13 160 000			94,624	12 452 518,40	0,19
0,625 % BPCE SA (MTN) 2018/2023	EUR	500 000			101,608	508 040,00	0,01
0,875 % BPCE SA (MTN) 2018/2024	EUR	500 000			101,090	505 447,50	0,01
1,375 % BPCE SA (MTN) 2018/2026	EUR	400 000			103,527	414 106,00	0,01
0,5 % BPCE SA (MTN) 2019/2027	EUR	400 000			98,225	392 900,00	0,01
0,625 % BPCE SA (MTN) 2020/2030	EUR	26 700 000	26 700 000		101,567	27 118 389,00	0,42
1,5 % Brambles Finance PLC (MTN) 2017/2027	EUR	460 000			101,373	466 315,80	0,01
1,875 % Brisa Concessao Rodoviaria SA (MTN) 2015/2025	EUR	400 000			102,921	411 682,00	0,01
2 % Brisa Concessao Rodoviaria SA (MTN) 2016/2023	EUR	300 000			102,777	308 331,00	0,00
1,75 % Bristol-Myers Squibb Co 2015/2035	EUR	25 892 000			113,674	29 432 342,62	0,46
4,25 % Bundesrepublik Deutschland 2007/2039	EUR	41 910 000	5 800 000		186,318	78 085 873,80	1,22
4 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2005/2037	EUR	62 300 000	3 370 000	1 200 000	171,985	107 146 343,50	1,68
4,75 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2008/2040	EUR	47 010 000	5 760 000	1 090 000	200,762	94 377 981,15	1,48
3,25 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2010/2042	EUR	42 820 000	3 920 000		175,916	75 327 017,10	1,18
2,5 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2012/2044	EUR	65 350 000	2 750 000	9 480 000	163,159	106 624 406,50	1,67
2,5 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2014/2046	EUR	69 100 000	2 130 000	5 750 000	167,256	115 573 896,00	1,81
1,25 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2017/2048	EUR	50 980 000	6 000 000	1 240 000	135,809	69 235 428,20	1,08
0,01 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2019/2050 **	EUR	18 120 000	5 050 000		99,918	18 105 141,60	0,28
0,625 % Cadent Finance PLC (MTN) 2016/2024	EUR	230 000			101,146	232 634,65	0,00
0,75 % Cadent Finance PLC (MTN) 2020/2032	EUR	8 520 000	320 000		97,964	8 346 490,20	0,13
1,125 % CaixaBank SA (MTN) 2017/2024	EUR	500 000			101,670	508 350,00	0,01
0,625 % CaixaBank SA (MTN) 2019/2024	EUR	600 000			97,360	584 157,00	0,01
1,625 % Caggemini SE (MTN) 2020/2026	EUR	300 000	300 000		104,991	314 971,50	0,00
2,375 % Caggemini SE 2020/2032	EUR	600 000	600 000		110,049	660 294,00	0,01
2,5 % Carlsberg Breweries A/S (MTN) 2014/2024	EUR	340 000			107,958	367 055,50	0,01
0,625 % Carlsberg Breweries A/S (MTN) 2020/2030	EUR	200 000	200 000		98,763	197 525,00	0,00
0,875 % Chorus Ltd (MTN) 2019/2026	EUR	453 000			100,679	456 075,87	0,01

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
2,5 % Chubb INA Holdings Inc 2018/2038	EUR	16 084 000			%	115,403	18 561 338,10	0,29
1,4 % Chubb INA Holdings Inc 2019/2031	EUR	17 729 000			%	103,584	18 364 318,72	0,29
0,875 % Cie de Saint-Gobain (MTN) 2018/2023	EUR	300 000			%	101,773	305 319,00	0,00
2,375 % Citigroup Inc (MTN) 2014/2024	EUR	485 000			%	107,541	521 573,85	0,01
1,25 % Citigroup Inc (MTN) 2019/2029	EUR	15 065 000			%	104,109	15 684 020,85	0,25
0,75 % Citigroup, Inc. (MTN) 2016/2023	EUR	420 000			%	101,373	425 766,60	0,01
1 % Citigroup, Inc. (MTN) 2020/2026 *	EUR	450 000	450 000		%	102,322	460 449,00	0,01
1 % CNP Assurances 2011/2041 *	EUR	300 000			%	106,969	320 907,00	0,01
1,625 % Coca-Cola Co/The 2015/2035 **	EUR	30 926 000			%	110,107	34 051 690,82	0,53
1,1 % Coca-Cola Co/The 2016/2036	EUR	22 218 000			%	103,142	22 915 978,47	0,36
1,25 % Coca-Cola Co/The 2019/2031	EUR	11 138 000			%	106,743	11 888 979,65	0,19
0,75 % Coca-Cola European Partners PLC (MTN) 2016/2022	EUR	952 000			%	100,928	960 834,56	0,01
1,75 % Coca-Cola European Partners PLC (MTN) 2020/2026	EUR	150 000	150 000		%	106,254	159 380,25	0,00
2,125 % Coentreprise de Transport d'Electricite SA 2017/2032	EUR	23 700 000			%	112,932	26 764 884,00	0,42
1,375 % Colgate-Palmolive Co 2019/2034	EUR	44 908 000			%	112,718	50 619 174,90	0,79
0,875 % Colgate-Palmolive Co 2019/2039	EUR	26 160 000			%	102,265	26 752 393,20	0,42
1,25 % Comcast Corp 2020/2040	EUR	22 550 000	29 550 000	7 000 000	%	96,855	21 840 802,50	0,34
0,5 % Commerzbank AG (MTN) 2018/2023	EUR	780 000			%	100,175	781 361,10	0,01
0,5 % Commerzbank AG (MTN) 2019/2026	EUR	165 000		385 000	%	98,627	162 733,73	0,00
0,75 % Cooperatieve Rabobank UA (MTN) 2018/2023	EUR	300 000			%	101,384	304 150,50	0,00
1 % Cooperatieve Rabobank UA 2014/2026 *	EUR	490 000			%	101,146	495 615,40	0,01
1,125 % Cooperatieve Rabobank UA 2019/2031 **	EUR	13 500 000		10 000 000	%	104,583	14 118 705,00	0,22
0,875 % Covestro AG (MTN) 2020/2026	EUR	180 000	180 000		%	99,789	179 619,30	0,00
1,375 % Covestro AG (MTN) 2020/2030	EUR	190 000	190 000		%	99,611	189 260,90	0,00
1 % Credit Agricole Assurances SA 2015/2049 *	EUR	200 000	200 000		%	107,838	215 675,00	0,00
1 % Credit Agricole SA (MTN) 2020/2026 *	EUR	600 000	600 000		%	101,006	606 036,00	0,01
1 % Credit Agricole SA (MTN) 2020/2030 *	EUR	300 000	300 000		%	100,590	301 770,00	0,00
0,875 % Credit Agricole SA 2020/2032	EUR	17 800 000	17 800 000		%	98,703	17 569 045,00	0,28
1,75 % Credit Agricole SA/London (MTN) 2019/2029 **	EUR	8 600 000			%	107,717	9 263 619,00	0,15
1 % Credit Mutuel Arkea SA (MTN) 2020/2029 *	EUR	300 000	300 000		%	100,031	300 093,00	0,00
0,65 % Credit Suisse Group AG (MTN) 2019/2029	EUR	360 000			%	97,330	350 388,00	0,01
1 % Credit Suisse Group AG (MTN) 2020/2026 *	EUR	170 000	170 000		%	110,893	188 518,10	0,00
2,75 % CRH Finland Services Oyj (MTN) 2013/2020	EUR	300 000			%	100,147	300 441,00	0,00
0,875 % CRH Finland Services Oyj (MTN) 2020/2023	EUR	190 000	380 000	190 000	%	101,552	192 947,85	0,00
1,25 % CRH SMW Finance DAC (MTN) 2020/2026	EUR	250 000	250 000		%	103,481	258 701,25	0,00
2,125 % Daimler AG 2017/2037 **	EUR	28 331 000			%	104,438	29 588 188,13	0,46
2 % Daimler AG 2019/2031	EUR	13 772 000			%	104,652	14 412 604,58	0,23
1,125 % Daimler AG 2019/2034 **	EUR	9 260 000		15 540 000	%	92,614	8 576 056,40	0,13
0,875 % Daimler International Finance BV (MTN) 2018/2024	EUR	390 000			%	99,718	388 898,25	0,01
1 % Daimler International Finance BV (MTN) 2018/2025	EUR	800 000			%	99,217	793 732,00	0,01
0,25 % Daimler International Finance BV (MTN) 2019/2023	EUR	720 000			%	97,605	702 756,00	0,01
2,1 % Danaher Corp (MTN) 2020/2026	EUR	400 000	400 000		%	108,396	433 584,00	0,01
0,125 % Dassault Systemes (MTN) 2019/2026	EUR	600 000			%	99,131	594 786,00	0,01
0,375 % Deutsche Bahn Finance GMBH (MTN) 2020/2029	EUR	350 000	350 000		%	99,971	349 898,50	0,01
1,375 % Deutsche Bahn Finance GmbH (MTN) 2020/2040	EUR	15 710 000	15 710 000		%	106,157	16 677 186,15	0,26
0,875 % Deutsche Bahn Finance GmbH 2020/2039	EUR	28 020 000	380 000		%	97,300	27 263 319,90	0,43
1 % Deutsche Boerse AG 2020/2047 *	EUR	200 000	200 000		%	99,957	199 914,00	0,00
0,75 % Deutsche Post AG (MTN) 2020/2029	EUR	820 000	820 000		%	102,572	841 090,40	0,01
1 % Deutsche Post AG 2020/2032	EUR	25 680 000	25 680 000		%	103,276	26 521 148,40	0,42
7,5 % Deutsche Telekom International Finance BV 2003/2033	EUR	14 877 000			%	173,237	25 772 394,11	0,40
0,45 % DH Europe Finance II Sarl (MTN) 2019/2028	EUR	460 000			%	97,800	449 880,00	0,01
0,75 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2031	EUR	500 000			%	96,461	482 305,00	0,01
1,35 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2039 **	EUR	35 530 000			%	95,469	33 920 135,70	0,53
1,8 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2049	EUR	45 209 000			%	96,040	43 418 723,60	0,68
0,5 % Diageo Finance PLC (MTN) 2017/2024	EUR	470 000			%	101,324	476 220,45	0,01
1 % Diageo Finance PLC (MTN) 2018/2025	EUR	570 000			%	103,740	591 318,00	0,01
0,625 % Digital Dutch Finco BV (MTN) 2020/2025	EUR	320 000	320 000		%	98,880	316 416,00	0,00
1,5 % Digital Dutch Finco BV (MTN) 2020/2030	EUR	240 000	240 000		%	102,367	245 680,80	0,00
0,125 % Digital Dutch Finco BV 2020/2022	EUR	130 000	130 000		%	98,870	128 530,35	0,00
1 % DNB Bank ASA (MTN) 2017/2027 *	EUR	230 000			%	100,007	230 016,10	0,00
0,5 % Dow Chemical Co./The (MTN) 2020/2027	EUR	200 000	500 000	300 000	%	94,780	189 559,00	0,00
2,25 % DS Smith PLC (MTN) 2015/2022	EUR	290 000			%	102,607	297 558,85	0,00
1,75 % DXC Technology Co. (MTN) 2018/2026	EUR	530 000			%	98,627	522 720,45	0,01
1,625 % E.ON SE (MTN) 2017/2029	EUR	18 000 000		14 250 000	%	108,413	19 514 250,00	0,31
0,35 % E.ON SE (MTN) 2019/2030 **	EUR	9 430 000			%	96,928	9 140 263,25	0,14
0,625 % E.ON SE (MTN) 2019/2031	EUR	11 260 000			%	98,184	11 055 518,40	0,17
0,875 % E.ON SE (MTN) 2020/2031	EUR	15 510 000	15 510 000		%	100,934	15 654 863,40	0,24
1,625 % EDP - Energias de Portugal SA (MTN) 2020/2027	EUR	300 000	300 000		%	106,151	318 451,50	0,00
1,125 % EDP Finance BV (MTN) 2016/2024	EUR	423 000			%	102,887	435 212,01	0,01
1,875 % EDP Finance BV (MTN) 2018/2025	EUR	490 000			%	107,439	526 451,10	0,01
2 % Electricite de France SA (MTN) 2018/2030	EUR	18 200 000			%	110,649	20 138 118,00	0,32
4,625 % Electricite de France SA 2009/2024	EUR	1 100 000			%	118,327	1 301 591,50	0,02
0,375 % Elenia Finance Oyj (MTN) 2020/2027	EUR	730 000	730 000		%	99,628	727 284,40	0,01
1,7 % Eli Lilly & Co. 2019/2049 **	EUR	59 200 000			%	104,164	61 665 088,00	0,97
2,125 % Eli Lilly and Co 2015/2030	EUR	20 858 000			%	116,909	24 384 879,22	0,38
6,125 % EnBW International Finance BV (MTN) 2009/2039	EUR	37 461 000			%	180,211	67 508 655,41	1,06
1,875 % EnBW International Finance BV (MTN) 2018/2033	EUR	17 798 000			%	116,856	20 797 941,89	0,33
5 % Enel Finance International NV 2009/2022	EUR	1 100 000			%	111,031	1 221 341,00	0,02
5,6 % Enel Finance International NV 2011/2031	EUR	18 500 000			%	144,617	26 754 145,00	0,42

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1,125 % Enel Finance International NV 2019/2034	EUR	23 350 000			%	103,580	24 185 930,00	0,38
0,75 % Enexis Holding NV (MTN) 2019/2031 **	EUR	24 840 000			%	102,538	25 470 315,00	0,40
0,625 % Enexis Holding NV (MTN) 2020/2032	EUR	13 870 000	360 000		%	101,475	14 074 582,50	0,22
1,375 % Engie SA (MTN) 2020/2025	EUR	600 000	600 000		%	105,262	631 572,00	0,01
1,75 % Engie SA (MTN) 2020/2028	EUR	500 000	500 000		%	108,275	541 372,50	0,01
5,95 % Engie SA 2011/2111	EUR	18 089 000			%	207,975	37 620 507,31	0,59
1,5 % Engie SA 2015/2035	EUR	5 000 000		5 000 000	%	105,644	5 282 200,00	0,08
1,375 % Engie SA 2019/2039 **	EUR	20 400 000			%	101,642	20 734 866,00	0,32
1,25 % Engie SA 2019/2041	EUR	24 200 000			%	98,560	23 851 520,00	0,37
0,625 % Eni SpA (MTN) 2020/2030 **	EUR	19 760 000	19 760 000		%	97,736	19 312 534,80	0,30
1 % Eni SpA 2019/2034 **	EUR	38 200 000			%	99,285	37 926 870,00	0,59
2 % Eni SpA 2020/2031 **	EUR	13 040 000	13 040 000		%	110,375	14 392 834,80	0,22
1,375 % Equinor ASA (MTN) 2020/2032	EUR	8 060 000	8 060 000		%	106,408	8 576 444,50	0,13
5,625 % Equinor ASA 2009/2021	EUR	1 000 000			%	104,128	1 041 280,00	0,02
1,625 % Equinor ASA 2015/2035 **	EUR	10 839 000		10 000 000	%	110,392	11 965 388,88	0,19
1,625 % Equinor ASA 2016/2036	EUR	19 803 000			%	110,516	21 885 384,47	0,34
0,375 % Erste Group Bank AG (MTN) 2019/2024	EUR	300 000			%	100,566	301 698,00	0,00
0,875 % Erste Group Bank AG (MTN) 2019/2026	EUR	500 000			%	101,254	506 270,00	0,01
0,875 % Erste Group Bank AG (MTN) 2020/2027	EUR	500 000	500 000		%	102,919	514 592,50	0,01
1,875 % ESB Finance DAC (MTN) 2016/2031	EUR	15 076 000			%	113,263	17 075 529,88	0,27
2,125 % ESB Finance DAC 2018/2033	EUR	14 721 000			%	116,471	17 145 695,91	0,27
0,75 % EssilorLuxottica SA 2019/2031	EUR	23 200 000			%	101,080	23 450 560,00	0,37
0,625 % Essity AB (MTN) 2017/2022	EUR	540 000			%	100,759	544 095,90	0,01
1,113 % Eurogrid GmbH (MTN) 2020/2032	EUR	400 000	400 000		%	105,359	421 436,00	0,01
1,125 % Eutelsat SA (MTN) 2016/2021	EUR	200 000			%	100,180	200 359,00	0,00
1,75 % Exor NV 2019/2034 **	EUR	23 450 000			%	92,168	21 613 396,00	0,34
1,375 % Experian Finance PLC (MTN) 2017/2026	EUR	630 000			%	102,655	646 723,35	0,01
1,408 % Exxon Mobil Corp 2020/2039	EUR	65 210 000	65 210 000		%	98,893	64 487 799,25	1,01
1,125 % Fastighets AB Balder (MTN) 2017/2022	EUR	625 000			%	99,905	624 406,25	0,01
1,875 % Fastighets AB Balder (MTN) 2017/2025	EUR	600 000			%	100,902	605 412,00	0,01
1,125 % Fastighets AB Balder (MTN) 2019/2027	EUR	750 000			%	94,121	705 907,50	0,01
2,625 % Finland Government Bond 2012/2042	EUR	3 930 000	1 540 000	480 000	%	154,585	6 075 170,85	0,09
1,375 % Finland Government Bond 2017/2047	EUR	3 220 000	1 740 000	550 000	%	130,845	4 213 209,00	0,07
0,125 % Finland Government Bond 2020/2036	EUR	2 590 000	2 590 000		%	101,100	2 618 477,05	0,04
2,95 % Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC (MTN) 2020/2025	EUR	2 360 000	2 360 000		%	104,399	2 463 816,40	0,04
6,025 % GE Capital European Funding Unlimited Co 2008/2038	EUR	10 487 000			%	130,172	13 651 085,21	0,21
1,375 % Gecina SA 2017/2028	EUR	600 000			%	104,445	626 667,00	0,01
1,625 % Gecina SA 2019/2034	EUR	22 600 000			%	103,435	23 376 310,00	0,37
1 % General Motors Financial Co., Inc. (MTN) 2017/2021 *	EUR	520 000			%	98,342	511 378,40	0,01
1,75 % GlaxoSmithKline Capital PLC 2018/2030	EUR	16 590 000			%	112,264	18 624 514,65	0,29
4,75 % Goldman Sachs Group Inc/The 2006/2021	EUR	305 000			%	105,299	321 161,95	0,01
3 % Goldman Sachs Group Inc/The 2016/2031	EUR	15 260 000			%	118,415	18 070 129,00	0,28
3,375 % Goldman Sachs Group, Inc./The (MTN) 2020/2025	EUR	320 000	320 000		%	111,663	357 321,60	0,01
0,875 % Goldman Sachs Group, Inc./The (MTN) 2020/2030	EUR	640 000	640 000		%	98,129	628 022,40	0,01
1,375 % Goodman Australia Finance Pty Ltd -Reg- (MTN) 2017/2025	EUR	358 000			%	100,033	358 116,35	0,01
1 % Groupama SA 2014/2049 *	EUR	600 000	300 000		%	110,597	663 582,00	0,01
1,875 % Heathrow Funding Ltd (MTN) 2019/2034	EUR	26 103 000			%	101,401	26 468 572,52	0,41
1,125 % HeidelbergCement Finance Luxembourg SA (MTN) 2019/2027	EUR	300 000			%	98,831	296 491,50	0,00
2,25 % Heineken NV (MTN) 2020/2030	EUR	4 560 000	150 000		%	113,244	5 163 926,40	0,08
1,75 % Heineken NV (MTN) 2020/2040	EUR	20 580 000	1 560 000	780 000	%	100,440	20 670 552,00	0,32
2,02 % Heineken NV 2017/2032 **	EUR	19 361 000			%	110,853	21 462 152,53	0,34
1,75 % Heineken NV 2018/2031	EUR	10 174 000			%	109,343	11 124 556,82	0,17
0,6 % HSBC France SA (MTN) 2018/2023	EUR	700 000			%	101,481	710 363,50	0,01
1,5 % HSBC Holdings PLC (MTN) 2016/2022	EUR	500 000			%	102,306	511 527,50	0,01
1 % Iberdrola Finanzas SA (MTN) 2017/2025	EUR	600 000			%	103,655	621 927,00	0,01
1,621 % Iberdrola Finanzas SA 2017/2029	EUR	10 000 000		8 600 000	%	111,324	11 132 350,00	0,17
2,125 % Illinois Tool Works Inc 2015/2030 **	EUR	17 904 000			%	113,401	20 303 225,52	0,32
1 % Illinois Tool Works Inc 2019/2031	EUR	27 262 000			%	102,867	28 043 601,54	0,44
1 % ING Bank NV 2014/2026 *	EUR	320 000			%	101,686	325 393,60	0,01
0,75 % ING Groep NV (MTN) 2017/2022	EUR	500 000			%	100,881	504 405,00	0,01
1 % ING Groep NV (MTN) 2018/2023	EUR	300 000			%	102,199	306 595,50	0,00
2,5 % ING Groep NV (MTN) 2018/2030 **	EUR	14 700 000			%	118,520	17 422 366,50	0,27
1 % ING Groep NV (MTN) 2019/2025 *	EUR	600 000			%	97,900	587 400,00	0,01
1 % ING Groep NV (MTN) 2020/2031 *	EUR	500 000	500 000		%	102,533	512 662,50	0,01
0,875 % International Business Machines Corp (MTN) 2019/2025	EUR	450 000			%	102,547	461 461,50	0,01
1,75 % International Business Machines Corp 2019/2031	EUR	34 630 000			%	109,187	37 811 284,95	0,59
1,2 % International Business Machines Corp. 2020/2040	EUR	42 590 000	1 330 000		%	95,820	40 809 525,05	0,64
1,8 % International Flavors & Fragrances, Inc. (MTN) 2018/2026	EUR	540 000			%	100,998	545 389,20	0,01
0,5 % International Flavors & Fragrances, Inc. 2018/2021	EUR	260 000			%	99,873	259 668,50	0,00
1,375 % Intesa Sanpaolo SpA (MTN) 2017/2024	EUR	279 000			%	100,996	281 778,84	0,00
1 % Intesa Sanpaolo SpA (MTN) 2019/2026	EUR	600 000		450 000	%	97,996	587 973,00	0,01
1,5 % Investor AB (MTN) 2019/2039	EUR	15 658 000			%	106,025	16 601 316,21	0,26
1,5 % Investor AB 2018/2030	EUR	11 333 000			%	107,816	12 218 730,62	0,19
1 % Iren SpA (MTN) 2020/2030	EUR	1 300 000	1 300 000		%	98,359	1 278 667,00	0,02
1,125 % ISS Global A/S (MTN) 2015/2021	EUR	177 000			%	100,221	177 390,29	0,00
0,875 % Italgas SpA (MTN) 2019/2030	EUR	9 490 000			%	101,290	9 612 421,00	0,15

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1 % Italgas SpA 2019/2031	EUR	27 290 000			%	101,906	27 810 147,40	0,44
2,2 % John Deere Cash Management SA (MTN) 2020/2032	EUR	7 320 000	14 640 000	7 320 000	%	113,341	8 296 561,20	0,13
1,65 % John Deere Cash Management SA 2019/2039	EUR	29 172 000			%	107,129	31 251 526,02	0,49
1,65 % Johnson & Johnson 2016/2035	EUR	47 837 000			%	117,650	56 279 991,32	0,88
1 % Johnson Controls International plc (MTN) 2017/2023	EUR	428 000			%	101,157	432 949,82	0,01
0,625 % JPMorgan Chase & Co (MTN) 2016/2024	EUR	455 000			%	101,003	459 561,38	0,01
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2031 *	EUR	8 940 000		10 000 000	%	100,214	8 959 131,60	0,14
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2032 * **	EUR	56 990 000			%	100,337	57 182 056,30	0,89
1 % KBC Group NV 2017/2029 *	EUR	400 000			%	102,072	408 288,00	0,01
0,8 % Kellogg Co (MTN) 2017/2022	EUR	690 000			%	100,964	696 648,15	0,01
0,75 % Kering SA (MTN) 2020/2028	EUR	200 000	200 000		%	101,957	203 914,00	0,00
3,75 % Kingdom of Belgium Government Bond 2013/2045	EUR	5 110 000	2 250 000	2 160 000	%	175,695	8 977 988,95	0,14
1,9 % Kingdom of Belgium Government Bond 2015/2038	EUR	4 460 000	1 640 000	1 000 000	%	127,798	5 699 790,80	0,09
1,6 % Kingdom of Belgium Government Bond 2016/2047	EUR	5 530 000	750 000	1 650 000	%	125,615	6 946 481,85	0,11
2,15 % Kingdom of Belgium Government Bond 2016/2066	EUR	3 490 000	1 550 000	810 000	%	156,652	5 467 154,80	0,09
1,45 % Kingdom of Belgium Government Bond 2017/2037	EUR	3 150 000		100 000	%	119,558	3 766 077,00	0,06
2,25 % Kingdom of Belgium Government Bond 2017/2057	EUR	2 760 000	900 000	650 000	%	151,939	4 193 516,40	0,07
1,7 % Kingdom of Belgium Government Bond 2019/2050	EUR	4 100 000	1 580 000		%	129,763	5 320 283,00	0,08
0,4 % Kingdom of Belgium Government Bond 2020/2040	EUR	3 320 000	3 320 000		%	99,879	3 315 966,20	0,05
1,625 % KKR Group Finance Co., V LLC -Reg- (MTN) 2019/2029	EUR	9 599 000		5 000 000	%	101,569	9 749 560,32	0,15
1,625 % Klepierre SA 2017/2032 **	EUR	17 100 000			%	99,802	17 066 056,50	0,27
0,75 % Koninklijke DSM NV (MTN) 2016/2026	EUR	600 000			%	103,986	623 913,00	0,01
1 % La Banque Postale SA (MTN) 2020/2026 *	EUR	400 000	400 000		%	98,999	395 994,00	0,01
2,125 % La Mondiale SAM 2020/2031	EUR	200 000	200 000		%	98,895	197 790,00	0,00
0,625 % La Poste SA (MTN) 2020/2026	EUR	400 000	400 000		%	101,842	407 368,00	0,01
1,375 % La Poste SA (MTN) 2020/2032	EUR	15 500 000	400 000		%	105,506	16 353 430,00	0,26
1 % La Poste SA 2019/2034 **	EUR	26 500 000			%	100,353	26 593 412,50	0,42
1 % Lehman Brothers Holdings Inc 2007/2019 *	EUR	5 500 000			%	0,000	5,50	0,00
1 % Lehman Brothers Holdings, Inc. (MTN) 2046/2016 *	EUR	7 800 000			%	0,000	7,80	0,00
0,5 % LG Chem Ltd -Reg- 2019/2023	EUR	410 000			%	98,708	404 700,75	0,01
0,55 % Linde Finance BV 2020/2032 **	EUR	33 300 000	33 300 000		%	100,504	33 467 665,50	0,52
0,375 % Lloyds Bank Corp.orate Markets PLC (MTN) 2020/2025	EUR	630 000	630 000		%	98,677	621 661,95	0,01
0,25 % Lloyds Bank PLC 2019/2022	EUR	470 000			%	99,370	467 036,65	0,01
1 % Lloyds Banking Group PLC (MTN) 2019/2025 *	EUR	450 000			%	97,945	440 752,50	0,01
1 % Lloyds Banking Group PLC (MTN) 2020/2026 *	EUR	230 000	230 000		%	111,034	255 378,20	0,00
0,125 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE (MTN) 2020/2028	EUR	1 100 000	1 100 000		%	98,238	1 080 612,50	0,02
0,375 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 2020/2031	EUR	46 400 000	46 400 000		%	98,096	45 516 312,00	0,71
1,375 % Madriena Red de Gas Finance BV (MTN) 2017/2025	EUR	300 000			%	103,306	309 918,00	0,00
1 % Mapfre SA 2018/2048 *	EUR	600 000			%	107,713	646 275,00	0,01
1,125 % Medtronic Global Holdings SCA (MTN) 2019/2027	EUR	320 000			%	104,494	334 380,80	0,01
2,25 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2039	EUR	20 543 000		7 000 000	%	112,507	23 112 313,01	0,36
1,5 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2039	EUR	17 030 000			%	99,983	17 027 104,90	0,27
1,75 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2049	EUR	32 980 000			%	97,658	32 207 608,40	0,50
2,5 % Merck & Co Inc 2014/2034	EUR	14 220 000			%	125,184	17 801 164,80	0,28
1,375 % Merck & Co Inc 2016/2036 **	EUR	24 075 000			%	109,158	26 279 788,50	0,41
0,875 % Merck Financial Services GmbH (MTN) 2019/2031	EUR	45 600 000			%	102,595	46 783 092,00	0,73
1 % Merck KGaA 2014/2074 *	EUR	600 000			%	100,602	603 609,00	0,01
1 % Merck KGaA 2019/2079 *	EUR	300 000			%	104,581	313 743,00	0,00
2,625 % Microsoft Corp 2013/2033 **	EUR	19 077 000			%	128,304	24 476 458,70	0,38
1 % Morgan Stanley (MTN) 2016/2022	EUR	700 000			%	101,231	708 617,00	0,01
1,375 % Morgan Stanley (MTN) 2016/2026	EUR	370 000			%	104,697	387 378,90	0,01
1 % Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 2018/2049 *	EUR	500 000			%	114,343	571 715,00	0,01
0,75 % National Grid North America Inc (MTN) 2015/2022	EUR	300 000			%	100,741	302 221,50	0,00
1 % National Grid North America, Inc. (MTN) 2017/2024	EUR	300 000			%	102,905	308 715,00	0,00
1 % Nationwide Building Society (MTN) 2017/2029 *	EUR	360 000			%	100,181	360 649,80	0,01
0,75 % Naturgy Finance BV (MTN) 2019/2029	EUR	700 000			%	100,224	701 568,00	0,01
1,25 % Naturgy Finance BV (MTN) 2020/2026	EUR	600 000	600 000		%	104,071	624 426,00	0,01
1,125 % Nestle Finance International Ltd (MTN) 2020/2026	EUR	180 000	180 000		%	105,738	190 328,40	0,00
1,5 % Nestle Finance International Ltd (MTN) 2020/2030	EUR	5 400 000	5 400 000		%	110,520	5 968 053,00	0,09
1,25 % Nestle Finance International Ltd 2017/2029 **	EUR	8 008 000		8 000 000	%	110,083	8 815 406,60	0,14
1,75 % Nestle Finance International Ltd 2017/2037	EUR	20 158 000			%	119,147	24 017 652,26	0,38
4 % Netherlands Government Bond 2005/2037	EUR	12 360 000		2 600 000	%	168,866	20 871 775,80	0,33
3,75 % Netherlands Government Bond 2010/2042	EUR	12 630 000	370 000	3 020 000	%	182,061	22 994 241,15	0,36
2,75 % Netherlands Government Bond 2014/2047	EUR	13 010 000		1 430 000	%	172,446	22 435 159,55	0,35
0,5 % Netherlands Government Bond 2019/2040	EUR	5 790 000	1 300 000	1 210 000	%	110,544	6 400 497,60	0,10
1 % Nordea Bank Abp (MTN) 2016/2023	EUR	400 000			%	102,842	411 368,00	0,01
1,125 % Norsk Hydro ASA (MTN) 2019/2025	EUR	390 000			%	96,595	376 720,50	0,01
2 % Norsk Hydro ASA (MTN) 2019/2029	EUR	400 000			%	91,214	364 856,00	0,01
1,375 % Novartis Finance SA 2018/2030	EUR	17 272 000			%	110,307	19 052 225,04	0,30
1,7 % Novartis Finance SA 2018/2038	EUR	28 912 000	8 530 000		%	117,302	33 914 209,68	0,53
2,375 % OMV AG (MTN) 2020/2032	EUR	24 800 000	24 800 000		%	114,791	28 468 044,00	0,45
1 % OMV AG 2019/2034 **	EUR	26 760 000			%	97,983	26 220 117,00	0,41
1 % Optus Finance Pty Ltd (MTN) 2019/2029	EUR	14 831 000			%	101,490	15 051 907,75	0,24
1,375 % Orange SA (MTN) 2018/2028	EUR	600 000			%	106,504	639 024,00	0,01

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
0,5 % Orange SA (MTN) 2019/2032	EUR	15 000 000			%	95,860	14 379 000,00	0,23
1,375 % Orange SA (MTN) 2019/2049 **	EUR	32 700 000			%	95,984	31 386 768,00	0,49
1 % Orange SA (MTN) 2019/perpetual *	EUR	300 000			%	101,535	304 605,00	0,00
1,625 % Orange SA (MTN) 2020/2032	EUR	7 000 000	7 000 000		%	108,578	7 600 460,00	0,12
1,875 % Orange SA 2018/2030	EUR	24 100 000			%	112,176	27 034 416,00	0,42
1,5 % Orsted A/S 2017/2029	EUR	800 000			%	109,857	878 852,00	0,01
1,125 % PepsiCo Inc 2019/2031 **	EUR	17 981 000			%	105,906	19 042 867,96	0,30
0,875 % PepsiCo Inc 2019/2039 **	EUR	24 490 000			%	98,583	24 142 976,70	0,38
0,25 % PepsiCo, Inc. 2020/2024	EUR	370 000	370 000		%	100,672	372 486,40	0,01
0,5 % Pernod Ricard SA (MTN) 2019/2027	EUR	300 000			%	99,886	299 658,00	0,00
0,875 % Pernod Ricard SA 2019/2031 **	EUR	14 700 000			%	99,117	14 570 125,50	0,23
3,125 % Petroleos Mexicanos -Reg- (MTN) 2013/2020	EUR	1 500 000	1 500 000		%	99,253	1 488 795,00	0,02
1 % Postnl NV (MTN) 2017/2024	EUR	300 000			%	100,679	302 037,00	0,00
1,875 % Procter & Gamble Co/The 2018/2038	EUR	30 576 000			%	120,573	36 866 247,60	0,58
1,5 % Prologis Euro Finance LLC 2019/2049 **	EUR	23 310 000		10 000 000	%	95,711	22 310 117,55	0,35
1 % Prologis Euro Finance LLC 2020/2035	EUR	24 080 000	24 080 000		%	97,077	23 376 141,60	0,37
1,625 % Prologis International Funding II SA (MTN) 2020/2032	EUR	3 885 000	3 885 000		%	104,548	4 061 689,80	0,06
2,375 % Prologis International Funding II SA 2018/2030	EUR	280 000			%	113,467	317 706,20	0,00
0,375 % Raiffeisen Bank International AG (MTN) 2019/2026	EUR	600 000			%	99,359	596 154,00	0,01
1 % Raiffeisen Bank International AG 2020/2032 *	EUR	300 000	300 000		%	101,449	304 347,00	0,00
0,625 % RCI Banque SA (MTN) 2016/2021	EUR	500 000			%	98,387	491 935,00	0,01
0,75 % RCI Banque SA (MTN) 2017/2022	EUR	630 000			%	98,473	620 376,75	0,01
0,75 % RCI Banque SA (MTN) 2017/2022	EUR	520 000			%	97,633	507 691,60	0,01
0,25 % RCI Banque SA (MTN) 2018/2021	EUR	500 000			%	98,570	492 847,50	0,01
0,75 % Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV (MTN) 2020/2030	EUR	490 000	490 000		%	101,748	498 562,75	0,01
0,01 % RELX Finance BV 2020/2024	EUR	450 000	450 000		%	98,731	444 287,25	0,01
0,875 % RELX Finance BV 2020/2032	EUR	100 000	200 000	100 000	%	98,433	98 432,50	0,00
0,875 % Rentokil Initial PLC (MTN) 2019/2026	EUR	650 000			%	99,529	646 935,25	0,01
2,1 % Republic of Austria Government Bond (MTN) 2017/2117	EUR	3 940 000	130 000	630 000	%	195,924	7 719 405,60	0,12
4,15 % Republic of Austria Government Bond 2007/2037	EUR	9 240 000		1 320 000	%	167,970	15 520 381,80	0,24
3,8 % Republic of Austria Government Bond 2012/2062	EUR	2 950 000		50 000	%	229,533	6 771 223,50	0,11
1,5 % Republic of Austria Government Bond 2016/2047	EUR	4 810 000		1 010 000	%	131,377	6 319 209,65	0,10
1,5 % Republic of Austria Government Bond 2016/2086 **	EUR	1 820 000	140 000	110 000	%	152,496	2 775 418,10	0,04
0,75 % Republic of Austria Government Bond 2020/2051	EUR	1 320 000	1 320 000		%	112,038	1 478 895,00	0,02
1,5 % Richemont International Holding SA 2018/2030	EUR	580 000			%	109,479	634 975,30	0,01
2 % Richemont International Holding SA 2018/2038	EUR	20 816 000			%	113,031	23 528 428,88	0,37
1,625 % Richemont International Holding SA 2020/2040	EUR	17 640 000	330 000		%	102,650	18 107 460,00	0,28
2,979 % Robert Bosch Investment Nederland BV 2013/2033	EUR	10 000 000			%	129,731	12 973 100,00	0,20
3,624 % Romanian Government International Bond -Reg- (MTN) 2020/2030	EUR	3 000 000	3 000 000		%	108,248	3 247 425,00	0,05
2 % Royal Schiphol Group NV (MTN) 2020/2029	EUR	340 000	340 000		%	110,724	376 461,60	0,01
1 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR (MTN) 2016/2026	EUR	300 000			%	104,832	314 496,00	0,00
1,125 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR (MTN) 2019/2049 **	EUR	27 100 000	17 500 000		%	99,336	26 919 920,50	0,42
2 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 2016/2036	EUR	11 700 000			%	117,963	13 801 671,00	0,22
1,875 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 2017/2037	EUR	17 600 000	5 000 000		%	116,772	20 551 872,00	0,32
2,125 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 2018/2038	EUR	6 500 000			%	121,597	7 903 772,50	0,12
2,2 % Russian Railways Via RZD Capital PLC (MTN) 2019/2027	EUR	1 700 000			%	102,394	1 740 698,00	0,03
1 % Sanofi (MTN) 2020/2025	EUR	200 000	200 000		%	104,471	208 941,00	0,00
1,375 % Sanofi 2018/2030	EUR	20 100 000			%	110,463	22 203 063,00	0,35
1,875 % Sanofi 2018/2038 **	EUR	18 600 000			%	119,029	22 139 301,00	0,35
1,25 % Sanofi 2019/2034	EUR	16 500 000			%	111,026	18 319 207,50	0,29
0,75 % Santander Consumer Bank AG (MTN) 2017/2022	EUR	400 000			%	100,223	400 892,00	0,01
0,25 % Santander Consumer Bank AG (MTN) 2019/2024	EUR	400 000			%	98,320	393 278,00	0,01
0,75 % Santander Consumer Bank AS (MTN) 2018/2023	EUR	200 000			%	100,058	200 116,00	0,00
0,875 % Santander Consumer Bank AS (MTN) 2019/2022	EUR	300 000			%	100,659	301 977,00	0,00
0,125 % Santander Consumer Bank AS (MTN) 2020/2025	EUR	900 000	900 000		%	96,153	865 377,00	0,01
1 % Santander Consumer Finance SA (MTN) 2019/2024	EUR	400 000			%	101,344	405 374,00	0,01
1,375 % SAP SE 2018/2030	EUR	22 600 000			%	109,588	24 766 888,00	0,39
1,625 % SAP SE 2018/2031	EUR	32 700 000			%	112,225	36 697 411,50	0,57
2 % Schlumberger Finance BV 2020/2032	EUR	16 870 000			%	106,956	18 043 477,20	0,28
3,125 % Serbia International Bond -Reg- (MTN) 2020/2027	EUR	3 730 000	3 730 000		%	104,817	3 909 674,10	0,06
1 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2018/2027	EUR	840 000			%	105,611	887 132,40	0,01
0,3 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2019/2024	EUR	480 000			%	101,124	485 392,80	0,01
0,5 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2019/2034	EUR	12 510 000			%	96,024	12 012 602,40	0,19
0,25 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2020/2029	EUR	700 000	700 000		%	98,747	691 225,50	0,01
1,375 % Siemens Financieringsmaatschappij NV 2018/2030	EUR	20 151 000		10 000 000	%	108,952	21 954 816,77	0,34
1,25 % Siemens Financieringsmaatschappij NV 2019/2031	EUR	640 000			%	107,292	686 668,80	0,01
1,75 % Siemens Financieringsmaatschappij NV 2019/2039	EUR	30 305 000			%	111,676	33 843 260,28	0,53
2,375 % Signify NV (MTN) 2020/2027	EUR	170 000	170 000		%	102,628	174 467,60	0,00
2 % Signify NV 2020/2024	EUR	270 000	270 000		%	101,246	273 364,20	0,00

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
1,5 % Sky Ltd (MTN) 2014/2021	EUR	280 000			101,574	284 405,80	0,00
1 % Snam SpA 2019/2034	EUR	8 470 000		9 000 000	100,880	8 544 536,00	0,13
0,5 % Société Générale SA (MTN) 2017/2023	EUR	400 000			99,373	397 492,00	0,01
1 % Societe Generale SA (MTN) 2018/2028 *	EUR	700 000			99,644	697 504,50	0,01
1,25 % Société Générale SA (MTN) 2019/2024	EUR	500 000			101,389	506 945,00	0,01
0,125 % Societe Generale SA (MTN) 2020/2026	EUR	1 200 000	1 200 000		98,875	1 186 494,00	0,02
1,25 % Societe Generale SA (MTN) 2020/2030	EUR	500 000	500 000		99,983	499 912,50	0,01
1,625 % Solvay SA (MTN) 2015/2022	EUR	200 000			102,833	205 666,00	0,00
1 % Standard Chartered PLC (MTN) 2019/2027 *	EUR	350 000			99,520	348 320,00	0,01
1 % Standard Chartered PLC (MTN) 2020/2030 *	EUR	390 000	390 000		101,627	396 345,30	0,01
2,625 % Stryker Corp 2018/2030	EUR	13 763 000			114,793	15 798 960,59	0,25
0,25 % Stryker Corp. (MTN) 2019/2024	EUR	400 000			98,969	395 876,00	0,01
0,75 % Stryker Corp. (MTN) 2019/2029	EUR	500 000			98,527	492 632,50	0,01
1 % Stryker Corp. 2019/2031	EUR	31 220 000			98,909	30 879 389,80	0,48
1 % Suez SA (MTN) 2017/2025	EUR	500 000			103,074	515 367,50	0,01
1,5 % Suez SA 2017/2029	EUR	16 900 000		10 000 000	107,824	18 222 256,00	0,29
1,625 % Suez SA 2017/2032	EUR	10 000 000			109,488	10 948 750,00	0,17
1,625 % Suez SA 2018/2030	EUR	13 400 000			109,557	14 680 571,00	0,23
1,25 % Suez SA 2020/2035 **	EUR	29 200 000	700 000		101,721	29 702 386,00	0,47
0,25 % Svenska Handelsbanken AB (MTN) 2017/2022	EUR	610 000			100,526	613 208,60	0,01
1 % Svenska Handelsbanken AB (MTN) 2018/2028 *	EUR	690 000			101,293	698 921,70	0,01
1 % Svenska Handelsbanken AB (MTN) 2020/2025	EUR	230 000	230 000		104,247	239 766,95	0,00
1 % Swiss Re Finance Luxembourg SA 2019/2050 *	EUR	500 000			105,341	526 705,00	0,01
1 % Swiss Re Finance UK PLC 2020/2052 *	EUR	100 000	100 000		104,083	104 083,00	0,00
2,25 % Takeda Pharmaceutical Co Ltd (MTN) 2018/2026	EUR	400 000			109,844	439 374,00	0,01
2 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd 2020/2040	EUR	30 000 000	1 100 000		99,513	29 047 844,70	0,45
1,125 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd -Reg- 2018/2022	EUR	560 000			101,832	570 259,20	0,01
3 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd -Reg- 2018/2030	EUR	41 785 000			117,552	49 118 894,28	0,77
1,125 % Tele2 AB (MTN) 2018/2024	EUR	520 000			103,016	535 680,60	0,01
2,125 % Tele2 AB (MTN) 2018/2028	EUR	695 000	255 000		108,900	756 851,53	0,01
1,957 % Telefonica Emisiones SA 2019/2039	EUR	15 850 000			105,235	16 679 668,25	0,26
1,75 % Telenor ASA 2019/2034	EUR	23 076 000			110,958	25 604 552,70	0,40
0,875 % Telenor ASA 2020/2035 **	EUR	27 570 000	27 570 000		98,424	27 135 358,95	0,42
3,5 % Telia Co AB 2013/2033 **	EUR	9 447 000			126,286	11 930 191,19	0,19
1,625 % Telia Co AB 2015/2035	EUR	10 057 000			102,903	10 348 904,43	0,16
2,125 % Telia Co AB 2019/2034	EUR	9 482 000			109,438	10 376 863,75	0,16
1,375 % Telstra Corp., Ltd (MTN) 2019/2029	EUR	17 414 000			107,247	18 675 905,51	0,29
1,5 % TenneT Holding BV (MTN) 2019/2039 **	EUR	29 741 000		240 000	108,473	32 260 806,23	0,51
1,875 % TenneT Holding BV 2016/2036 **	EUR	16 863 000			115,314	19 445 399,82	0,30
1,375 % TenneT Holding BV 2017/2029	EUR	694 000			108,743	754 672,95	0,01
2 % TenneT Holding BV 2018/2034	EUR	10 574 000		8 000 000	117,231	12 395 953,07	0,19
0,875 % TenneT Holding BV 2019/2030	EUR	500 000			104,519	522 592,50	0,01
1 % Terna Rete Elettrica Nazionale SpA (MTN) 2016/2028	EUR	410 000			103,417	424 009,70	0,01
0,125 % Terna Rete Elettrica Nazionale SpA (MTN) 2019/2025	EUR	510 000			99,050	505 155,00	0,01
2,875 % Thermo Fisher Scientific Inc 2017/2037	EUR	10 310 000			121,578	12 534 691,80	0,20
1,5 % Thermo Fisher Scientific Inc 2019/2039	EUR	29 440 000			98,295	28 937 900,80	0,45
0,125 % Thermo Fisher Scientific, Inc. (MTN) 2019/2025	EUR	270 000			98,669	266 406,30	0,00
1,875 % Thermo Fisher Scientific, Inc. 2019/2049	EUR	34 430 000	15 600 000		95,756	32 968 618,65	0,52
0,696 % Total Capital International SA (MTN) 2019/2028	EUR	900 000			101,604	914 431,50	0,01
1,994 % Total Capital International SA (MTN) 2020/2032 **	EUR	13 500 000	200 000		112,854	15 235 222,50	0,24
1,535 % Total Capital International SA 2019/2039	EUR	43 400 000			105,203	45 658 102,00	0,71
1,618 % Total Capital International SA 2020/2040	EUR	20 000 000	20 000 000		104,263	20 852 500,00	0,33
5,125 % Total Capital SA 2009/2024	EUR	1 100 000			118,504	1 303 538,50	0,02
1 % Total SA (MTN) 2019/perpetual *	EUR	750 000			98,969	742 263,75	0,01
1 % TOTAL SA 2015/perpetual *	EUR	450 000			102,417	460 874,25	0,01
0,25 % Toyota Motor Credit Corp (MTN) 2020/2026	EUR	590 000	590 000		98,434	580 760,60	0,01
3 % Transurban Finance Co., Pty Ltd (MTN) 2020/2030	EUR	320 000	320 000		110,137	352 438,40	0,01
0,25 % UBS AG/London 2018/2022	EUR	500 000			100,351	501 755,00	0,01
1 % Unibail-Rodamco SE 2018/perpetual *	EUR	100 000		100 000	87,690	87 690,00	0,00
1 % Unibail-Rodamco SE 2018/perpetual *	EUR	200 000		100 000	88,755	177 509,00	0,00
2 % Unibail-Rodamco-Westfield SE 2017/2037 **	EUR	13 947 000			96,890	13 513 248,30	0,21
2,25 % Unibail-Rodamco-Westfield SE 2018/2038	EUR	14 200 000			100,182	14 225 844,00	0,22
1,75 % Unibail-Rodamco-Westfield SE 2019/2049	EUR	25 700 000			86,216	22 157 383,50	0,35
1,125 % Unilever NV (MTN) 2018/2027	EUR	720 000			107,299	772 549,20	0,01
1,625 % Unilever NV (MTN) 2018/2033	EUR	12 577 000			114,983	14 461 349,03	0,23
1,75 % Unilever NV (MTN) 2020/2030	EUR	210 000	210 000		113,572	238 501,20	0,00
1,5 % Unilever PLC 2019/2039	EUR	43 234 000	360 000		113,352	49 006 387,51	0,77
6,25 % Vattenfall AB 2009/2021	EUR	800 000			104,380	835 036,00	0,01
1,25 % Veolia Environnement SA (MTN) 2020/2028	EUR	300 000	300 000		105,185	315 553,50	0,00
1,94 % Veolia Environnement SA 2018/2030	EUR	600 000			111,493	668 958,00	0,01
0,8 % Veolia Environnement SA 2020/2032 **	EUR	17 400 000	17 400 000		100,050	17 408 613,00	0,27
2,625 % Verizon Communications Inc 2014/2031	EUR	23 424 000			117,493	27 521 560,32	0,43
1,5 % Verizon Communications Inc 2019/2039 **	EUR	29 960 000		1 040 000	97,764	29 289 944,60	0,46
1,85 % Verizon Communications Inc 2020/2040	EUR	23 510 000	720 000		102,372	24 067 539,65	0,38
0,875 % Verizon Communications, Inc. (MTN) 2019/2027	EUR	1 010 000			101,380	1 023 938,00	0,02
2,875 % Verizon Communications, Inc. 2017/2038	EUR	25 560 000			120,540	30 810 024,00	0,48
1,125 % Vicinity Centres Trust (MTN) 2019/2029	EUR	700 000			92,898	650 282,50	0,01
1,125 % Vodafone Group PLC (MTN) 2017/2025	EUR	480 000			103,614	497 344,80	0,01
2,5 % Vodafone Group PLC (MTN) 2019/2039	EUR	19 932 000	300 000		110,559	22 036 619,88	0,35
2,75 % Vonovia Finance BV 2018/2038 **	EUR	9 400 000			115,858	10 890 605,00	0,17
1,125 % Vonovia Finance BV 2019/2034	EUR	23 300 000			97,318	22 675 094,00	0,36
1,625 % Vonovia Finance BV 2019/2039	EUR	32 100 000			98,748	31 698 108,00	0,50
1,823 % Wintershall Dea Finance BV 2019/2031	EUR	15 200 000			93,935	14 278 044,00	0,22

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1,414 % Zimmer Biomet Holdings, Inc. (MTN) 2016/2022	EUR	290 000			%	100,361	291 045,45	0,00
1,164 % Zimmer Biomet Holdings, Inc. (MTN) 2019/2027	EUR	500 000			%	97,708	488 540,00	0,01
1,625 % Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 2019/2039	EUR	43 182 000			%	111,024	47 942 167,77	0,75
2,75 % Hungary Government Bond (MTN) 2017/2026	HUF	227 000 000			%	107,632	689 327,66	0,01
2,5 % Hungary Government Bond (MTN) 2018/2024	HUF	240 000 000			%	105,792	716 340,07	0,01
6 % Hungary Government Bond 2007/2023	HUF	730 000 000	20 000 000	70 000 000	%	116,563	2 400 714,03	0,04
7 % Hungary Government Bond 2011/2022	HUF	345 000 000	85 000 000	80 000 000	%	112,577	1 095 788,57	0,02
6,75 % Hungary Government Bond 2011/2028	HUF	190 000 000	10 000 000		%	137,512	737 141,39	0,01
5,5 % Hungary Government Bond 2014/2025	HUF	390 000 000			%	120,361	1 324 368,08	0,02
3,25 % Hungary Government Bond 2015/2031	HUF	132 000 000	132 000 000		%	110,335	410 907,12	0,01
3 % Hungary Government Bond 2016/2027	HUF	330 000 000		50 000 000	%	109,109	1 015 855,05	0,02
3 % Hungary Government Bond 2019/2030	HUF	220 000 000	50 000 000		%	107,661	668 247,76	0,01
6,5 % Mexican Bonos (MTN) 2011/2021	MXN	6 900 000		20 100 000	%	101,683	270 342,28	0,00
6,5 % Mexican Bonos (MTN) 2012/2022	MXN	36 000 000	3 000 000		%	103,496	1 435 637,28	0,02
8 % Mexican Bonos 2003/2023	MXN	40 000 000	12 500 000		%	110,386	1 701 346,02	0,03
10 % Mexican Bonos 2005/2024	MXN	42 100 000			%	120,450	1 953 923,53	0,03
10 % Mexican Bonos 2006/2036	MXN	7 000 000			%	135,565	365 647,56	0,01
7,5 % Mexican Bonos 2007/2027	MXN	50 000 000	26 500 000	25 300 000	%	111,697	2 151 940,08	0,03
8,5 % Mexican Bonos 2009/2038	MXN	16 000 000	3 000 000		%	119,010	733 702,97	0,01
7,75 % Mexican Bonos 2011/2031	MXN	20 000 000		3 000 000	%	113,346	873 479,95	0,01
7,75 % Mexican Bonos 2014/2034	MXN	11 500 000	3 000 000		%	114,025	505 259,72	0,01
7,75 % Mexican Bonos 2014/2042	MXN	16 200 000			%	109,622	684 276,14	0,01
8 % Mexican Bonos 2017/2047	MXN	15 400 000	6 500 000		%	112,456	667 301,37	0,01
5,7 % Peru Government Bond (MTN) 2014/2024	PEN	4 400 000	500 000	500 000	%	116,187	1 287 418,46	0,02
6,9 % Peru Government Bond 2007/2037	PEN	3 900 000	1 050 000	1 250 000	%	120,345	1 181 958,53	0,02
6,95 % Peru Government Bond 2008/2031	PEN	5 400 000		600 000	%	121,677	1 654 671,75	0,03
6,35 % Peru Government Bond 2016/2028	PEN	6 750 000	300 000	1 650 000	%	118,408	2 012 771,01	0,03
6,15 % Peru Government Bond 2017/2032	PEN	3 600 000	500 000	800 000	%	114,244	1 035 731,74	0,02
5,4 % Peru Government Bond 2019/2034	PEN	2 700 000	1 100 000	500 000	%	105,569	717 809,99	0,01
5,35 % Peru Government Bond 2019/2040	PEN	2 400 000	4 402 000	2 002 000	%	100,540	607 662,96	0,01
6,25 % Philippine Government International Bond 2011/2036	PHP	20 000 000			%	124,375	444 506,39	0,01
5,75 % Republic of Poland Government Bond (MTN) 2011/2021	PLN	8 900 000			%	107,538	2 154 251,13	0,03
2,25 % Republic of Poland Government Bond (MTN) 2019/2024	PLN	3 400 000	2 900 000	1 200 000	%	107,368	821 671,36	0,01
2,75 % Republic of Poland Government Bond (MTN) 2019/2029	PLN	4 000 000	1 600 000		%	112,658	1 014 295,43	0,02
5,75 % Republic of Poland Government Bond 2002/2022	PLN	5 700 000	520 000	900 000	%	112,561	1 444 132,92	0,02
4 % Republic of Poland Government Bond 2012/2023	PLN	7 700 000	900 000		%	112,042	1 941 851,19	0,03
2,75 % Republic of Poland Government Bond 2013/2028	PLN	3 900 000			%	111,223	976 341,23	0,02
3,25 % Republic of Poland Government Bond 2014/2025	PLN	3 500 000		3 400 000	%	112,666	887 575,47	0,01
2,5 % Republic of Poland Government Bond 2015/2026	PLN	5 200 000	300 000		%	109,187	1 277 958,22	0,02
2,5 % Republic of Poland Government Bond 2016/2027	PLN	4 100 000			%	109,234	1 008 059,26	0,02
5,95 % Romania Government Bond (MTN) 2011/2021	RON	2 000 000			%	102,656	424 218,87	0,01
5,85 % Romania Government Bond (MTN) 2013/2023	RON	8 100 000	400 000		%	106,394	1 780 638,54	0,03
3,25 % Romania Government Bond (MTN) 2016/2024	RON	4 200 000	2 000 000	800 000	%	99,076	859 792,02	0,01
3,4 % Romania Government Bond (MTN) 2017/2022	RON	5 400 000	1 700 000		%	100,161	1 117 552,84	0,02
4,85 % Romania Government Bond (MTN) 2018/2026	RON	3 300 000	1 200 000		%	105,910	722 148,58	0,01
5,8 % Romania Government Bond 2012/2027	RON	2 900 000			%	112,490	674 042,95	0,01
4,75 % Romania Government Bond 2014/2025	RON	4 000 000	3 000 000	2 500 000	%	104,820	866 322,91	0,01
3,65 % Romania Government Bond 2016/2031	RON	2 000 000	2 000 000		%	95,249	393 607,89	0,01
5 % Romanian Government International Bond -Reg- 2018/2029	RON	2 900 000	2 100 000	1 200 000	%	108,023	647 273,57	0,01
7,6 % Russian Federal Bond - OFZ (MTN) 2012/2022	RUB	162 000 000	6 000 000		%	106,056	2 146 835,41	0,03
7 % Russian Federal Bond - OFZ (MTN) 2013/2023	RUB	128 000 000	32 000 000	30 000 000	%	106,598	1 704 933,83	0,03
7,75 % Russian Federal Bond - OFZ (MTN) 2016/2026	RUB	120 000 000	20 000 000		%	112,734	1 690 381,67	0,03
7,1 % Russian Federal Bond - OFZ (MTN) 2017/2024	RUB	93 000 000	38 000 000	35 000 000	%	107,987	1 254 882,18	0,02
7,05 % Russian Federal Bond - OFZ 2013/2028	RUB	82 000 000	16 000 000	20 000 000	%	109,326	1 120 180,09	0,02
8,5 % Russian Federal Bond - OFZ 2016/2031	RUB	40 000 000			%	121,014	604 847,86	0,01
7,7 % Russian Federal Bond - OFZ 2017/2033	RUB	62 000 000		5 000 000	%	114,665	888 327,49	0,01
6,9 % Russian Federal Bond - OFZ 2018/2029	RUB	60 000 000	12 000 000		%	108,385	812 589,06	0,01
7,25 % Russian Federal Bond - OFZ 2018/2034	RUB	36 000 000			%	111,190	500 169,05	0,01
7,65 % Russian Federal Bond - OFZ 2019/2030	RUB	6 000 000	6 000 000		%	113,502	85 095,25	0,00
7,7 % Russian Federal Bond - OFZ 2019/2039	RUB	33 000 000	33 000 000		%	117,213	483 326,11	0,01
9,5 % Turkey Government Bond (MTN) 2012/2022	TRY	5 400 000		1 700 000	%	100,502	704 918,76	0,01
10,40 % Turkey Government Bond (MTN) 2014/2024	TRY	2 100 000	1 050 000	3 000 000	%	101,161	275 932,60	0,00
9 % Turkey Government Bond (MTN) 2014/2024	TRY	3 800 000			%	96,459	476 098,66	0,01
8 % Turkey Government Bond (MTN) 2015/2025	TRY	4 500 000			%	91,393	534 190,37	0,01
10,60 % Turkey Government Bond (MTN) 2016/2026	TRY	6 300 000			%	98,522	806 198,84	0,01
11 % Turkey Government Bond (MTN) 2017/2022	TRY	9 800 000	600 000		%	102,765	1 308 102,90	0,02
11 % Turkey Government Bond (MTN) 2017/2027	TRY	8 100 000	600 000	2 000 000	%	97,779	1 028 729,55	0,02
12,20 % Turkey Government Bond (MTN) 2018/2023	TRY	7 100 000	2 600 000	2 300 000	%	105,568	973 556,70	0,02
12,40 % Turkey Government Bond (MTN) 2018/2028	TRY	3 200 000		500 000	%	104,509	434 384,46	0,01
4,125 % Abu Dhabi Government International Bond -Reg- 2017/2047	USD	3 000 000			%	121,981	3 258 184,48	0,05
3,125 % Abu Dhabi Government International Bond -Reg- 2019/2049	USD	1 000 000			%	104,126	927 084,51	0,01
3,875 % Abu Dhabi Government International Bond -Reg- 2020/2050	USD	960 000	960 000		%	118,505	1 012 904,04	0,02

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
6 % Aeropuerto Internacional de Tocumen SA -Reg- 2018/2048	USD	4 679 224	1 000 000	20 776	%	109,646	4 568 028,65	0,07
3,125 % Africa Finance Corp. (MTN) 2020/2025	USD	5 560 000	5 560 000		%	100,271	4 963 753,41	0,08
5,5 % Banque Ouest Africaine de Developpement -Reg- (MTN) 2016/2021	USD	3 200 000			%	102,353	2 916 155,37	0,05
5 % Banque Ouest Africaine de Developpement -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	3 300 000			%	104,696	3 076 126,43	0,05
4,7 % Banque Ouest Africaine de Developpement -Reg- 2019/2031	USD	4 380 000	1 000 000		%	101,156	3 944 807,70	0,06
3,5 % Black Sea Trade & Development Bank -Reg- (MTN) 2019/2024	USD	4 330 000			%	102,776	3 962 230,35	0,06
6 % Brazilian Government International Bond (MTN) 2016/2026	USD	1 000 000			%	113,438	1 009 994,18	0,02
4,5 % Brazilian Government International Bond (MTN) 2019/2029	USD	800 000	200 000		%	102,651	731 161,44	0,01
10,125 % Brazilian Government International Bond 1997/2027	USD	370 000		220 000	%	135,501	446 381,77	0,01
8,25 % Brazilian Government International Bond 2004/2034	USD	660 000			%	130,095	764 481,12	0,01
8,75 % Brazilian Government International Bond 2005/2025	USD	410 000			%	123,126	449 464,97	0,01
7,125 % Brazilian Government International Bond 2006/2037	USD	780 000	210 000	120 000	%	120,530	837 047,65	0,01
5,625 % Brazilian Government International Bond 2009/2041	USD	1 000 000			%	104,500	930 418,88	0,01
2,625 % Brazilian Government International Bond 2012/2023	USD	500 000		700 000	%	102,250	455 192,97	0,01
4,25 % Brazilian Government International Bond 2013/2025	USD	1 800 000			%	105,708	1 694 105,81	0,03
5 % Brazilian Government International Bond 2014/2045	USD	1 400 000			%	96,430	1 201 988,12	0,02
5,625 % Brazilian Government International Bond 2016/2047	USD	1 200 000			%	104,430	1 115 749,42	0,02
4,625 % Brazilian Government International Bond 2017/2028	USD	1 000 000	400 000		%	104,770	932 818,39	0,01
4,75 % Brazilian Government International Bond 2019/2050	USD	800 000	800 000		%	94,664	674 271,45	0,01
5,125 % CNAC HK Finbridge Co., Ltd (MTN) 2018/2028	USD	2 000 000			%	115,875	2 063 384,17	0,03
4,375 % Colombia Government International Bond (MTN) 2011/2021	USD	600 000		400 000	%	102,820	549 273,90	0,01
2,625 % Colombia Government International Bond (MTN) 2013/2023	USD	400 000			%	101,716	362 250,80	0,01
3,875 % Colombia Government International Bond (MTN) 2017/2027	USD	6 800 000	400 000	200 000	%	105,482	6 386 302,63	0,10
8,125 % Colombia Government International Bond 2004/2024	USD	330 000	50 000		%	120,615	354 385,29	0,01
6,125 % Colombia Government International Bond 2009/2041	USD	1 700 000		400 000	%	125,350	1 897 297,72	0,03
5,625 % Colombia Government International Bond 2014/2044	USD	4 800 000	600 000	200 000	%	120,430	5 146 788,79	0,08
4,5 % Colombia Government International Bond 2015/2026	USD	4 600 000			%	108,486	4 443 157,95	0,07
5 % Colombia Government International Bond 2015/2045	USD	1 800 000			%	113,680	1 821 867,91	0,03
4,5 % Colombia Government International Bond 2018/2029 **	USD	3 800 000			%	110,206	3 728 645,22	0,06
5,2 % Colombia Government International Bond 2019/2049	USD	600 000			%	117,869	629 667,44	0,01
4,875 % Comision Federal de Electricidad -Reg- 2013/2024	USD	3 000 000			%	105,615	2 821 025,61	0,04
4,75 % Corp Financiera de Desarrollo SA -Reg- (MTN) 2015/2025	USD	6 300 000			%	109,515	6 142 913,51	0,10
4,5 % Corp Nacional del Cobre de Chile (MTN) 2015/2025	USD	4 000 000			%	112,257	3 997 949,19	0,06
3,625 % Corp Nacional del Cobre de Chile -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	5 300 000			%	107,253	5 061 121,31	0,08
4,5 % Corp Nacional del Cobre de Chile -Reg- 2017/2047	USD	2 000 000			%	114,832	2 044 820,31	0,03
5,5 % Croatia Government International Bond (MTN) 2013/2023	USD	600 000		600 000	%	110,329	589 390,54	0,01
6 % Croatia Government International Bond 2013/2024	USD	800 000			%	114,738	817 255,01	0,01
4,125 % Development Bank of Kazakhstan JSC -Reg- (MTN) 2012/2022	USD	11 000 000			%	104,372	10 222 071,56	0,16
4,875 % Eastern & Southern African Trade & Development Bank (MTN) 2019/2024	USD	1 810 000			%	100,608	1 621 337,09	0,03
6,875 % Ecopetrol SA (MTN) 2020/2030	USD	1 250 000	1 250 000		%	114,860	1 278 324,32	0,02
4,375 % Empresa Nacional del Petroleo -Reg- (MTN) 2014/2024	USD	3 700 000			%	107,413	3 538 496,54	0,06
2,875 % Export-Import Bank of China/The (MTN) 2016/2026	USD	4 400 000			%	108,066	4 233 523,45	0,07
3,875 % Export-Import Bank of India -Reg- (MTN) 2018/2028	USD	4 100 000			%	104,032	3 797 627,86	0,06
7,75 % Georgian Railway LLC (MTN) 2012/2022	USD	2 800 000	2 800 000		%	101,875	2 539 731,93	0,04
5,75 % Hungary Government International Bond (MTN) 2013/2023	USD	1 880 000		500 000	%	113,861	1 905 877,88	0,03
5,375 % Hungary Government International Bond (MTN) 2014/2024	USD	360 000	80 000		%	113,765	364 646,99	0,01
7,625 % Hungary Government International Bond 2011/2041	USD	550 000	30 000		%	168,103	823 191,54	0,01
3,249 % Indian Railway Finance Corp., Ltd -Reg- (MTN) 2020/2030	USD	1 730 000	1 730 000		%	99,505	1 532 678,45	0,02
3,375 % Indonesia Government International Bond (MTN) 2013/2023	USD	800 000		200 000	%	104,288	742 827,33	0,01
5,875 % Indonesia Government International Bond (MTN) 2014/2024	USD	1 000 000			%	113,633	1 011 736,73	0,02

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
4,125 % Indonesia Government International Bond (MTN) 2015/2025	USD	1 600 000	200 000		%	108,832	1 550 384,91	0,02
7,75 % Indonesia Government International Bond 2008/2038	USD	900 000	100 000	100 000	%	151,125	1 210 988,78	0,02
5,25 % Indonesia Government International Bond 2012/2042	USD	1 000 000			%	124,028	1 104 286,16	0,02
4,625 % Indonesia Government International Bond 2013/2043	USD	2 300 000			%	115,027	2 355 536,47	0,04
5,125 % Indonesia Government International Bond 2015/2045	USD	600 000	200 000		%	122,947	656 797,50	0,01
5,95 % Indonesia Government International Bond 2015/2046	USD	600 000			%	136,942	731 559,24	0,01
4,35 % Indonesia Government International Bond 2016/2027	USD	800 000	200 000		%	111,315	792 877,15	0,01
5,25 % Indonesia Government International Bond 2016/2047	USD	600 000			%	125,513	670 505,71	0,01
3,5 % Indonesia Government International Bond 2017/2028	USD	800 000			%	106,605	759 329,20	0,01
4,35 % Indonesia Government International Bond 2017/2048	USD	800 000			%	113,043	805 182,28	0,01
4,75 % Indonesia Government International Bond 2018/2029	USD	600 000	200 000		%	116,135	620 409,06	0,01
5,35 % Indonesia Government International Bond 2018/2049 **	USD	1 400 000			%	130,028	1 620 791,23	0,03
3,7 % Indonesia Government International Bond 2019/2049	USD	200 000	200 000		%	104,344	185 805,90	0,00
6,75 % Indonesia Government International Bond -Reg- (MTN) 2014/2044	USD	2 700 000		200 000	%	146,550	3 523 002,82	0,06
8,5 % Indonesia Government International Bond -Reg- 2005/2035	USD	2 100 000			%	155,982	2 916 450,52	0,05
4,75 % Indonesia Government International Bond -Reg- 2015/2026	USD	5 200 000			%	112,834	5 224 010,09	0,08
1 % Ivory Coast Government International Bond -Reg- 2010/2032 *	USD	2 565 000	2 565 000	150 000	%	98,860	2 191 696,54	0,03
6,95 % Kazakhstan Temir Zholy Finance BV -Reg- 2040/2042	USD	3 000 000			%	133,563	3 567 533,18	0,06
5,375 % KazMunayGas National Co., JSC -Reg- 2018/2030	USD	4 000 000	4 000 000		%	113,638	4 047 117,37	0,06
6,375 % KazMunayGas National Co., JSC -Reg- 2018/2048	USD	4 000 000			%	126,582	4 508 106,54	0,07
3,5 % Kuwait International Government Bond (MTN) 2017/2027	USD	2 000 000			%	112,137	1 996 830,29	0,03
3,043 % Malaysia Sovereign Sukuk Bhd (MTN) 2015/2025	USD	2 000 000			%	107,524	1 914 688,94	0,03
3,179 % Malaysia Sukuk Global Bhd -Reg- (MTN) 2016/2026	USD	2 000 000			%	109,388	1 947 882,58	0,03
2,75 % MDC-GMTN BV -Reg- (MTN) 2016/2023 **	USD	5 000 000	5 000 000		%	103,584	4 611 294,00	0,07
2,5 % MDGH - GMTN BV (MTN) 2020/2026	USD	1 000 000	1 000 000		%	103,179	918 657,32	0,01
3,7 % MDGH - GMTN BV -Reg- 2019/2049	USD	2 000 000			%	106,563	1 897 564,83	0,03
3,75 % Mexico Government International Bond (MTN) 2018/2028	USD	1 000 000			%	104,254	928 224,16	0,01
3,625 % Mexico Government International Bond (MTN) 2012/2022	USD	1 150 000	110 000	700 000	%	104,151	1 066 408,29	0,02
4,125 % Mexico Government International Bond (MTN) 2016/2026	USD	800 000			%	108,282	771 273,63	0,01
4,15 % Mexico Government International Bond (MTN) 2017/2027	USD	1 000 000			%	107,688	958 798,89	0,02
4,5 % Mexico Government International Bond (MTN) 2019/2029	USD	1 000 000	200 000		%	108,838	969 037,95	0,02
3,25 % Mexico Government International Bond (MTN) 2020/2030	USD	3 000 000	3 000 000		%	99,194	2 649 530,26	0,04
6,75 % Mexico Government International Bond 2004/2034	USD	790 000		80 000	%	131,732	926 575,05	0,01
6,05 % Mexico Government International Bond 2008/2040	USD	4 200 000		50 000	%	122,361	4 575 649,60	0,07
5,75 % Mexico Government International Bond 2010/2110	USD	2 130 000	30 000	60 000	%	111,430	2 113 206,86	0,03
4,75 % Mexico Government International Bond 2012/2044	USD	5 760 000		200 000	%	105,641	5 417 728,20	0,08
3,6 % Mexico Government International Bond 2014/2025	USD	2 200 000			%	106,294	2 082 062,00	0,03
5,55 % Mexico Government International Bond 2014/2045	USD	1 190 000		70 000	%	118,221	1 252 575,22	0,02
4,6 % Mexico Government International Bond 2015/2046	USD	1 200 000			%	103,498	1 105 791,71	0,02
4,35 % Mexico Government International Bond 2016/2047	USD	800 000			%	100,448	715 469,86	0,01
4,6 % Mexico Government International Bond 2017/2048	USD	1 200 000	400 000	200 000	%	104,180	1 113 078,36	0,02
4,5 % Mexico Government International Bond 2019/2050	USD	1 200 000	1 200 000		%	103,400	1 104 750,00	0,02
5,5 % Morocco Government International Bond 2012/2042 **	USD	1 800 000			%	122,532	1 963 733,19	0,03
5,5 % Namibia International Bonds -Reg- (MTN) 2011/2021	USD	5 000 000			%	100,520	4 474 914,18	0,07
4 % Panama Government International Bond (MTN) 2014/2024	USD	2 000 000			%	109,000	1 940 969,54	0,03
9,375 % Panama Government International Bond 1999/2029	USD	2 440 000			%	152,106	3 304 444,02	0,05
7,125 % Panama Government International Bond 2005/2026	USD	3 700 000	200 000	200 000	%	126,857	4 179 057,89	0,07
6,7 % Panama Government International Bond 2006/2036	USD	3 320 000			%	144,306	4 265 630,12	0,07
3,875 % Panama Government International Bond 2016/2028	USD	3 000 000			%	112,611	3 007 892,89	0,05
4,5 % Panama Government International Bond 2017/2047	USD	600 000			%	122,930	656 703,89	0,01
4,5 % Panama Government International Bond 2018/2050	USD	2 300 000			%	123,050	2 519 832,54	0,04
3,16 % Panama Government International Bond 2019/2030	USD	600 000	1 200 000	600 000	%	107,638	575 012,23	0,01
4,5 % Panama Government International Bond 2020/2056	USD	3 000 000	3 000 000		%	123,101	3 288 100,34	0,05

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
4,3% Pertamina Persero PT 2011/2021 -Reg- (MTN)								
2013/2023	USD	3 500 000			%	105,878	3 299 400,63	0,05
4,175% Pertamina Persero PT 2020/2050 **	USD	1 500 000	3 000 000	1 500 000	%	99,159	1 324 297,70	0,02
5,625% Pertamina Persero PT -Reg- (MTN) 2013/2043	USD	600 000			%	116,316	621 373,80	0,01
6,45 % Pertamina Persero PT -Reg- (MTN) 2014/2044	USD	1 000 000			%	128,534	1 144 401,87	0,02
6,5 % Pertamina Persero PT -Reg- (MTN) 2018/2048	USD	2 000 000			%	131,429	2 340 371,09	0,04
3,65 % Pertamina Persero PT -Reg- (MTN) 2019/2029 **	USD	2 000 000	2 000 000		%	104,995	1 869 657,70	0,03
6 % Pertamina Persero PT -Reg- 2012/2042	USD	1 700 000			%	119,483	1 808 494,61	0,03
4,125% Perusahaan Listrik Negara PT -Reg- (MTN)								
2017/2027	USD	4 500 000			%	106,223	4 255 898,47	0,07
6,25 % Perusahaan Listrik Negara PT -Reg- 2018/2049 **	USD	2 000 000			%	126,436	2 251 453,44	0,04
8,75 % Peruvian Government International Bond								
2003/2033	USD	4 130 000		100 000	%	167,220	6 148 943,42	0,10
7,35 % Peruvian Government International Bond								
2005/2025	USD	400 000			%	127,615	454 487,81	0,01
6,55 % Peruvian Government International Bond								
2007/2037	USD	420 000			%	152,556	570 478,64	0,01
5,625% Peruvian Government International Bond								
2010/2050	USD	3 400 000	100 000	30 000	%	158,180	4 788 410,14	0,07
4,125% Peruvian Government International Bond								
2015/2027	USD	180 000			%	114,982	184 274,22	0,00
2,844% Peruvian Government International Bond								
2019/2030	USD	320 000	620 000	300 000	%	107,606	306 583,44	0,00
5,625% Petroleos del Peru SA -Reg- 2017/2047	USD	4 000 000			%	117,560	4 186 778,14	0,07
3,5 % Petroleos Mexicanos (MTN) 2013/2023	USD	2 000 000	2 000 000		%	95,465	1 699 942,08	0,03
6,5 % Petroleos Mexicanos 2018/2029	USD	3 000 000			%	87,537	2 338 164,92	0,04
6,5 % Petroleos Mexicanos -Reg- (MTN) 2018/2027	USD	1 800 000			%	90,399	1 448 766,37	0,02
4,55 % Petronas Capital Ltd -Reg- 2020/2050	USD	480 000			%	127,303	544 053,55	0,01
4,2 % Philippine Government International Bond (MTN)								
2014/2024	USD	600 000			%	109,105	582 852,51	0,01
3 % Philippine Government International Bond (MTN)								
2018/2028	USD	400 000			%	108,221	385 418,96	0,01
3,75 % Philippine Government International Bond (MTN)								
2019/2029	USD	600 000			%	114,487	611 602,70	0,01
2,457% Philippine Government International Bond (MTN)								
2020/2030	USD	3 000 000	3 000 000		%	105,091	2 807 039,78	0,04
10,625% Philippine Government International Bond								
2000/2025	USD	110 000			%	140,224	137 333,69	0,00
9,5 % Philippine Government International Bond								
2005/2030	USD	2 820 000	80 000		%	163,087	4 094 784,40	0,06
7,75 % Philippine Government International Bond								
2006/2031	USD	2 100 000		300 000	%	149,966	2 803 969,25	0,04
6,375% Philippine Government International Bond								
2007/2032	USD	400 000	200 000		%	138,671	493 863,56	0,01
6,375% Philippine Government International Bond								
2009/2034	USD	1 000 000			%	144,534	1 286 860,56	0,02
5,5 % Philippine Government International Bond								
2011/2026	USD	400 000			%	120,268	428 323,13	0,01
5 % Philippine Government International Bond								
2012/2037	USD	1 600 000			%	129,217	1 840 779,07	0,03
3,95 % Philippine Government International Bond								
2015/2040	USD	2 100 000			%	116,425	2 176 840,37	0,03
3,7 % Philippine Government International Bond								
2016/2041	USD	800 000			%	114,180	813 285,89	0,01
3,7 % Philippine Government International Bond								
2017/2042	USD	800 000			%	114,778	817 541,23	0,01
7,39 % Power Sector Assets & Liabilities Management Corp. -Reg- 2009/2024	USD	1 500 000			%	123,170	1 644 974,89	0,03
3,25 % Qatar Government International Bond (MTN)								
2016/2026	USD	6 500 000			%	108,729	6 292 438,50	0,10
4,5 % Qatar Government International Bond (MTN)								
2018/2028	USD	2 000 000			%	118,358	2 107 608,01	0,03
4 % Qatar Government International Bond -Reg- (MTN)								
2019/2029	USD	4 000 000			%	115,375	4 108 961,29	0,06
3,75 % Qatar Government International Bond -Reg- (MTN) 2020/2030	USD	5 000 000	5 000 000		%	114,374	5 091 639,44	0,08
4,625% Qatar Government International Bond -Reg- 2016/2046	USD	1 000 000			%	129,407	1 152 174,65	0,02
5,103% Qatar Government International Bond -Reg- 2018/2048	USD	3 000 000			%	136,424	3 643 952,17	0,06
4,817% Qatar Government International Bond -Reg- 2019/2049	USD	5 000 000			%	132,249	5 887 392,43	0,09
4,4 % Qatar Government International Bond -Reg- 2020/2050 **	USD	570 000	570 000		%	124,373	631 194,48	0,01
2,75 % QNB Finance Ltd (MTN) 2020/2027	USD	4 050 000	4 050 000		%	102,710	3 703 650,34	0,06
4,875% Republic of South Africa Government Bond (MTN) 2016/2026	USD	600 000			%	100,316	535 899,91	0,01
5,875% Republic of South Africa Government Bond 2013/2025	USD	1 000 000			%	106,328	946 694,54	0,01
4,3 % Republic of South Africa Government Bond 2016/2028	USD	800 000			%	92,998	662 408,39	0,01

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
5,65 % Republic of South Africa Government Bond 2017/2047	USD	800 000	200 000		87,376	622 363,87	0,01
5,875 % Republic of South Africa Government Bond 2018/2030	USD	600 000			101,982	544 799,34	0,01
4,85 % Republic of South Africa Government International Bond (MTN) 2019/2029	USD	800 000	800 000		95,037	676 931,82	0,01
5,875 % Republic of South Africa Government International Bond 2007/2022	USD	300 000			105,902	282 870,49	0,00
5 % Republic of South Africa Government International Bond 2016/2046	USD	400 000			82,543	293 969,63	0,00
6,3 % Republic of South Africa Government International Bond 2018/2048	USD	200 000			94,423	168 140,31	0,00
5,75 % Republic of South Africa Government International Bond 2019/2049	USD	800 000	800 000		87,231	621 330,35	0,01
4,375 % Romanian Government International Bond (MTN) 2013/2023	USD	2 020 000	80 000	100 000	106,492	1 915 265,33	0,03
4,875 % Romanian Government International Bond -Reg- (MTN) 2014/2024	USD	3 000 000			109,044	2 912 629,57	0,05
6,125 % Romanian Government International Bond -Reg- (MTN) 2014/2044	USD	370 000			131,745	434 008,36	0,01
5,125 % Romanian Government International Bond -Reg- 2018/2048	USD	2 700 000		20 000	118,500	2 848 684,42	0,04
4,5 % Russian Foreign Bond - Eurobond (MTN) 2012/2022	USD	400 000			105,788	376 752,87	0,01
4,875 % Russian Foreign Bond - Eurobond (MTN) 2013/2023	USD	2 000 000			111,228	1 980 634,77	0,03
4,75 % Russian Foreign Bond - Eurobond (MTN) 2016/2026	USD	2 400 000	200 000		114,030	2 436 646,86	0,04
1 % Russian Foreign Bond - Eurobond 2000/2030 *	USD	1 416 000	88 500	247 000	115,250	1 453 002,67	0,02
5,875 % Russian Foreign Bond - Eurobond 2013/2043	USD	2 200 000		400 000	140,919	2 760 288,40	0,04
4,375 % Russian Foreign Bond - Eurobond 2018/2029	USD	600 000			113,838	608 133,36	0,01
4,75 % Russian Foreign Bond - Eurobond -Reg- (MTN) 2016/2026	USD	1 200 000		3 000 000	114,030	1 218 323,43	0,02
4,25 % Russian Foreign Bond - Eurobond -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	6 000 000			111,944	5 980 180,57	0,09
12,750 % Russian Foreign Bond - Eurobond -Reg- 1998/2028	USD	210 000		150 000	172,238	322 039,57	0,01
5,625 % Russian Foreign Bond - Eurobond -Reg- 2012/2042	USD	5 800 000			135,950	7 020 522,43	0,11
5,25 % Russian Foreign Bond - Eurobond -Reg- 2017/2047	USD	3 600 000	400 000	200 000	132,273	4 239 691,81	0,07
4,375 % Russian Foreign Bond - Eurobond -Reg- 2018/2029	USD	1 600 000			113,838	1 621 688,96	0,03
5,1 % Russian Foreign Bond - Eurobond -Reg- 2019/2035	USD	4 400 000			123,838	4 851 399,94	0,08
3,5 % Saudi Arabian Oil Co. -Reg- (MTN) 2019/2029 **	USD	1 000 000		1 000 000	108,325	964 470,44	0,02
4,25 % Saudi Arabian Oil Co. -Reg- 2019/2039 **	USD	1 000 000			112,063	997 751,83	0,02
4,5 % Saudi Government International Bond (MTN) 2016/2046	USD	6 400 000	3 200 000		115,299	6 570 007,38	0,10
5,25 % Saudi Government International Bond 2019/2050	USD	1 500 000			128,938	1 722 005,03	0,03
3,625 % Saudi Government International Bond -Reg- (MTN) 2017/2028	USD	2 000 000			110,393	1 965 765,87	0,03
4,375 % Saudi Government International Bond -Reg- (MTN) 2019/2029	USD	2 000 000			116,519	2 074 851,92	0,03
5 % Saudi Government International Bond -Reg- 2018/(MTN)/2049	USD	4 000 000			124,085	4 419 160,27	0,07
4,5 % Saudi Government International Bond -Reg- 2018/2030	USD	1 000 000			117,982	1 050 456,28	0,02
3,75 % Saudi Government International Bond -Reg- 2020/2055	USD	2 000 000	2 000 000		102,261	1 820 958,86	0,03
4,5 % Saudi Government International Bond -Reg- 2020/2060	USD	1 520 000	1 520 000		115,566	1 563 996,93	0,02
5,75 % Sri Lanka Government International Bond -Reg- (MTN) 2018/2023	USD	3 200 000			70,834	2 018 138,21	0,03
4,375 % State Grid Overseas Investment 2013 Ltd 2013/2043	USD	1 600 000			128,982	1 837 433,79	0,03
3,125 % State Grid Overseas Investment 2013 Ltd -Reg- (MTN) 2013/2023	USD	3 000 000		3 600 000	105,107	2 807 456,63	0,04
3,5 % State Grid Overseas Investment 2016 Ltd -Reg- (MTN) 2017/2027 **	USD	7 600 000			110,797	7 497 273,42	0,12
6,25 % Turkey Government International Bond (MTN) 2012/2022	USD	2 200 000	200 000		101,558	1 989 286,50	0,03
3,25 % Turkey Government International Bond (MTN) 2013/2023	USD	800 000	200 000		94,684	674 417,47	0,01
4,875 % Turkey Government International Bond (MTN) 2016/2026	USD	1 400 000	200 000		93,083	1 160 267,96	0,02
6,125 % Turkey Government International Bond (MTN) 2018/2028	USD	800 000			97,343	693 357,06	0,01
6,35 % Turkey Government International Bond (MTN) 2019/2024	USD	800 000	800 000		101,375	722 076,28	0,01
11,875 % Turkey Government International Bond 2000/2030	USD	1 160 000			135,917	1 403 762,63	0,02
6,875 % Turkey Government International Bond 2006/2036	USD	1 170 000		490 000	97,705	1 017 805,70	0,02
5,625 % Turkey Government International Bond 2010/2021	USD	900 000		200 000	101,931	816 791,14	0,01
6,75 % Turkey Government International Bond 2010/2040	USD	700 000			94,838	591 071,97	0,01
6 % Turkey Government International Bond 2011/2041	USD	1 200 000			86,663	925 922,60	0,01
4,875 % Turkey Government International Bond 2013/2043	USD	3 000 000			77,475	2 069 402,96	0,03
5,75 % Turkey Government International Bond 2017/2047	USD	1 600 000			81,957	1 167 534,85	0,02
7,875 % Uruguay Government International Bond 2003/2033	USD	2 000 000			151,607	2 699 674,94	0,04

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
7,625 % Uruguay Government International Bond 2006/2036 **	USD	1 500 000			%	151,931	2 029 076,65	0,03
4,125 % Uruguay Government International Bond 2012/2045	USD	2 200 000			%	115,751	2 267 303,50	0,04
5,1 % Uruguay Government International Bond 2014/2050	USD	5 000 000			%	129,431	5 761 941,70	0,09
4,975 % Uruguay Government International Bond 2018/2055	USD	2 000 000			%	128,531	2 288 750,32	0,04
4,375 % Uruguay Government International Bond 2019/2031	USD	2 897 867	897 867		%	117,158	3 022 809,45	0,05
6,025 % Vnesheconombank Via VEB Finance PLC -Reg- (MTN) 2012/2022	USD	4 000 000			%	107,152	3 816 124,18	0,06
6,8 % Vnesheconombank Via VEB Finance PLC -Reg- 2010/2025	USD	6 000 000			%	119,355	6 376 084,94	0,10
9,875 % Uruguay Government International Bond (MTN) 2017/2022	UYU	8 300 000		2 000 000	%	99,750	174 679,03	0,00
8,5 % Uruguay Government International Bond 2017/2028	UYU	9 400 000			%	91,500	181 467,44	0,00
10,50 % Republic of South Africa Government Bond 1998/2026	ZAR	52 000 000	16 400 000	13 400 000	%	114,159	3 041 928,56	0,05
6,25 % Republic of South Africa Government Bond 2006/2036	ZAR	37 000 000	9 000 000	14 000 000	%	66,344	1 257 875,09	0,02
6,5 % Republic of South Africa Government Bond 2010/2041	ZAR	20 000 000	3 000 000	5 000 000	%	63,615	651 963,87	0,01
7,75 % Republic of South Africa Government Bond 2012/2023	ZAR	13 500 000	13 500 000		%	106,684	738 023,98	0,01
8,75 % Republic of South Africa Government Bond 2012/2048	ZAR	38 000 000	7 000 000		%	78,720	1 532 862,98	0,02
8 % Republic of South Africa Government Bond 2013/2030	ZAR	10 000 000	10 000 000		%	92,198	472 453,33	0,01
8,75 % Republic of South Africa Government Bond 2014/2044	ZAR	23 000 000	6 000 000		%	78,917	930 113,22	0,01
8,875 % Republic of South Africa Government Bond 2015/2035	ZAR	14 000 000	14 000 000		%	85,858	615 951,07	0,01
9 % Republic of South Africa Government Bond 2015/2040	ZAR	11 000 000	11 000 000		%	82,679	466 039,46	0,01
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						58 871 832,38	0,92	
Verzinsliche Wertpapiere								
1 % OMV AG 2015/2049 *	EUR	237 000	237 000		%	117,687	278 918,19	0,00
1 % Skandinaviska Enskilda Banken AB 2014/2026 *	EUR	470 000			%	100,923	474 335,75	0,01
1,50 % Statkraft AS 2015/2030 **	EUR	10 174 000		7 000 000	%	108,569	11 045 810,06	0,17
7,10 % Turkey Government International Bond (MTN) 2013/2023	TRY	8 700 000	1 300 000		%	93,947	1 061 629,00	0,02
5,63 % Codelco Inc 2005/2035 **	USD	4 400 000			%	123,256	4 828 619,37	0,08
7,38 % Colombia Government International Bond 2006/2037	USD	1 800 000			%	137,500	2 203 623,67	0,03
4 % Colombia Government International Bond 2013/2024	USD	6 200 000			%	105,538	5 825 869,04	0,09
5,63 % Corp Nacional del Cobre de Chile -Reg- 2013/2043	USD	2 200 000			%	130,228	2 550 878,80	0,04
3,70 % Corp Nacional del Cobre de Chile -Reg- 2019/2050	USD	2 000 000	2 000 000		%	102,577	1 826 590,86	0,03
3,75 % Empresa Nacional del Petroleo (MTN) 2016/2026	USD	1 200 000	1 200 000		%	103,594	1 106 824,20	0,02
4,50 % Empresa Nacional del Petroleo -Reg- 2017/2047	USD	1 000 000			%	105,312	937 647,06	0,02
4,77 % Eurasian Development Bank -Reg- (MTN) 2012/2022	USD	3 010 000			%	104,165	2 791 569,57	0,04
3,50 % Fondo MIVIVIENDA SA -Reg- (MTN) 2013/2023	USD	3 000 000			%	102,991	2 750 937,02	0,04
6,50 % Kazakhstan Governmnet International Bond -Reg- 2015/2045	USD	1 500 000			%	148,345	1 981 191,24	0,03
5,35 % Petroleos Mexicanos (MTN) 2018/2028 *	USD	6 300 000			%	84,215	4 723 779,86	0,07
5,95 % Petroleos Mexicanos -Reg- 2020/2031	USD	3 000 000	3 000 000		%	82,481	2 203 116,17	0,03
3,50 % Petronas Capital Ltd -Reg- (MTN) 2015/2025	USD	2 800 000			%	109,263	2 723 917,13	0,04
4,50 % Petronas Capital Ltd -Reg- (MTN) 2015/2045 **	USD	3 300 000			%	124,143	3 647 511,36	0,06
7,63 % Republic of Turkey (MTN) 2019/2029	USD	1 000 000	200 000		%	105,533	939 615,34	0,01
5,75 % Turkey Government International Bond (MTN) 2014/2024	USD	1 200 000			%	99,532	1 063 424,45	0,02
7,38 % Turkey Government International Bond 2005/2025	USD	2 450 000	850 000		%	105,575	2 302 982,48	0,04
7 % Republic of South Africa Government Bond 2015/2031	ZAR	38 000 000		7 900 000	%	82,324	1 603 041,76	0,03
Nichtnotierte Wertpapiere						12 423 006,06	0,19	
Verzinsliche Wertpapiere								
7 % Colombia Government International Bond (MTN) 2012/2022	COP	300 000 000		900 000 000	%	106,945	76 393,29	0,00
6 % Colombia Government International Bond 2012/2028	COP	500 000 000			%	101,842	121 246,96	0,00
1,25 % AbbVie, Inc. -Reg- 2020/2024	EUR	500 000	500 000		%	102,273	511 362,50	0,01
3,42 % Malaysia Government Bond (MTN) 2012/2022	MYR	4 400 000			%	102,530	937 378,60	0,01
3,48 % Malaysia Government Bond (MTN) 2013/2023	MYR	3 300 000			%	103,262	708 049,74	0,01
4,05 % Malaysia Government Bond (MTN) 2014/2021	MYR	5 800 000		3 300 000	%	102,463	1 234 827,98	0,02
4,18 % Malaysia Government Bond (MTN) 2014/2024	MYR	5 100 000	1 400 000	700 000	%	106,776	1 131 501,73	0,02
3,96 % Malaysia Government Bond (MTN) 2015/2025	MYR	7 100 000	400 000	1 400 000	%	107,347	1 583 651,66	0,03
3,90 % Malaysia Government Bond (MTN) 2017/2027	MYR	6 100 000	600 000		%	107,299	1 359 987,40	0,02
3,89 % Malaysia Government Bond (MTN) 2019/2029	MYR	3 700 000	4 600 000	3 300 000	%	108,327	832 813,65	0,01
4,39 % Malaysia Government Bond 2011/2026	MYR	4 100 000	1 200 000	1 500 000	%	109,484	932 708,45	0,02
3,73 % Malaysia Government Bond 2013/2028	MYR	3 200 000		900 000	%	105,949	704 463,09	0,01
4,76 % Malaysia Government Bond 2017/2037	MYR	3 600 000			%	115,349	862 834,96	0,01

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen		
3,83 % Malaysia Government Bond 2019/2034	MYR	700 000	700 000		%	106,039	154 231,48	0,00	
4,37 % Malaysia Government Investment Issue (MTN) 2018/2028	MYR	4 000 000			%	110,713	920 174,11	0,01	
3,47 % Malaysia Government Investment Issue (MTN) 2020/2030	MYR	1 600 000	1 600 000		%	105,693	351 380,46	0,01	
Summe Wertpapiervermögen						6 087 862 838,22	95,32		
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate								- 2 785 954,90	- 0,04
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
Dax Index 09/2020 (DB)	Stück	-352		352		85 800,35	0,00		
DJ Euro Stoxx 50 09/2020 (DB)		-6 370		6 370		114 658,79	0,00		
FTSE MIB Index Futures 09/2020 (DB)		-538		538		162 762,86	0,00		
S & P MINI 500 Futures 09/2020 (DB)	Stück	-1 993		1 993		- 2 510 664,36	- 0,04		
S & P TSX60 Index Futures 09/2020 (DB)	Stück	-306		306		- 638 512,54	- 0,01		
Zins-Derivate								- 38 281,67	0,00
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
Germany Federal Republic Notes 10 year 09/2020 (MS)		-96		96		- 191 040,00	0,00		
US Treasury Notes 5 year Futures 09/2020 (MS)	Stück	343	343			82 434,36	0,00		
US Ultra Bond 09/2020 (MS)	Stück	15	15			70 323,97	0,00		
Devisen-Derivate								1 387 116,72	0,02
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisentermingeschäfte									
Devisentermingeschäfte (Kauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR 188 Mio.						650 604,69	0,01		
Devisentermingeschäfte (Verkauf)									
Offene Positionen									
EUR/GBP 25 Mio.						183 939,45	0,00		
EUR/JPY 1 900 Mio.						107 494,10	0,00		
EUR/USD 1 021,7 Mio.						439 997,86	0,01		
Geschlossene Positionen									
EUR/USD 4,2 Mio.						5 080,62	0,00		
Swaps								31 914 448,09	0,50
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsswaps									
12M CPTFE Inflation / 0.8377% 21/05/2024 (OTC) (DB)	Stück	130 000 000				- 2 907 684,00	- 0,05		
12M CPTFE Inflation / 0.96455% 21/05/2029 (OTC) (DB)	Stück	267 000 000				- 8 881 034,10	- 0,14		
12M CPTFE Inflation / 1.0931% 21/05/2034 (OTC) (DB)	Stück	250 000 000				- 11 479 050,00	- 0,18		
12M CPTFE Inflation / 1.10695% 30/04/2023 (OTC) (DB)	Stück	300 000 000				- 6 681 390,00	- 0,10		
12M CPTFE Inflation / 1.1092% 23/06/2023 (OTC) (DB)	Stück	122 000 000				- 2 919 935,80	- 0,05		
12M CPTFE Inflation / 1.1114% 15/05/2023 (OTC) (DB)	Stück	320 000 000				- 7 463 456,00	- 0,12		
12M CPTFE Inflation / 1.11725% 23/06/2028 (OTC) (DB)	Stück	40 000 000				- 1 354 912,00	- 0,02		
12M CPTFE Inflation / 1.123% 16/04/2023 (OTC) (BR)	Stück	50 000 000				- 1 256 040,00	- 0,02		
12M CPTFE Inflation / 1.16675% 08/03/2030 (OTC) (DB)	Stück	350 000 000				- 13 152 685,00	- 0,21		
12M CPTFE Inflation / 1.2476% 30/04/2038 (OTC) (DB)	Stück	75 000 000				- 4 368 007,50	- 0,07		
12M CPTFE Inflation / 1.25175% 15/05/2038 (OTC) (DB)	Stück	28 000 000				- 1 660 612,80	- 0,03		
12M CPTFE Inflation / 1.25235% 23/06/2038 (OTC) (DB)	Stück	65 000 000				- 3 880 708,00	- 0,06		
12M CPTFE Inflation / 1.261% 08/03/2026 (OTC) (DB)	Stück	100 000 000				- 2 908 570,00	- 0,05		
12M CPTFE Inflation / 1.261% 14/03/2026 (OTC) (DB)	Stück	100 000 000				- 2 908 750,00	- 0,05		
12M CPTFE Inflation / 1.26815% 17/02/2026 (OTC) (DB)	Stück	100 000 000				- 2 960 260,00	- 0,05		
12M CPTFE Inflation / 1.26815% 27/02/2026 (OTC) (DB)	Stück	50 000 000				- 1 480 260,00	- 0,03		
12M CPTFE Inflation / 1.26975% 23/01/2026 (OTC) (DB)	Stück	70 000 000				- 1 999 879,00	- 0,03		
12M CPTFE Inflation / 1.29% 19/05/2038 (OTC) (BR)	Stück	50 000 000				- 3 803 070,00	- 0,06		
12M CPTFE Inflation / 1.2977% 08/03/2040 (OTC) (DB)	Stück	86 000 000				- 5 247 444,80	- 0,08		
12M CPTFE Inflation / 1.32095% 08/03/2036 (OTC) (DB)	Stück	50 000 000				- 2 833 535,00	- 0,04		
12M CPTFE Inflation / 1.32445% 27/02/2036 (OTC) (DB)	Stück	100 000 000				- 5 734 570,00	- 0,09		
12M CPTFE Inflation / 1.35335% 23/05/2048 (OTC) (DB)	Stück	23 000 000				- 1 694 456,00	- 0,03		
12M CPTFE Inflation / 1.388% 08/03/2050 (OTC) (DB)	Stück	47 000 000				- 3 371 700,10	- 0,05		
12M CPTFE Inflation / 1.41295% 16/05/2048 (OTC) (DB)	Stück	85 000 000				- 5 566 820,00	- 0,09		

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
12M CPTFE Inflation / 1.41455% 08/03/2060 (OTC) (DB) . . .	Stück	8 000 000				- 745 376,00	- 0,01
3M Euribor / 2.532% 26/03/2064 (OTC) (HS)	Stück	79 000 000				98 366 984,41	1,54
6M Euribor / 0.2268% 12/09/2039 (OTC) (DB)	Stück	237 000 000				7 453 270,80	0,12
6M Euribor / 0.401% 29/06/2026 (OTC) (DB)	Stück	2 500 000				- 109 864,25	0,00
6M Euribor / 0.506% 12/09/2034 (OTC) (DB)	Stück	495 000 000				8 201 358,00	0,13
6M Euribor / 0.64% 12/09/2059 (OTC) (DB)	Stück	267 000 000				27 050 624,40	0,42
6M Euribor / 0.6453% 27/08/2049 (OTC) (DB)	Stück	500 000				29 392,05	0,00
6M Euribor / 0.681% 12/09/2044 (OTC) (DB)	Stück	585 000 000				28 877 589,00	0,45
6M Euribor / 0.7227% 10/09/2049 (OTC) (DB)	Stück	241 000 000				18 722 205,50	0,29
6M Euribor / 1.027% 12/11/2024 (OTC) (DB)	Stück	5 000 000				- 306 886,00	- 0,01
6M Euribor / 1.676% 21/11/2022 (OTC) (DB)	Stück	495 000 000				- 24 411 519,00	- 0,38
6M Euribor / 1.878% 26/03/2024 (OTC) (HS)	Stück	550 000 000				- 47 027 750,00	- 0,74
6M Euribor / 2.246% 03/03/2022 (OTC) (DB)	Stück	105 000 000				- 4 663 354,50	- 0,07
Inflation Swaps							
HICP inflation Europe 01/2026 (DB)	Stück	70 000 000				- 214 197,20	0,00
HICP inflation Europe 02/2026 (DB)	Stück	100 000 000				- 306 017,00	0,00
HICP inflation Europe 02/2026 (DB)	Stück	50 000 000				- 153 008,50	0,00
HICP inflation Europe 02/2036 (DB)	Stück	100 000 000				- 350 350,00	- 0,01
HICP inflation Europe 03/2026 (DB)	Stück	100 000 000				- 306 033,00	0,00
HICP inflation Europe 03/2026 (DB)	Stück	100 000 000				- 306 032,00	0,00
HICP inflation Europe 03/2030 (DB)	Stück	350 000 000				- 5 177 361,00	- 0,08
HICP inflation Europe 03/2036 (DB)	Stück	50 000 000				- 175 085,50	0,00
HICP inflation Europe 03/2040 (DB)	Stück	86 000 000				- 1 093 927,74	- 0,02
HICP inflation Europe 03/2050 (DB)	Stück	47 000 000				- 739 718,90	- 0,01
HICP inflation Europe 03/2060 (DB)	Stück	8 000 000				- 155 010,08	0,00
HICP inflation Europe 04/2023 (DB)	Stück	300 000 000				- 2 970 951,00	- 0,05
HICP inflation Europe 04/2038 (DB)	Stück	75 000 000				- 641 491,50	- 0,01
HICP inflation Europe 05/2023 (DB)	Stück	320 000 000				- 3 169 504,00	- 0,05
HICP inflation Europe 05/2024 (BC)	Stück	130 000 000				- 597 808,90	- 0,01
HICP inflation Europe 05/2029 (BC)	Stück	267 000 000				- 1 571 551,32	- 0,02
HICP inflation Europe 05/2034 (BC)	Stück	250 000 000				- 1 819 277,50	- 0,03
HICP inflation Europe 05/2038 (DB)	Stück	28 000 000				- 239 404,20	0,00
HICP inflation Europe 05/2048 (DB)	Stück	23 000 000				- 234 829,31	0,00
HICP inflation Europe 06/2023 (DB)	Stück	122 000 000				- 1 208 838,22	- 0,02
HICP inflation Europe 06/2028 (DB)	Stück	40 000 000				- 532 596,80	- 0,01
HICP inflation Europe 06/2038 (DB)	Stück	65 000 000				- 554 194,55	- 0,01
Credit Default Swaps							
Protection Buyer							
iTraxx Europe / 1% / 20/06/2025 (OTC) (BR)	Stück	3 600 000 000				59 924 952,00	0,94
iTraxx Europe / 1% / 20/06/2030 (OTC) (BR)	Stück	2 400 000 000				- 10 415 160,00	- 0,16
Bankguthaben						321 766 097,75	5,04
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR-Guthaben	EUR					288 072 066,21	4,51
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen							
Tschechische Kronen	CZK	256 455				24 264,01	0,00
Britisches Pfund	GBP	1 672 872				1 840 361,12	0,03
Ungarischer Forint	HUF	45 634 230				128 750,21	0,00
Polnischer Zloty	PLN	12 940				2 912,48	0,00
Neuer Rumänischer Leu	RON	51 822				10 707,63	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Australischer Dollar	AUD	30 386				18 626,56	0,00
Brasilianischer Real	BRL	2 827				458,43	0,00
Kanadischer Dollar	CAD	2 411 975				1 576 732,37	0,02
Hongkong Dollar	HKD	86				9,92	0,00
Japanischer Yen	JPY	8 920				73,61	0,00
Mexikanischer Peso	MXN	1 488 674				57 361,22	0,00
Malaysischer Ringgit	MYR	67 613				14 048,94	0,00
Neuer Peruanischer Sol	PEN	225 597				56 812,53	0,00
Russischer Rubel	RUB	235 108				2 937,78	0,00
Türkische Lira	TRY	13 240				1 719,68	0,00
US-Dollar	USD	33 465 107				29 814 121,87	0,47
Südafrikanischer Rand	ZAR	2 812 720				144 133,18	0,00
Termingelder							
Sonstige Vermögensgegenstände							
Zinsansprüche						58 780 015,56	0,92
Sonstige Ansprüche						1 860 812,53	0,03
Summe der Vermögensgegenstände ***						6 720 799 237,27	105,23
Kurzfristige Verbindlichkeiten							
EUR-Kredite	EUR					- 51 973 739,46	- 0,81
						- 51 973 739,46	- 0,81

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Sonstige Verbindlichkeiten		- 61 917 863,23	- 0,97
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen		- 5 249 607,62	- 0,08
Andere sonstige Verbindlichkeiten		- 56 668 255,61	- 0,89
Summe der Verbindlichkeiten		- 333 943 747,66	- 5,23
Fondsvermögen		6 386 855 489,61	100,00

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

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Währung	Anteilwert in der jeweiligen Währung
Anteilwert		
Klasse A	EUR	10,01
Umlaufende Anteile		
Klasse A	Stück	638 186 931,000

Zusammensetzung des Referenzportfolios (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

Zusammenstellung aus inflationsbereinigten und normalen Zero-Coupon Anleihen mit Laufzeiten zwischen 1 und 50 Jahren

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

kleinster potenzieller Risikobetrag	%	105,673
größter potenzieller Risikobetrag	%	178,995
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	%	139,543

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 1.1.2020 bis 30.6.2020 auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99% Konfidenzniveau, 10 Tage Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraumes von einem Jahr berechnet. Als Bewertungsmaßstab wird das Risiko eines derivativefreien Vergleichsvermögens herangezogen. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigsten Entwicklung von Marktpreisen für das Fondsvermögen ergibt. Bei der Ermittlung des Marktrisiko potenzials wendet die Gesellschaft den **relativen Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an.

Die durchschnittliche Hebelwirkung aus der Nutzung von Derivaten betrug im Berichtszeitraum 2,5, wobei zur Berechnung die Summe der Nominalbeträge der Derivate in Relation zum Fondsvermögen gesetzt wurde (Nominalwertmethode).

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure gem. Punkt 40 a) der „Leitlinien zu börsengehandelten Indexfonds und anderen OGAW-Themen“ der European Securities and Markets Authority (ESMA) belief sich zum Berichtsstichtag unter Zugrundelegung einer Bruttobetragung auf EUR 15 931 990 454,68.

Gesamtbetrag der in Zusammenhang mit Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten	EUR	2 528 192,33
davon:		
Bankguthaben	EUR	2 528 192,33

Marktschlüssel

Terminbörsen

DB = Deutsche Bank AG
MS = Morgan Stanley & Co. International

Vertragspartner der Derivate (mit Ausnahme von Devisentermingeschäften)

BC = Barclays Capital
BR = Barclays Bank PLC
DB = Deutsche Bank AG
HS = HSBC

Vertragspartner der Devisentermingeschäfte

Barclays Bank Ireland PLC, BNP Paribas SA, HSBC France Paris und J.P. Morgan AG

Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen

Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:

Wertpapierbezeichnung	Währung bzw. Nominal in Stück	Nominalbetrag bzw. Bestand	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR unbefristet	gesamt
2,125 % Aeroports de Paris 2018/2038	EUR	1 600 000	1 710 216,00	
1,375 % Air Liquide Finance SA 2020/2030	EUR	100 000	109 379,50	
1,375 % Apple Inc 2017/2029	EUR	100 000	110 101,00	
3,15 % AT&T Inc 2017/2036	EUR	1 500 000	1 700 385,00	
1,625 % BASF SE 2017/2037	EUR	2 000 000	2 221 060,00	
1,5 % BMW Finance NV (MTN) 2019/2029	EUR	103 000	108 271,54	
0,01 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2019/2050	EUR	1 000 000	999 180,00	
1,625 % Coca-Cola Co/The 2015/2035	EUR	3 900 000	4 294 173,00	
1,125 % Cooperatieve Rabobank UA 2019/2031	EUR	500 000	522 915,00	
1,75 % Credit Agricole SA/London (MTN) 2019/2029	EUR	2 000 000	2 154 330,00	
2,125 % Daimler AG 2017/2037	EUR	12 200 000	12 741 375,00	
1,125 % Daimler AG 2019/2034	EUR	100 000	92 614,00	
1,35 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2039	EUR	2 300 000	2 195 787,00	
0,35 % E.ON SE (MTN) 2019/2030	EUR	4 200 000	4 070 955,00	
1,7 % Eli Lilly & Co. 2019/2049	EUR	7 600 000	7 916 464,00	

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Währung bzw. Nominal in Stück	Nominalbetrag bzw. Bestand	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR unbefristet	gesamt
0,75 % Enexis Holding NV (MTN) 2019/2031	EUR	8 500 000	8 715 687,50	
1,375 % Engie SA 2019/2039	EUR	600 000	609 849,00	
0,625 % Eni SpA (MTN) 2020/2030	EUR	12 000 000	11 728 260,00	
1 % Eni SpA 2019/2034	EUR	5 650 000	5 609 602,50	
2 % Eni SpA 2020/2031	EUR	1 500 000	1 655 617,50	
1,625 % Equinor ASA 2015/2035	EUR	7 300 000	8 058 616,00	
1,75 % Exor NV 2019/2034	EUR	10 000 000	9 216 800,00	
2,02 % Heineken NV 2017/2032	EUR	700 000	775 967,50	
2,125 % Illinois Tool Works Inc 2015/2030	EUR	1 500 000	1 701 007,50	
2,5 % ING Groep NV (MTN) 2018/2030	EUR	6 900 000	8 177 845,50	
1,047 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2032 *	EUR	18 600 000	18 662 682,00	
1,625 % Klepierre SA 2017/2032	EUR	5 000 000	4 990 075,00	
1 % La Poste SA 2019/2034	EUR	1 000 000	1 003 525,00	
0,55 % Linde Finance BV 2020/2032	EUR	3 600 000	3 618 126,00	
1,375 % Merck & Co Inc 2016/2036	EUR	500 000	545 790,00	
2,625 % Microsoft Corp 2013/2033	EUR	5 300 000	6 800 085,50	
1,25 % Nestle Finance International Ltd 2017/2029	EUR	200 000	220 165,00	
1 % OMV AG 2019/2034	EUR	500 000	489 912,50	
1,375 % Orange SA (MTN) 2019/2049	EUR	3 100 000	2 975 504,00	
1,125 % PepsiCo Inc 2019/2031	EUR	3 400 000	3 600 787,00	
0,875 % PepsiCo Inc 2019/2039	EUR	2 500 000	2 464 575,00	
0,875 % Pernod Ricard SA 2019/2031	EUR	100 000	99 116,50	
1,5 % Prologis Euro Finance LLC 2019/2049	EUR	13 900 000	13 303 759,50	
1,5 % Republic of Austria Government Bond 2016/2086	EUR	420 000	640 481,10	
1,125 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR (MTN) 2019/2049	EUR	1 500 000	1 490 032,50	
1,875 % Sanofi 2018/2038	EUR	16 200 000	19 282 617,00	
1,5 % Statkraft AS 2015/2030	EUR	2 500 000	2 714 225,00	
1,25 % Suez SA 2020/2035	EUR	1 400 000	1 424 087,00	
0,875 % Telenor ASA 2020/2035	EUR	1 500 000	1 476 352,50	
3,5 % Telia Co AB 2013/2033	EUR	5 800 000	7 324 559,00	
1,5 % TenneT Holding BV (MTN) 2019/2039	EUR	5 700 000	6 182 932,50	
1,875 % TenneT Holding BV 2016/2036	EUR	1 600 000	1 845 024,00	
1,994 % Total Capital International SA (MTN) 2020/2032	EUR	3 200 000	3 611 312,00	
2 % Unibail-Rodamco-Westfield SE 2017/2037	EUR	3 000 000	2 906 700,00	
0,8 % Veolia Environnement SA 2020/2032	EUR	1 200 000	1 200 594,00	
1,5 % Verizon Communications Inc 2019/2039	EUR	362 000	353 903,87	
2,75 % Vonovia Finance BV 2018/2038	EUR	500 000	579 287,50	
5,625 % Codelco Inc 2005/2035	USD	300 000	329 224,05	
4,5 % Colombia Government International Bond 2018/2029	USD	200 000	196 244,49	
5,35 % Indonesia Government International Bond 2018/2049	USD	1 000 000	1 157 708,02	
2,75 % MDC-GMTN BV -Reg- (MTN) 2016/2023	USD	500 000	461 129,40	
5,5 % Morocco Government International Bond 2012/2042	USD	1 800 000	1 963 733,20	
4,175 % Pertamina Persero PT 2020/2050	USD	200 000	176 573,03	
3,65 % Pertamina Persero PT -Reg- (MTN) 2019/2029	USD	2 000 000	1 869 657,70	
6,25 % Perusahaan Listrik Negara PT -Reg- 2018/2049	USD	2 000 000	2 251 453,44	
4,5 % Petronas Capital Ltd -Reg- (MTN) 2015/2045	USD	1 000 000	1 105 306,47	
4,4 % Qatar Government International Bond -Reg- 2020/2050	USD	500 000	553 679,37	
3,5 % Saudi Arabian Oil Co. -Reg- (MTN) 2019/2029	USD	1 000 000	964 470,44	
4,25 % Saudi Arabian Oil Co. -Reg- 2019/2039	USD	1 000 000	997 751,83	
3,5 % State Grid Overseas Investment 2016 Ltd -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	4 400 000	4 340 526,70	
7,625 % Uruguay Government International Bond 2006/2036	USD	550 000	743 994,77	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen			224 114 122,91	224 114 122,91

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

Barclays Capital Securities Limited, BNP Paribas Arbitrage SNC, Citigroup Global Markets, Deutsche Bank AG FI, Goldman Sachs Int., Morgan Stanley Europe SE FI, Morgan Stanley Intl. FI, Nomura International PLC, UBS AG London Branch, Unicredit Bank AG, Zuercher Kantonalbank

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten

	EUR	256 755 149,08
davon:		
Schuldverschreibungen	EUR	209 493 023,07
Aktien	EUR	47 262 126,01

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 30.6.2020

Australischer Dollar	AUD	1,631300	= EUR	1
Brasilianischer Real	BRL	6,166992	= USD	1
Kanadischer Dollar	CAD	1,529730	= JPY	1
Tschechische Kronen	CZK	26,642523	= JPY	1
Britisches Pfund	GBP	0,908991	= USD	1
Hongkong Dollar	HKD	8,704918	= USD	1
Ungarischer Forint	HUF	354,440037	= USD	1
Japanischer Yen	JPY	121,171041	= USD	1
Mexikanischer Peso	MXN	25,952628	= USD	1
Malaysischer Ringgit	MYR	4,812698	= USD	1
Neuer Peruanischer Sol.	PEN	3,970897	= USD	1
Polnischer Zloty	PLN	4,442788	= USD	1
Neuer Rumänischer Leu	RON	4,839766	= USD	1
Russischer Rubel	RUB	80,029382	= USD	1
Türkische Lira	TRY	7,698913	= USD	1
US-Dollar	USD	1,123150	= USD	1
Südafrikanischer Rand	ZAR	19,514732	= USD	1

Erläuterungen zur Bewertung

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

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

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

Fußnoten

- * Variabler Zinssatz
- ** Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise verliehen.
- *** Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

DB ADVISORS NL ENHANCED FIXED INCOME STRATEGY

Wertentwicklung im Überblick

ISIN	6 Monate
LU0799651202	11,9%

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

Stand: 30.6.2020

Angaben auf Euro-Basis

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensübersicht zum 30.6.2020

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen (Emittenten)		
Unternehmen	215 932 356,82	49,11
Zentralregierungen	125 244 069,14	28,46
Summe Anleihen	341 176 425,96	77,57
2. Investmentanteile		
Rentenfonds	22 430 643,28	5,10
Sonstige Fonds	15 680 478,06	3,57
Summe Investmentanteile	38 111 121,34	8,67
3. Derivate	70 511 309,16	16,05
4. Bankguthaben	5 637 319,65	1,29
5. Sonstige Vermögensgegenstände	4 135 017,38	0,94
II. Verbindlichkeiten		
1. Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-19 254 797,10	-4,39
2. Sonstige Verbindlichkeiten	-583 969,15	-0,13
III. Fondsvermögen	439 732 427,24	100,00

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

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensaufstellung zum 30.6.2020

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						319 566 563,74	72,66
Verzinsliche Wertpapiere							
0,5 % AbbVie, Inc. -Reg- 2020/2021	EUR	370 000	370 000		100,015	370 053,65	0,08
7,125 % ABN AMRO Bank NV (MTN) 2012/2022	EUR	280 000			112,824	315 905,80	0,07
0,25 % ABN AMRO Bank NV (MTN) 2018/2021	EUR	830 000			100,359	832 975,55	0,19
0,6 % ABN AMRO Bank NV (MTN) 2020/2027	EUR	600 000	600 000		98,764	592 581,00	0,13
1,5 % Adecco International Financial Services BV (MTN) 2015/2022	EUR	14 000			102,565	14 359,03	0,00
2,125 % Aeroports de Paris (MTN) 2020/2026	EUR	500 000	500 000		107,503	537 515,00	0,12
2,75 % Aeroports de Paris (MTN) 2020/2030	EUR	400 000	400 000		113,634	454 536,00	0,10
1,5 % Aeroports de Paris 2020/2032	EUR	500 000	500 000		100,199	500 995,00	0,11
0,5 % Air Products and Chemicals Inc (MTN) 2020/2028	EUR	280 000	280 000		100,632	281 769,60	0,06
0,8 % Air Products and Chemicals Inc 2020/2032	EUR	180 000	180 000		100,728	181 309,50	0,04
1,125 % Akelius Residential Property AB (MTN) 2017/2024	EUR	350 000			99,493	348 223,75	0,08
1,75 % Akelius Residential Property AB (MTN) 2017/2025	EUR	430 000			101,161	434 990,15	0,10
1,125 % Albemarle New Holding GmbH (MTN) 2019/2025	EUR	310 000			98,399	305 035,35	0,07
1,625 % Albemarle New Holding GmbH (MTN) 2019/2028	EUR	580 000			95,715	555 144,10	0,13
1 % Alliander NV 2018/perpetual *	EUR	665 000			102,384	680 850,28	0,15
1 % Allianz Finance II BV (MTN) 2011/2041 *	EUR	300 000			104,680	314 038,50	0,07
1 % Allianz SE 2015/2045 *	EUR	200 000			104,326	208 651,00	0,05
2,2 % Altria Group Inc (MTN) 2019/2027	EUR	285 000			105,360	300 276,00	0,07
1 % Altria Group, Inc. 2019/2023	EUR	640 000			100,967	646 185,60	0,15
1 % America Movil SAB de CV 2013/2073 *	EUR	130 000			112,954	146 840,20	0,03
0,55 % American Honda Finance Corp. (MTN) 2018/2023	EUR	400 000			100,126	400 502,00	0,09
1,95 % American Honda Finance Corp. 2020/2024	EUR	200 000	200 000		105,562	211 124,00	0,05
1,875 % American International Group, Inc. (MTN) 2017/2027	EUR	410 000			105,309	431 766,90	0,10
3,25 % Anglo American Capital PLC (MTN) 2014/2023	EUR	280 000			105,635	295 776,60	0,07
2,125 % Anheuser Busch Inbev SA (MTN) 2020/2027	EUR	280 000	280 000		108,383	303 471,00	0,07
1,65 % Anheuser-Busch InBev SA/NV 2019/2031	EUR	600 000			103,271	619 623,00	0,14
3,7 % Anheuser-Busch InBev SA/NV 2020/2040	EUR	430 000	430 000		121,430	522 146,85	0,12
2 % APT Pipelines Ltd (MTN) 2020/2030	EUR	150 000	150 000		105,378	158 066,25	0,04
1 % Arkema SA (MTN) 2019/perpetual *	EUR	300 000			100,423	301 269,00	0,07
1 % Arkema SA 2020/perpetual *	EUR	700 000	700 000		94,399	660 793,00	0,15
1 % ASR Nederland NV 2019/2049 *	EUR	350 000			104,131	364 456,75	0,08
2,4 % AT&T Inc (MTN) 2014/2024	EUR	400 000			105,933	423 732,00	0,10
3,15 % AT&T Inc 2017/2036	EUR	260 000			113,359	294 733,40	0,07
2,05 % AT&T Inc 2020/2032	EUR	240 000	240 000		104,161	249 986,40	0,06
0,25 % AT&T, Inc. (MTN) 2019/2026	EUR	760 000			96,461	733 099,80	0,17
1,8 % AT&T, Inc. 2019/2039	EUR	380 000			93,908	356 850,40	0,08
3,15 % Austria Government Bond 2012/2044	EUR	1 150 000		130 000	168,868	1 941 976,25	0,44
0,625 % Aviva PLC (MTN) 2016/2023	EUR	310 000			101,182	313 664,20	0,07
1 % AXA SA 2014/2049 *	EUR	650 000			109,296	710 420,75	0,16
1 % Bank of America Corp (MTN) 2020/2029 *	EUR	340 000	340 000		119,793	407 294,50	0,09
0,75 % Bank of America Corp. (MTN) 2016/2023	EUR	690 000			101,143	697 886,70	0,16
2,625 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2014/2024	EUR	400 000			109,246	436 982,00	0,10
3 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2015/2025	EUR	300 000			109,340	328 020,00	0,07
3 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2016/2024	EUR	450 000			107,218	482 478,75	0,11
0,5 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2018/2022	EUR	300 000			100,996	302 986,50	0,07
0,75 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2019/2026	EUR	700 000			102,524	717 668,00	0,16
1,25 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2020/2030	EUR	300 000	300 000		102,968	308 904,00	0,07
1 % Barclays PLC (MTN) 2019/2025	EUR	460 000			97,967	450 645,90	0,10
1 % Barclays PLC (MTN) 2020/2025 *	EUR	390 000	780 000	390 000	107,552	419 452,80	0,10
0,25 % BASF SE (MTN) 2020/2027	EUR	900 000	900 000		100,469	904 221,00	0,21
1,125 % BAT Capital Corp (MTN) 2017/2023	EUR	240 000			101,104	242 648,40	0,05
3,625 % BAT International Finance PLC (MTN) 2011/2021	EUR	300 000			103,970	311 908,50	0,07
2,25 % BAT International Finance PLC 2017/2030	EUR	250 000			103,668	259 170,00	0,06
2,375 % BAT Netherlands Finance BV (MTN) 2020/2024	EUR	360 000	360 000		105,793	380 854,80	0,09
2,125 % Bayer Capital Corp BV 2018/2029	EUR	400 000	400 000		111,487	445 946,00	0,10
1,5 % Bayer Capital Corp. BV (MTN) 2018/2026	EUR	400 000			105,282	421 128,00	0,10
0,625 % Bayer Capital Corp. BV 2018/2022	EUR	300 000			100,981	302 943,00	0,07
0,75 % Belfius Bank SA (MTN) 2017/2022	EUR	300 000			100,502	301 506,00	0,07
0,01 % Belfius Bank SA (MTN) 2019/2026	EUR	500 000			96,947	484 732,50	0,11
4,25 % Belgium Government Bond 2010/2041	EUR	2 180 000	640 000	620 000	175,985	3 836 462,10	0,87
1 % BHP Billiton Finance Ltd 2015/2076 *	EUR	911 000	300 000		102,042	929 602,62	0,21
0,5 % Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl (MTN) 2019/2023	EUR	760 000			98,887	751 541,20	0,17
0,375 % BMW Finance NV (MTN) 2019/2027	EUR	650 000			98,069	637 445,25	0,14
0,125 % BMW Finance NV 2019/2022	EUR	690 000			99,778	688 468,20	0,16
1 % BNP Paribas Cardif SA (MTN) 2017/2024	EUR	400 000			99,371	397 482,00	0,09
1 % BNP Paribas SA (MTN) 2016/2026 *	EUR	590 000			100,981	595 787,90	0,14
1,625 % BNP Paribas SA (MTN) 2019/2031	EUR	700 000			99,462	696 230,50	0,16
1 % BNP Paribas SA (MTN) 2020/2028 *	EUR	800 000	800 000		97,418	779 344,00	0,18

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1 % BNP Paribas SA (MTN) 2020/2029 *	EUR	500 000	500 000		%	101,227	506 135,00	0,11
0,5 % BNZ International Funding Ltd/London (MTN) 2017/2023	EUR	380 000			%	100,742	382 819,60	0,09
2,972 % BP Capital Markets PLC 2014/2026	EUR	300 000			%	112,174	336 520,50	0,08
1 % BP Capital Markets PLC 2016/perpetual *	EUR	660 000	660 000		%	100,712	664 699,20	0,15
2,519 % BP Capital Markets PLC 2016/2028	EUR	680 000	680 000		%	110,200	749 360,00	0,17
1 % BP Capital Markets PLC 2020/perpetual *	EUR	740 000	740 000		%	100,623	744 610,20	0,17
1 % BPCE SA (MTN) 2016/2026 *	EUR	300 000			%	101,820	305 458,50	0,07
0,625 % BPCE SA (MTN) 2018/2023	EUR	700 000			%	101,608	711 256,00	0,16
1,375 % BPCE SA (MTN) 2018/2026	EUR	400 000			%	103,527	414 106,00	0,09
0,5 % BPCE SA (MTN) 2019/2027	EUR	500 000			%	98,225	491 125,00	0,11
4,25 % Bundesrepublik Deutschland 2007/2039	EUR	3 675 000	770 000		%	186,318	6 847 186,50	1,56
4 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2005/2037	EUR	5 450 000	640 000	140 000	%	171,985	9 373 155,25	2,13
4,75 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2008/2040	EUR	2 970 000			%	200,762	5 962 616,55	1,36
4,75 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2008/2040	EUR	1 100 000	650 000	60 000	%	200,762	2 208 376,50	0,50
3,25 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2010/2042	EUR	3 875 000	760 000		%	175,916	6 816 725,63	1,55
2,5 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2012/2044	EUR	5 660 000	220 000	590 000	%	163,159	9 234 799,40	2,10
2,5 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2014/2046	EUR	6 060 000	450 000	570 000	%	167,256	10 135 713,60	2,30
1,25 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2017/2048	EUR	4 470 000	890 000	10 000	%	135,809	6 070 662,30	1,38
0,01 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2019/2050	EUR	1 595 000	525 000		%	99,918	1 593 692,10	0,36
0,75 % Cadent Finance PLC (MTN) 2020/2032	EUR	290 000	290 000		%	97,964	284 094,15	0,06
1,625 % Capgemini SE (MTN) 2020/2026	EUR	300 000	300 000		%	104,991	314 971,50	0,07
2,375 % Capgemini SE 2020/2032	EUR	400 000	400 000		%	110,049	440 196,00	0,10
0,625 % Carlsberg Breweries A/S (MTN) 2020/2030	EUR	220 000	220 000		%	98,763	217 277,50	0,05
1 % Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd (MTN) 2017/2024	EUR	700 000			%	99,442	696 090,50	0,16
0,875 % Chorus Ltd (MTN) 2019/2026	EUR	486 000			%	100,679	489 299,94	0,11
0,875 % Chubb INA Holdings, Inc. (MTN) 2019/2027	EUR	640 000			%	100,995	646 368,00	0,15
2,375 % Citigroup Inc (MTN) 2014/2024	EUR	640 000			%	107,541	688 262,40	0,16
0,75 % Citigroup, Inc. (MTN) 2016/2023	EUR	410 000			%	101,373	415 629,30	0,09
1 % Citigroup, Inc. (MTN) 2020/2026 *	EUR	360 000	360 000		%	102,322	368 359,20	0,08
1,125 % CK Hutchison Group Telecom Finance SA (MTN) 2019/2028	EUR	420 000	420 000		%	98,720	414 621,90	0,09
0,375 % CK Hutchison Group Telecom Finance SA 2019/2023	EUR	750 000	750 000		%	99,162	743 711,25	0,17
1 % CNP Assurances 2011/2041 *	EUR	300 000			%	106,969	320 907,00	0,07
1,871 % CNRC Capital Ltd (MTN) 2016/2021	EUR	675 000			%	100,324	677 183,63	0,15
0,75 % Coca-Cola European Partners PLC (MTN) 2016/2022	EUR	320 000			%	100,928	322 969,60	0,07
1,75 % Coca-Cola European Partners PLC (MTN) 2020/2026	EUR	160 000	160 000		%	106,254	170 005,60	0,04
0,5 % Commerzbank AG (MTN) 2018/2023	EUR	720 000			%	100,175	721 256,40	0,16
1,5 % Commerzbank AG (MTN) 2018/2028	EUR	310 000			%	105,450	326 895,00	0,07
0,5 % Commerzbank AG (MTN) 2019/2026	EUR	180 000		410 000	%	98,627	177 527,70	0,04
0,75 % Cooperatieve Rabobank UA (MTN) 2018/2023	EUR	400 000			%	101,384	405 534,00	0,09
1 % Cooperatieve Rabobank UA 2014/2026 *	EUR	590 000			%	101,146	596 761,40	0,14
0,875 % Covestro AG (MTN) 2020/2026	EUR	210 000	210 000		%	99,789	209 555,85	0,05
1,375 % Covestro AG (MTN) 2020/2030	EUR	220 000	220 000		%	99,611	219 144,20	0,05
1 % Credit Agricole Assurances SA 2015/2049 *	EUR	200 000	200 000		%	107,838	215 675,00	0,05
1 % Credit Agricole SA (MTN) 2020/2026 *	EUR	500 000	500 000		%	101,006	505 030,00	0,11
1 % Credit Agricole SA (MTN) 2020/2030 *	EUR	400 000	400 000		%	100,590	402 360,00	0,09
2,375 % Credit Agricole SA/London (MTN) 2016/2024	EUR	500 000			%	109,092	545 457,50	0,12
1,375 % Credit Agricole SA/London (MTN) 2017/2027	EUR	300 000			%	108,088	324 264,00	0,07
1,75 % Credit Agricole SA/London (MTN) 2019/2029	EUR	600 000	300 000		%	107,717	646 299,00	0,15
1,25 % Credit Mutuel Arkea SA (MTN) 2017/2024	EUR	500 000			%	102,264	511 320,00	0,12
1 % Credit Mutuel Arkea SA (MTN) 2020/2029 *	EUR	400 000	400 000		%	100,031	400 124,00	0,09
1 % Crédit Suisse Group AG (MTN) 2019/2027 *	EUR	700 000			%	100,213	701 491,00	0,16
0,65 % Credit Suisse Group AG (MTN) 2019/2029	EUR	360 000			%	97,330	350 388,00	0,08
1 % Credit Suisse Group AG (MTN) 2020/2026 *	EUR	120 000	120 000		%	110,893	133 071,60	0,03
2,7 % Croatia Government International Bond (MTN) 2018/2028	EUR	750 000	150 000		%	111,590	836 925,00	0,19
1,4 % Daimler AG (MTN) 2016/2024	EUR	310 000			%	101,672	315 183,20	0,07
2,125 % Daimler AG 2017/2037	EUR	290 000			%	104,438	302 868,75	0,07
0,875 % Daimler International Finance BV (MTN) 2018/2024	EUR	440 000			%	99,718	438 757,00	0,10
1 % Daimler International Finance BV (MTN) 2018/2025	EUR	740 000			%	99,217	734 202,10	0,17
0,25 % Daimler International Finance BV (MTN) 2019/2023	EUR	640 000			%	97,605	624 672,00	0,14
2,1 % Danaher Corp (MTN) 2020/2026	EUR	430 000	430 000		%	108,396	466 102,80	0,11
0,125 % Dassault Systemes (MTN) 2019/2026	EUR	500 000			%	99,131	495 655,00	0,11
0,375 % Deutsche Bahn Finance GMBH (MTN) 2020/2029	EUR	400 000	400 000		%	99,971	399 884,00	0,09
0,875 % Deutsche Bahn Finance GmbH 2020/2039	EUR	430 000	430 000		%	97,300	418 387,85	0,10
1 % Deutsche Boerse AG 2020/2047 *	EUR	200 000	200 000		%	99,957	199 914,00	0,05
0,625 % Deutsche Pfandbriefbank AG (MTN) 2018/2022	EUR	500 000			%	99,010	495 050,00	0,11

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
0,75 % Deutsche Post AG (MTN) 2020/2029	EUR	880 000	880 000		%	102,572	902 633,60	0,21
0,45 % DH Europe Finance II Sarl (MTN) 2019/2028	EUR	130 000			%	97,800	127 140,00	0,03
0,45 % DH Europe Finance II Sarl (MTN) 2019/2028	EUR	460 000			%	97,800	449 880,00	0,10
0,75 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2031	EUR	410 000			%	96,461	395 490,10	0,09
1,8 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2049	EUR	290 000			%	96,040	278 516,00	0,06
0,625 % Digital Dutch Finco BV (MTN) 2020/2025	EUR	340 000	340 000		%	98,880	336 192,00	0,08
1,5 % Digital Dutch Finco BV (MTN) 2020/2030	EUR	200 000	200 000		%	102,367	204 734,00	0,05
0,125 % Digital Dutch Finco BV 2020/2022	EUR	140 000	140 000		%	98,870	138 417,30	0,03
1 % DNB Bank ASA (MTN) 2017/2027 *	EUR	420 000			%	100,007	420 029,40	0,10
0,5 % Dow Chemical Co./The (MTN) 2020/2027	EUR	220 000	660 000	440 000	%	94,780	208 514,90	0,05
2,25 % DS Smith PLC (MTN) 2015/2022	EUR	400 000			%	102,607	410 426,00	0,09
1,75 % DXC Technology Co. (MTN) 2018/2026	EUR	290 000			%	98,627	286 016,85	0,06
0,25 % E.ON SE (MTN) 2019/2026	EUR	700 000			%	99,373	695 607,50	0,16
0,875 % E.ON SE (MTN) 2020/2031	EUR	510 000	510 000		%	100,934	514 763,40	0,12
2 % Electricite de France SA (MTN) 2018/2030	EUR	600 000			%	110,649	663 894,00	0,15
2 % Electricite de France SA 2019/2049	EUR	400 000	700 000	800 000	%	97,980	391 920,00	0,09
0,375 % Elenia Finance Oyj (MTN) 2020/2027	EUR	650 000	650 000		%	99,628	647 582,00	0,15
1,7 % Eli Lilly & Co. 2019/2049	EUR	450 000		300 000	%	104,164	468 738,00	0,11
1 % Elia System Operator SA/NV 2018/perpetual *	EUR	500 000			%	101,819	509 092,50	0,12
1 % EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG (MTN) 2014/2076 *	EUR	410 000			%	101,482	416 074,15	0,09
1 % EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG 2019/2079 *	EUR	500 000			%	97,575	487 872,50	0,11
1 % EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG 2019/2079 *	EUR	300 000			%	97,440	292 318,50	0,07
0,625 % Enxsis Holding NV (MTN) 2020/2032	EUR	340 000	340 000		%	101,475	345 015,00	0,08
1 % Engie SA (MTN) 2016/2026	EUR	500 000			%	104,074	520 367,50	0,12
1,375 % Engie SA (MTN) 2020/2025	EUR	500 000	500 000		%	105,262	526 310,00	0,12
1,75 % Engie SA (MTN) 2020/2028	EUR	400 000	400 000		%	108,275	433 098,00	0,10
1 % Engie SA 2018/perpetual *	EUR	200 000			%	97,607	195 214,00	0,04
1,659 % EP Infrastructure AS (MTN) 2018/2024	EUR	390 000			%	100,519	392 024,10	0,09
1,698 % EP Infrastructure AS (MTN) 2019/2026	EUR	370 000			%	98,750	365 373,15	0,08
1,375 % Equinor ASA (MTN) 2020/2032	EUR	480 000	480 000		%	106,408	510 756,00	0,12
0,375 % Erste Group Bank AG (MTN) 2019/2024	EUR	300 000			%	100,566	301 698,00	0,07
0,875 % Erste Group Bank AG (MTN) 2019/2026	EUR	400 000			%	101,254	405 016,00	0,09
0,875 % Erste Group Bank AG (MTN) 2020/2027	EUR	400 000	400 000		%	102,919	411 674,00	0,09
0,375 % EssilorLuxottica SA (MTN) 2020/2026	EUR	600 000	600 000		%	100,095	600 570,00	0,14
0,5 % EssilorLuxottica SA (MTN) 2020/2028	EUR	600 000	600 000		%	99,718	598 305,00	0,14
0,625 % Essity AB (MTN) 2017/2022	EUR	340 000			%	100,759	342 578,90	0,08
0,5 % Euroclear Bank SA/NV (MTN) 2018/2023	EUR	360 000			%	101,426	365 131,80	0,08
1,5 % Eurogrid GmbH (MTN) 2016/2028	EUR	500 000			%	108,195	540 972,50	0,12
1,113 % Eurogrid GmbH (MTN) 2020/2032	EUR	400 000	400 000		%	105,359	421 436,00	0,10
1,125 % Eutelsat SA (MTN) 2016/2021	EUR	200 000			%	100,180	200 359,00	0,05
1,75 % Exor NV 2019/2034	EUR	560 000			%	92,168	516 140,80	0,12
0,835 % Exxon Mobil Corp 2020/2032	EUR	1 260 000	1 260 000		%	98,470	1 240 722,00	0,28
1,408 % Exxon Mobil Corp 2020/2039	EUR	1 250 000	1 250 000		%	98,893	1 236 156,25	0,28
1,125 % Fastighets AB Balder (MTN) 2017/2022	EUR	400 000			%	99,905	399 620,00	0,09
1,125 % Fastighets AB Balder (MTN) 2019/2027	EUR	890 000			%	94,121	837 676,90	0,19
0,75 % Fidelity National Information Services Inc 2019/2023	EUR	260 000			%	100,756	261 965,60	0,06
2 % Fidelity National Information Services Inc 2019/2030	EUR	350 000			%	107,083	374 788,75	0,09
1,5 % Fidelity National Information Services, Inc. (MTN) 2019/2027	EUR	340 000			%	103,435	351 677,30	0,08
0,125 % Fidelity National Information Services, Inc. 2019/2021	EUR	220 000			%	99,723	219 389,50	0,05
2,625 % Finland Government Bond 2012/2042	EUR	970 000	290 000		%	154,585	1 499 469,65	0,34
1,375 % Finland Government Bond 2017/2047	EUR	790 000	405 000	135 000	%	130,845	1 033 675,50	0,23
0,125 % Finland Government Bond 2020/2036	EUR	630 000	630 000		%	101,100	636 926,85	0,14
1 % Fresenius Medical Care AG & Co KGaA (MTN) 2016/2026	EUR	740 000	740 000		%	101,677	752 409,80	0,17
1,5 % Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 2016/2030	EUR	670 000	670 000		%	103,302	692 120,05	0,16
1,625 % Fresenius SE & Co KGaA 2016/2027	EUR	500 000	500 000		%	105,156	525 780,00	0,12
1,5 % G4S International Finance PLC (MTN) 2017/2024	EUR	280 000			%	97,580	273 224,00	0,06
1,875 % G4S International Finance PLC (MTN) 2018/2025	EUR	360 000			%	97,461	350 857,80	0,08
3,6 % Gazprom OAO Via Gaz Capital SA (MTN) 2014/2021	EUR	250 000			%	102,152	255 380,00	0,06
2,5 % Gazprom OAO Via Gaz Capital SA (MTN) 2018/2026	EUR	600 000			%	102,910	617 460,00	0,14
3,125 % Gazprom OAO Via Gaz Capital SA -Reg- (MTN) 2016/2023	EUR	300 000			%	104,554	313 660,50	0,07
1 % General Motors Financial Co., Inc. (MTN) 2017/2021 *	EUR	330 000			%	98,342	324 528,60	0,07
1,5 % Glencore Finance Europe Ltd (MTN) 2019/2026	EUR	380 000			%	98,284	373 479,20	0,08
1,25 % Glencore Finance Europe SA (MTN) 2015/2021	EUR	260 000			%	100,079	260 204,10	0,06
4,75 % Goldman Sachs Group Inc/The 2006/2021	EUR	330 000			%	105,299	347 486,70	0,08
1,375 % Goldman Sachs Group, Inc. (MTN) 2017/2024	EUR	440 000			%	101,964	448 639,40	0,10
3,375 % Goldman Sachs Group, Inc./The (MTN) 2020/2025	EUR	460 000	460 000		%	111,663	513 649,80	0,12
0,875 % Goldman Sachs Group, Inc./The (MTN) 2020/2030	EUR	680 000	680 000		%	98,129	667 273,80	0,15
1,375 % Goodman Australia Finance Pty Ltd -Reg- (MTN) 2017/2025	EUR	340 000			%	100,033	340 110,50	0,08

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1 % Groupama SA 2014/2049 *	EUR	500 000	200 000		%	110,597	552 985,00	0,13
2,25 % HeidelbergCement AG (MTN) 2016/2023	EUR	350 000			%	103,680	362 878,25	0,08
1,125 % HeidelbergCement Finance Luxembourg SA (MTN) 2019/2027	EUR	270 000			%	98,831	266 842,35	0,06
2,125 % Heimstaden Bostad AB (MTN) 2019/2023	EUR	155 000			%	102,414	158 740,93	0,04
1,125 % Heimstaden Bostad AB (MTN) 2020/2026	EUR	310 000	310 000		%	97,411	301 974,10	0,07
2,25 % Heineken NV (MTN) 2020/2030	EUR	160 000	160 000		%	113,244	181 190,40	0,04
1,75 % Heineken NV (MTN) 2020/2040	EUR	560 000	1 120 000	560 000	%	100,440	562 464,00	0,13
2,375 % Holcim Finance Luxembourg SA (MTN) 2020/2025	EUR	350 000	350 000		%	107,509	376 279,75	0,09
0,6 % HSBC France SA (MTN) 2018/2023	EUR	700 000			%	101,481	710 363,50	0,16
1,5 % HSBC Holdings PLC (MTN) 2016/2022	EUR	290 000			%	102,306	296 685,95	0,07
1,375 % Hutchison Whampoa Finance 14 Ltd (MTN) 2014/2021	EUR	350 000			%	101,120	353 918,25	0,08
1,375 % Imperial Brands Finance PLC (MTN) 2016/2025	EUR	400 000			%	101,027	404 108,00	0,09
1 % ING Bank NV 2014/2026 *	EUR	330 000			%	101,686	335 562,15	0,08
0,75 % ING Groep NV (MTN) 2017/2022	EUR	400 000			%	100,881	403 524,00	0,09
1 % ING Groep NV (MTN) 2018/2023	EUR	200 000			%	102,199	204 397,00	0,05
1 % ING Groep NV (MTN) 2019/2025 *	EUR	500 000			%	97,900	489 500,00	0,11
1 % ING Groep NV (MTN) 2020/2031 *	EUR	600 000	600 000		%	102,533	615 195,00	0,14
1,5 % innogy Finance BV 2018/2029	EUR	440 000			%	107,260	471 944,00	0,11
0,875 % International Business Machines Corp (MTN) 2019/2025	EUR	330 000			%	102,547	338 405,10	0,08
1,2 % International Business Machines Corp. 2020/2040	EUR	880 000	880 000		%	95,820	843 211,60	0,19
1,8 % International Flavors & Fragrances, Inc. (MTN) 2018/2026	EUR	390 000			%	100,998	393 892,20	0,09
0,5 % International Flavors & Fragrances, Inc. 2018/2021	EUR	150 000			%	99,873	149 808,75	0,03
1 % JAB Holdings BV (MTN) 2019/2027	EUR	300 000			%	97,230	291 688,50	0,07
2,5 % JAB Holdings BV (MTN) 2020/2027	EUR	500 000	500 000		%	106,623	533 115,00	0,12
2,25 % JAB Holdings BV 2019/2039	EUR	700 000			%	98,628	690 396,00	0,16
0,625 % JPMorgan Chase & Co (MTN) 2016/2024	EUR	420 000			%	101,003	424 210,50	0,10
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2017/2028 *	EUR	410 000			%	105,787	433 724,65	0,10
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2032 *	EUR	610 000			%	100,337	612 055,70	0,14
1 % KBC Group NV 2017/2029 *	EUR	400 000			%	102,072	408 288,00	0,09
0,8 % Kellogg Co (MTN) 2017/2022	EUR	850 000			%	100,964	858 189,75	0,20
0,75 % Kering SA (MTN) 2020/2028	EUR	200 000	200 000		%	101,957	203 914,00	0,05
0,25 % Kering SA 2020/2023	EUR	300 000	550 000	250 000	%	100,571	301 711,50	0,07
3,75 % Kingdom of Belgium Government Bond 2013/2045	EUR	1 260 000	350 000	320 000	%	175,695	2 213 750,70	0,50
1,9 % Kingdom of Belgium Government Bond 2015/2038	EUR	1 090 000	480 000	550 000	%	127,798	1 392 998,20	0,32
1,6 % Kingdom of Belgium Government Bond 2016/2047	EUR	1 440 000	640 000	500 000	%	125,615	1 808 848,80	0,41
2,15 % Kingdom of Belgium Government Bond 2016/2066	EUR	860 000	380 000	190 000	%	156,652	1 347 207,20	0,31
1,45 % Kingdom of Belgium Government Bond 2017/2037	EUR	630 000	20 000		%	119,558	753 215,40	0,17
2,25 % Kingdom of Belgium Government Bond 2017/2057	EUR	680 000	200 000	140 000	%	151,939	1 033 185,20	0,23
1,7 % Kingdom of Belgium Government Bond 2019/2050	EUR	885 000	25 000	20 000	%	129,763	1 148 402,55	0,26
0,4 % Kingdom of Belgium Government Bond 2020/2040	EUR	810 000	810 000		%	99,879	809 015,85	0,18
1 % La Banque Postale SA (MTN) 2020/2026 *	EUR	500 000	500 000		%	98,999	494 992,50	0,11
2,125 % La Mondiale SAM 2020/2031	EUR	300 000	300 000		%	98,895	296 685,00	0,07
0,625 % La Poste SA (MTN) 2020/2026	EUR	300 000	300 000		%	101,842	305 526,00	0,07
1,375 % La Poste SA (MTN) 2020/2032	EUR	300 000	300 000		%	105,506	316 518,00	0,07
0,75 % LeasePlan Corp., NV (MTN) 2017/2022	EUR	600 000			%	98,825	592 947,00	0,13
0,5 % LG Chem Ltd -Reg- 2019/2023	EUR	260 000			%	98,708	256 639,50	0,06
0,25 % Linde Finance BV 2016/2027	EUR	800 000	800 000		%	100,729	805 832,00	0,18
0,55 % Linde Finance BV 2020/2032	EUR	700 000	700 000		%	100,504	703 524,50	0,16
0,375 % Lloyds Bank Corp.orate Markets PLC (MTN) 2020/2025	EUR	540 000	540 000		%	98,677	532 853,10	0,12
0,25 % Lloyds Bank PLC 2019/2022	EUR	380 000			%	99,370	377 604,10	0,09
1 % Lloyds Banking Group PLC (MTN) 2018/2024 *	EUR	400 000			%	99,503	398 010,00	0,09
1 % Lloyds Banking Group PLC (MTN) 2019/2025 *	EUR	480 000			%	97,945	470 136,00	0,11
1 % Lloyds Banking Group PLC (MTN) 2020/2026 *	EUR	330 000	330 000		%	111,034	366 412,20	0,08
0,5 % Logicor Financing Sarl (MTN) 2019/2021	EUR	290 000			%	99,512	288 583,35	0,07
1,625 % Logicor Financing Sarl (MTN) 2019/2027	EUR	870 000			%	100,789	876 859,95	0,20
0,125 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE (MTN) 2020/2028	EUR	700 000	700 000		%	98,238	687 662,50	0,16
1,125 % Medtronic Global Holdings SCA (MTN) 2019/2027	EUR	240 000			%	104,494	250 785,60	0,06
1,75 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2049	EUR	290 000			%	97,658	283 208,20	0,06
1 % Merck KGaA 2014/2074 *	EUR	590 000			%	100,602	593 548,85	0,13
1 % Merck KGaA 2019/2079 *	EUR	400 000			%	104,581	418 324,00	0,10
0,872 % Mitsubishi UFJ Financial Group Inc (MTN) 2016/2024	EUR	430 000			%	101,514	436 508,05	0,10
1 % Morgan Stanley (MTN) 2016/2022	EUR	690 000			%	101,231	698 493,90	0,16
1,375 % Morgan Stanley (MTN) 2016/2026	EUR	420 000			%	104,697	439 727,40	0,10
1 % Morgan Stanley (MTN) 2019/2024 *	EUR	660 000			%	100,162	661 065,90	0,15
1,5 % Morocco Government International Bond -Reg- 2019/2031	EUR	290 000			%	93,430	270 947,00	0,06
1 % Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 2018/2049 *	EUR	500 000			%	114,343	571 715,00	0,13

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
2,25 % Mylan NV (MTN) 2016/2024	EUR	364 000			%	104,867	381 715,88	0,09
1 % National Grid North America, Inc. (MTN) 2017/2024	EUR	500 000			%	102,905	514 525,00	0,12
1 % Nationwide Building Society (MTN) 2017/2029 *	EUR	320 000			%	100,181	320 577,60	0,07
1,125 % Natwest Markets PLC (MTN) 2018/2023	EUR	330 000			%	100,617	332 036,10	0,08
1,125 % Nestle Finance International Ltd (MTN) 2020/2026	EUR	190 000	190 000		%	105,738	200 902,20	0,05
1,5 % Nestle Finance International Ltd (MTN) 2020/2030	EUR	150 000	150 000		%	110,520	165 779,25	0,04
0,375 % Nestle Finance International Ltd 2016/2032	EUR	590 000	590 000		%	98,708	582 374,25	0,13
4 % Netherlands Government Bond 2005/2037	EUR	3 040 000		650 000	%	168,866	5 133 511,20	1,17
3,75 % Netherlands Government Bond 2010/2042	EUR	3 000 000		740 000	%	182,061	5 461 815,00	1,24
2,75 % Netherlands Government Bond 2014/2047	EUR	3 110 000		475 000	%	172,446	5 363 055,05	1,22
0,5 % Netherlands Government Bond 2019/2040	EUR	1 705 000	355 000		%	110,544	1 884 775,20	0,43
0,25 % New York Life Global Funding (MTN) 2020/2027	EUR	690 000	690 000		%	99,340	685 442,55	0,16
1 % NN Group NV 2017/2048 *	EUR	590 000			%	113,950	672 302,05	0,15
1,125 % Norsk Hydro ASA (MTN) 2019/2025	EUR	380 000			%	96,595	367 061,00	0,08
2 % Norsk Hydro ASA (MTN) 2019/2029	EUR	300 000			%	91,214	273 642,00	0,06
1,5 % OMV AG (MTN) 2020/2024	EUR	450 000	450 000		%	104,711	471 199,50	0,11
2,375 % OMV AG (MTN) 2020/2032	EUR	550 000	550 000		%	114,791	631 347,75	0,14
0,5 % OP Corporate Bank plc (MTN) 2020/2025	EUR	770 000	1 540 000	770 000	%	101,362	780 487,40	0,18
1 % Optus Finance Pty Ltd (MTN) 2019/2029	EUR	400 000			%	101,490	405 958,00	0,09
1,375 % Orange SA (MTN) 2018/2028	EUR	500 000			%	106,504	532 520,00	0,12
1 % Orange SA (MTN) 2019/perpetual *	EUR	200 000			%	101,535	203 070,00	0,05
1,625 % Orange SA (MTN) 2020/2032	EUR	200 000	200 000		%	108,578	217 156,00	0,05
0,5 % PepsiCo, Inc. (MTN) 2020/2028	EUR	450 000	450 000		%	100,832	453 744,00	0,10
0,5 % Pernod Ricard SA (MTN) 2019/2027	EUR	200 000			%	99,886	199 772,00	0,05
2,875 % Perusahaan Listrik Negara PT -Reg- (MTN) 2018/2025	EUR	200 000			%	104,524	209 048,00	0,05
0,625 % Philip Morris International Inc (MTN) 2017/2024	EUR	730 000			%	100,537	733 916,45	0,17
0,5 % POSCO -Reg- 2020/2024	EUR	400 000	545 000	145 000	%	96,890	387 560,00	0,09
1 % Postnl NV (MTN) 2017/2024	EUR	200 000			%	100,679	201 358,00	0,05
0,75 % PSA Banque France SA (MTN) 2018/2023	EUR	400 000			%	98,077	392 308,00	0,09
0,375 % Raiffeisen Bank International AG (MTN) 2019/2026	EUR	500 000		200 000	%	99,359	496 795,00	0,11
0,625 % RCI Banque SA (MTN) 2016/2021	EUR	740 000			%	98,387	728 063,80	0,17
0,75 % RCI Banque SA (MTN) 2017/2022	EUR	550 000			%	98,473	541 598,75	0,12
0,75 % RCI Banque SA (MTN) 2017/2022	EUR	330 000			%	97,633	322 188,90	0,07
0,25 % RCI Banque SA (MTN) 2018/2021	EUR	400 000			%	98,570	394 278,00	0,09
0,01 % RELX Finance BV 2020/2024	EUR	300 000	300 000		%	98,731	296 191,50	0,07
0,875 % Rentokil Initial PLC (MTN) 2019/2026	EUR	610 000			%	99,529	607 123,85	0,14
2,1 % Republic of Austria Government Bond (MTN) 2017/2117	EUR	981 000	51 000	160 000	%	195,924	1 922 014,44	0,44
4,15 % Republic of Austria Government Bond 2007/2037	EUR	2 325 000	40 000	305 000	%	167,970	3 905 290,88	0,89
3,8 % Republic of Austria Government Bond 2012/2062	EUR	680 000		30 000	%	229,533	1 560 824,40	0,35
1,5 % Republic of Austria Government Bond 2016/2047	EUR	1 280 000			%	131,377	1 681 619,20	0,38
1,5 % Republic of Austria Government Bond 2016/2086	EUR	440 000		30 000	%	152,496	670 980,20	0,15
0,75 % Republic of Austria Government Bond 2020/2051	EUR	360 000	360 000		%	112,038	403 335,00	0,09
1,625 % Richemont International Holding SA 2020/2040	EUR	530 000	530 000		%	102,650	544 045,00	0,12
2,875 % Romanian Government International Bond 2016/2028	EUR	450 000			%	104,425	469 912,50	0,11
2 % Royal Schiphol Group NV (MTN) 2020/2029	EUR	360 000	360 000		%	110,724	398 606,40	0,09
1,625 % RTE Réseau de Transport d'Electricite SA (MTN) 2015/2025	EUR	700 000			%	107,438	752 062,50	0,17
1,125 % Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB (MTN) 2019/2026	EUR	340 000			%	94,784	322 263,90	0,07
1 % Sanofi (MTN) 2020/2025	EUR	200 000	200 000		%	104,471	208 941,00	0,05
0,75 % Santander Consumer Bank AG (MTN) 2017/2022	EUR	400 000			%	100,223	400 892,00	0,09
0,25 % Santander Consumer Bank AG (MTN) 2019/2024	EUR	500 000			%	98,320	491 597,50	0,11
0,875 % Santander Consumer Bank AS (MTN) 2019/2022	EUR	200 000			%	100,659	201 318,00	0,05
0,125 % Santander Consumer Bank AS (MTN) 2020/2025	EUR	900 000	900 000		%	96,153	865 377,00	0,20
0,375 % SAP SE (MTN) 2020/2029	EUR	800 000	800 000		%	100,225	801 796,00	0,18
1,625 % SAP SE 2018/2031	EUR	300 000			%	112,225	336 673,50	0,08
1,375 % Schlumberger Finance BV (MTN) 2020/2026	EUR	330 000	330 000		%	102,309	337 618,05	0,08
2 % Schlumberger Finance BV 2020/2032	EUR	290 000	290 000		%	106,956	310 172,40	0,07
0,5 % Shell International Finance BV (MTN) 2019/2031	EUR	710 000			%	96,207	683 069,70	0,16
0,875 % Shell International Finance BV (MTN) 2019/2039	EUR	490 000			%	92,373	452 625,25	0,10
0,25 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2020/2024	EUR	400 000	400 000		%	100,569	402 274,00	0,09
0,375 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2020/2026	EUR	300 000	300 000		%	100,674	302 022,00	0,07
0,25 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2020/2029	EUR	600 000	600 000		%	98,747	592 479,00	0,13
2,375 % Signify NV (MTN) 2020/2027	EUR	180 000	180 000		%	102,628	184 730,40	0,04
2 % Signify NV 2020/2024	EUR	290 000	290 000		%	101,246	293 613,40	0,07
1,5 % Sky Ltd (MTN) 2014/2021	EUR	380 000			%	101,574	385 979,30	0,09
0,5 % Société Générale SA (MTN) 2017/2023	EUR	200 000			%	99,373	198 746,00	0,05
2,125 % Societe Generale SA (MTN) 2018/2028	EUR	600 000			%	107,468	644 808,00	0,15
1 % Societe Generale SA (MTN) 2018/2028 *	EUR	400 000			%	99,644	398 574,00	0,09
1,25 % Société Générale SA (MTN) 2019/2024	EUR	400 000			%	101,389	405 556,00	0,09
0,125 % Societe Generale SA (MTN) 2020/2026	EUR	1 000 000	1 000 000		%	98,875	988 745,00	0,22
1,25 % Societe Generale SA (MTN) 2020/2030	EUR	600 000	600 000		%	99,983	599 895,00	0,14
1 % Standard Chartered PLC (MTN) 2019/2027 *	EUR	260 000			%	99,520	258 752,00	0,06

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1 % Standard Chartered PLC (MTN) 2020/2030 *	EUR	370 000	370 000		%	101,627	376 019,90	0,09
1,375 % State Grid Overseas Investment 2016 Ltd -Reg- (MTN) 2018/2025	EUR	960 000			%	102,160	980 736,00	0,22
0,875 % Stedin Holding NV (MTN) 2016/2025	EUR	295 000		445 000	%	103,669	305 823,55	0,07
1,125 % Stryker Corp. (MTN) 2018/2023	EUR	960 000			%	102,633	985 276,80	0,22
0,25 % Stryker Corp. (MTN) 2019/2024	EUR	430 000			%	98,969	425 566,70	0,10
0,75 % Stryker Corp. (MTN) 2019/2029	EUR	560 000			%	98,527	551 748,40	0,13
1 % Svenska Handelsbanken AB (MTN) 2018/2028 *	EUR	830 000			%	101,293	840 731,90	0,19
0,05 % Svenska Handelsbanken AB (MTN) 2019/2026	EUR	830 000			%	97,838	812 055,40	0,18
1 % Svenska Handelsbanken AB (MTN) 2020/2025	EUR	180 000	180 000		%	104,247	187 643,70	0,04
1 % Swiss Re Finance Luxembourg SA 2019/2050 *	EUR	300 000			%	105,341	316 023,00	0,07
2,25 % Takeda Pharmaceutical Co Ltd (MTN) 2018/2026	EUR	400 000			%	109,844	439 374,00	0,10
1,125 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd -Reg- 2018/2022	EUR	680 000			%	101,832	692 457,60	0,16
3 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd -Reg- 2018/2030	EUR	390 000			%	117,552	458 450,85	0,10
1,125 % Tele2 AB (MTN) 2018/2024	EUR	600 000			%	103,016	618 093,00	0,14
2,125 % Tele2 AB (MTN) 2018/2028	EUR	615 000	345 000		%	108,900	669 731,93	0,15
1,5 % TenneT Holding BV (MTN) 2019/2039	EUR	200 000		230 000	%	108,473	216 945,00	0,05
1,5 % Thermo Fisher Scientific Inc 2019/2039	EUR	320 000			%	98,295	314 542,40	0,07
0,125 % Thermo Fisher Scientific, Inc. (MTN) 2019/2025	EUR	310 000			%	98,669	305 873,90	0,07
2,375 % Thermo Fisher Scientific, Inc. 2020/2032	EUR	190 000	190 000		%	114,149	216 882,15	0,05
0,696 % Total Capital International SA (MTN) 2019/2028	EUR	700 000			%	101,604	711 224,50	0,16
1,994 % Total Capital International SA (MTN) 2020/2032	EUR	200 000	200 000		%	112,854	225 707,00	0,05
1 % Total SA (MTN) 2019/perpetual *	EUR	750 000			%	98,969	742 263,75	0,17
1 % TOTAL SA 2015/perpetual *	EUR	430 000			%	102,417	440 390,95	0,10
3 % Transurban Finance Co., Pty Ltd (MTN) 2020/2030	EUR	470 000	470 000		%	110,137	517 643,90	0,12
0,25 % UBS AG/London 2018/2022	EUR	510 000			%	100,351	511 790,10	0,12
1,5 % UBS Group AG (MTN) 2016/2024	EUR	520 000			%	103,427	537 817,80	0,12
1 % UBS Group Funding Switzerland AG (MTN) 2018/2025 *	EUR	490 000	490 000		%	102,667	503 068,30	0,11
1 % Unibail-Rodamco SE 2018/perpetual *	EUR	100 000		100 000	%	87,690	87 690,00	0,02
1 % UNIQA Insurance Group AG (MTN) 2013/2043 *	EUR	300 000			%	112,150	336 450,00	0,08
1,25 % Veolia Environnement SA (MTN) 2020/2028	EUR	200 000	400 000	200 000	%	105,185	210 369,00	0,05
1,3 % Verizon Communications Inc 2020/2033	EUR	950 000	950 000		%	101,914	968 178,25	0,22
1,85 % Verizon Communications Inc 2020/2040	EUR	770 000	770 000		%	102,372	788 260,55	0,18
0,875 % Verizon Communications, Inc. (MTN) 2019/2027	EUR	150 000			%	101,380	152 070,00	0,03
0,875 % Verizon Communications, Inc. (MTN) 2019/2027	EUR	640 000			%	101,380	648 832,00	0,15
1,125 % Vicinity Centres Trust (MTN) 2019/2029	EUR	500 000			%	92,898	464 487,50	0,11
1 % Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe 2013/2043 *	EUR	300 000			%	111,299	333 897,00	0,08
1,125 % Vodafone Group PLC (MTN) 2017/2025	EUR	440 000			%	103,614	455 899,40	0,10
2,5 % Vodafone Group PLC (MTN) 2019/2039	EUR	350 000	350 000		%	110,559	386 956,50	0,09
0,875 % Volkswagen Financial Services AG (MTN) 2018/2023	EUR	340 000			%	99,363	337 834,20	0,08
3 % Volkswagen Financial Services AG (MTN) 2020/2025	EUR	810 000	810 000		%	107,043	867 048,30	0,20
3,375 % Volkswagen Financial Services AG (MTN) 2020/2028	EUR	490 000	490 000		%	111,914	548 376,15	0,12
1 % Volkswagen International Finance NV 2014/2049 *	EUR	190 000			%	101,003	191 905,70	0,04
1 % Volkswagen International Finance NV 2014/2049 *	EUR	230 000			%	104,553	240 471,90	0,05
1 % Volkswagen International Finance NV 2017/perpetual *	EUR	300 000			%	99,965	299 895,00	0,07
1 % Volkswagen International Finance NV 2018/perpetual *	EUR	300 000			%	104,174	312 520,50	0,07
1 % Volkswagen International Finance NV 2020/perpetual *	EUR	700 000	700 000		%	99,144	694 004,50	0,16
2,375 % Volkswagen Leasing GmbH (MTN) 2012/2022	EUR	400 000			%	102,898	411 592,00	0,09
1,625 % Vonovia Finance BV 2019/2039	EUR	500 000			%	98,748	493 740,00	0,11
2 % Wells Fargo & Co. (MTN) 2015/2026	EUR	390 000			%	107,077	417 598,35	0,09
0,5 % Wells Fargo & Co. (MTN) 2019/2024	EUR	660 000			%	99,447	656 346,90	0,15
0,84 % Wintershall Dea Finance BV (MTN) 2019/2025	EUR	600 000			%	95,109	570 651,00	0,13
0,452 % Wintershall Dea Finance BV 2019/2023	EUR	600 000			%	96,834	581 004,00	0,13
0,75 % Wurth Finance International BV 2016/2027	EUR	590 000	590 000		%	102,953	607 422,70	0,14
1,414 % Zimmer Biomet Holdings, Inc. (MTN) 2016/2022	EUR	270 000			%	100,361	270 973,35	0,06
1,164 % Zimmer Biomet Holdings, Inc. (MTN) 2019/2027	EUR	530 000			%	97,708	517 852,40	0,12
1 % ABN AMRO Bank NV 2017/2028 *	USD	200 000			%	104,030	185 246,85	0,04
4,6 % Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC -Reg- 2017/2047	USD	200 000			%	119,313	212 460,48	0,05
3,125 % Abu Dhabi Government International Bond (MTN) 2017/2027	USD	600 000	200 000		%	109,000	582 290,86	0,13
2,5 % Abu Dhabi Government International Bond -Reg- (MTN) 2019/2029	USD	200 000	200 000		%	105,163	187 263,49	0,04
4,125 % Abu Dhabi Government International Bond -Reg- 2017/2047	USD	400 000	200 000		%	121,981	434 424,60	0,10
6 % Aeropuerto Internacional de Tocumen SA -Reg- 2018/2048	USD	199 116		884	%	109,646	194 384,20	0,04
3,5 % Air Lease Corp 2018/2022	USD	207 000			%	101,063	186 261,50	0,04
3,4 % Alibaba Group Holding Ltd (MTN) 2017/2027	USD	300 000			%	111,167	296 933,78	0,07
5,45 % Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 2019/2039	USD	130 000			%	126,861	146 836,39	0,03
4,25 % Arizona Public Service Co. 2019/perpetual	USD	300 000			%	119,654	319 602,89	0,07

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
3,6 % AT&T Inc (MTN) 2016/2023	USD	200 000			107,412	191 269,30	0,04
4,85 % AT&T Inc 2019/2039	USD	200 000		150 000	120,765	215 047,02	0,05
5 % Banque Ouest Africaine de Developpement -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	500 000			104,696	466 079,76	0,11
4,7 % Banque Ouest Africaine de Developpement -Reg- 2019/2031	USD	500 000			101,156	450 320,51	0,10
1 % Barclays PLC (MTN) 2018/2024 *	USD	300 000			107,760	287 834,44	0,07
3,45 % Boston Scientific Corp (MTN) 2019/2024	USD	184 000			108,451	177 668,99	0,04
4 % Boston Scientific Corp. (MTN) 2019/2029	USD	113 000			114,506	115 204,22	0,03
2,52 % BP Capital Markets PLC (MTN) 2017/2022	USD	400 000			103,718	369 382,34	0,08
1 % BP Capital Markets PLC 2020/perpetual *	USD	230 000	230 000		101,693	208 248,14	0,05
1 % BP Capital Markets PLC 2020/perpetual *	USD	140 000	140 000		103,586	129 119,35	0,03
3,05 % Burlington Northern Santa Fe LLC 2020/2051	USD	300 000	300 000		109,390	292 186,18	0,07
2,375 % Campbell Soup Co (MTN) 2020/2030	USD	300 000	300 000		103,798	277 249,42	0,06
3,3 % Capital One Financial Corp (MTN) 2017/2024	USD	350 000			107,662	335 501,24	0,08
4,368 % Cardinal Health, Inc. 2017/2047	USD	200 000			111,020	197 693,92	0,04
2,85 % Caterpillar Financial Services Corp (MTN) 2019/2024	USD	140 000			108,128	134 780,79	0,03
3,25 % Caterpillar, Inc. 2019/2049	USD	180 000			111,282	178 344,90	0,04
3 % China Development Bank (MTN) 2016/2026	USD	600 000			108,622	580 268,87	0,13
2,625 % China Development Bank (MTN) 2017/2022	USD	300 000			102,435	273 608,59	0,06
3,375 % China Development Bank (MTN) 2017/2027	USD	450 000			109,377	438 228,63	0,10
4,125 % Cigna Corp (MTN) 2019/2025	USD	119 000			115,007	121 852,48	0,03
4,9 % Cigna Corp. 2019/2048	USD	128 000			132,034	150 473,07	0,03
8,125 % Citigroup Inc 2009/2039	USD	140 000			173,390	216 129,11	0,05
1 % Cloverie PLC for Swiss Re Corporate Solutions Ltd 2014/2044 *	USD	200 000			103,463	184 237,18	0,04
5,125 % CNAC HK Finbridge Co., Ltd (MTN) 2018/2028	USD	200 000			115,875	206 338,42	0,05
4,125 % CNAC HK Finbridge Co., Ltd 2018/2021	USD	300 000			101,381	270 793,30	0,06
2,625 % Colombia Government International Bond (MTN) 2013/2023	USD	800 000			101,716	724 501,60	0,16
3,875 % Colombia Government International Bond (MTN) 2017/2027	USD	400 000			105,482	375 664,86	0,09
4,5 % Colombia Government International Bond 2015/2026	USD	250 000			108,486	241 475,98	0,05
5 % Colombia Government International Bond 2015/2045	USD	1 000 000			113,680	1 012 148,84	0,23
4,875 % Comision Federal de Electricidad -Reg- 2013/2024	USD	350 000			105,615	329 119,65	0,07
4,75 % Corp Financiera de Desarrollo SA -Reg- (MTN) 2015/2025	USD	600 000			109,515	585 039,38	0,13
4,5 % Corp Nacional del Cobre de Chile (MTN) 2015/2025	USD	800 000			112,257	799 589,84	0,18
3,625 % Corp Nacional del Cobre de Chile -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	200 000			107,253	190 985,71	0,04
4,375 % Corp. Nacional del Cobre de Chile -Reg- 2019/2049	USD	200 000			113,920	202 858,03	0,05
3,8 % Crown Castle International Corp. (MTN) 2018/2028	USD	150 000			112,546	150 308,10	0,03
4,1 % CVS Health Corp (MTN) 2018/2025	USD	143 000			113,166	144 083,07	0,03
4,125 % Development Bank of Kazakhstan JSC (MTN) 2012/2022	USD	1 200 000			104,372	1 115 135,08	0,25
3,875 % Diageo Capital PLC 2013/2043	USD	200 000			120,754	215 027,37	0,05
2,85 % Dominion Energy Inc (MTN) 2016/2026	USD	160 000			107,503	153 145,22	0,03
4,205 % DowDuPont, Inc. (MTN) 2018/2023	USD	300 000			109,678	292 955,38	0,07
3,95 % Duke Energy Corp 2017/2047	USD	350 000			117,489	366 121,83	0,08
4,75 % DXC Technology Co (MTN) 2017/2027	USD	300 000			109,737	293 113,73	0,07
5,375 % Eastern and Southern African Trade and Development Bank (MTN) 2017/2022	USD	500 000			101,172	450 393,97	0,10
2,8 % Eastern Creation II Investment Holdings Ltd (MTN) 2019/2022	USD	200 000			101,686	181 071,98	0,04
4,65 % Eastman Chemical Co 2014/2044	USD	250 000			115,119	256 240,82	0,06
4,375 % Empresa Nacional del Petroleo -Reg- (MTN) 2014/2024	USD	300 000			107,413	286 905,12	0,07
5,2 % Energy Transfer LP (MTN) 2012/2022	USD	250 000			104,684	233 014,25	0,05
6,125 % Energy Transfer Operating LP 2015/2045	USD	253 000			105,023	236 574,08	0,05
7,3 % Eni USA Inc 1997/2027	USD	150 000			126,196	168 537,81	0,04
3,625 % Export-Import Bank of China/The (MTN) 2014/2024	USD	600 000			110,203	588 715,25	0,13
3,25 % Export-Import Bank of China/The (MTN) 2017/2027	USD	350 000			109,348	340 754,12	0,08
6,75 % General Electric Co 2002/2032	USD	200 000			121,758	216 815,68	0,05
5,4 % General Mills Inc 2010/2040	USD	200 000			136,649	243 330,80	0,06
5,15 % General Motors Co 2017/2038	USD	200 000			95,957	170 870,76	0,04
4,2 % General Motors Financial Co Inc 2018/2021	USD	200 000			102,572	182 651,05	0,04
6,75 % Goldman Sachs Group Inc/The 2007/2037	USD	200 000			145,754	259 544,43	0,06
3,9 % Home Depot Inc/The 2017/2047	USD	300 000			121,779	325 277,58	0,07
1 % HSBC Holdings PLC 2019/2030 *	USD	330 000			111,093	326 410,56	0,07
3,65 % ICBCIL Finance Co Ltd 2019/2022	USD	300 000			102,975	275 050,96	0,06
4,125 % Indonesia Government International Bond (MTN) 2015/2025	USD	600 000			108,832	581 394,34	0,13
3,85 % Indonesia Government International Bond (MTN) 2017/2027	USD	750 000			108,521	724 663,88	0,16

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
5,25 % Indonesia Government International Bond 2012/2042	USD	400 000			% 124,028	441 714,47	0,10
5,25 % Indonesia Government International Bond 2016/2047	USD	500 000			% 125,513	558 754,76	0,13
4,75 % Indonesia Government International Bond -Reg- 2015/2026	USD	300 000			% 112,834	301 385,19	0,07
4,1 % ING Groep NV (MTN) 2018/2023	USD	224 000			% 109,637	200 150,00	0,05
3 % International Business Machines Corp. (MTN) 2019/2024	USD	200 000			% 108,350	192 939,39	0,04
5,375 % KazMunayGas National Co., JSC -Reg- 2018/2030	USD	500 000			% 113,638	505 889,67	0,12
6,375 % KazMunayGas National Co., JSC -Reg- 2018/2048	USD	500 000	300 000		% 126,582	563 513,32	0,13
3,4 % Kellogg Co (MTN) 2017/2027	USD	200 000			% 112,399	200 150,00	0,05
3,15 % Kinder Morgan Inc (MTN) 2017/2023	USD	300 000			% 104,779	279 871,15	0,06
3,125 % Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd (MTN) 2017/2027	USD	300 000			% 109,136	291 507,36	0,07
3,625 % LG Chem Ltd -Reg- (MTN) 2019/2029	USD	200 000			% 108,996	194 089,83	0,04
4,55 % Lowe's Cos, Inc. 2019/2049	USD	308 000			% 126,067	345 712,53	0,08
3,55 % M&T Bank Corp (MTN) 2018/2023	USD	143 000			% 108,590	138 257,92	0,03
4 % Merck & Co., Inc. 2019/2049	USD	230 000			% 128,564	263 275,41	0,06
5,875 % MetLife Inc 2010/2041	USD	200 000			% 141,322	251 652,93	0,06
4,75 % Mexico Government International Bond 2012/2044	USD	400 000	400 000		% 105,641	376 231,12	0,09
4,6 % Mexico Government International Bond 2015/2046	USD	400 000			% 103,498	368 597,24	0,08
3,218 % Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2019/2022	USD	200 000			% 104,337	185 792,92	0,04
3,741 % Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. (MTN) 2019/2029	USD	190 000			% 114,038	192 914,14	0,04
4,2 % Molson Coors Brewing Co. 2016/2046	USD	300 000	300 000		% 97,465	260 333,85	0,06
3,125 % Morgan Stanley (MTN) 2018/2023	USD	300 000			% 106,070	283 318,86	0,06
4,35 % Morgan Stanley 2014/2026	USD	300 000			% 115,403	308 248,76	0,07
2,648 % Nomura Holdings, Inc. (MTN) 2020/2025	USD	330 000	660 000	330 000	% 104,377	306 676,82	0,07
3,625 % Omega Healthcare Investors Inc (MTN) 2019/2029	USD	350 000			% 98,049	305 542,78	0,07
5 % ONEOK Partners LP (MTN) 2013/2023	USD	200 000			% 108,174	192 625,36	0,04
9 % Orange SA 2002/2031 *	USD	200 000			% 163,277	290 748,05	0,07
9,375 % Panama Government International Bond 1999/2029	USD	200 000			% 152,106	270 856,07	0,06
6,7 % Panama Government International Bond 2006/2036	USD	300 000			% 144,306	385 448,50	0,09
3,875 % Panama Government International Bond 2016/2028	USD	550 000			% 112,611	551 447,03	0,13
4,5 % Panama Government International Bond 2018/2050	USD	350 000			% 123,050	383 452,78	0,09
2,4 % PayPal Holdings Inc (MTN) 2019/2024	USD	350 000			% 106,263	331 140,02	0,08
4,125 % Perusahaan Listrik Negara PT -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	400 000			% 106,223	378 302,09	0,09
6,15 % Perusahaan Listrik Negara PT -Reg- (MTN) 2018/2048	USD	550 000			% 124,753	610 905,69	0,14
8,75 % Peruvian Government International Bond 2003/2033	USD	350 000			% 167,220	521 096,90	0,12
5,625 % Peruvian Government International Bond 2010/2050	USD	300 000			% 158,180	422 506,78	0,10
4,75 % Petroleos del Peru SA -Reg- 2017/2032	USD	400 000			% 111,356	396 584,59	0,09
5,625 % Petroleos del Peru SA -Reg- 2017/2047	USD	400 000			% 117,560	418 677,81	0,10
6,5 % Petroleos Mexicanos -Reg- (MTN) 2018/2027	USD	900 000			% 90,399	724 383,19	0,16
4,55 % Petronas Capital Ltd -Reg- 2020/2050	USD	350 000	350 000		% 127,303	396 705,71	0,09
2,7 % Pfizer Inc 2020/2050	USD	250 000	250 000		% 103,853	231 163,46	0,05
9,5 % Philippine Government International Bond 2005/2030	USD	500 000	200 000		% 163,087	726 025,60	0,17
3,95 % Philippine Government International Bond 2015/2040	USD	600 000			% 116,425	621 954,39	0,14
2,6 % PNC Financial Services Group, Inc./The (MTN) 2019/2026	USD	190 000			% 108,518	183 577,01	0,04
4,35 % Prudential Financial, Inc. (MTN) 2019/2050	USD	250 000			% 120,169	267 482,07	0,06
3,25 % Qatar Government International Bond (MTN) 2016/2026	USD	700 000			% 108,729	677 647,22	0,15
4 % Qatar Government International Bond -Reg- (MTN) 2019/2029	USD	300 000	300 000		% 115,375	308 172,10	0,07
4,625 % Qatar Government International Bond -Reg- 2016/2046	USD	800 000	200 000		% 129,407	921 739,72	0,21
5,103 % Qatar Government International Bond -Reg- 2018/2048	USD	200 000	200 000		% 136,424	242 930,14	0,06
4,125 % Rio Tinto Finance USA PLC 2012/2042	USD	150 000			% 125,697	167 872,29	0,04
5 % Rogers Communications Inc 2014/2044	USD	200 000			% 130,737	232 803,27	0,05
5,125 % Romanian Government International Bond -Reg- 2018/2048	USD	200 000			% 118,500	211 013,66	0,05
1 % Royal Bank of Scotland Group PLC (MTN) 2017/2023 *	USD	300 000			% 103,849	277 385,91	0,06
4 % SABIC Capital II BV -Reg- (MTN) 2018/2023	USD	200 000			% 106,683	189 971,06	0,04
5,25 % Saudi Government International Bond 2019/2050	USD	800 000	600 000		% 128,938	918 402,68	0,21
4,5 % Saudi Government International Bond -Reg- 2018/2030	USD	300 000	300 000		% 117,982	315 136,88	0,07
3,2 % Shire Acquisitions Investments Ireland DAC (MTN) 2016/2026	USD	250 000			% 111,050	247 183,56	0,06

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
1 % Standard Chartered PLC (MTN) 2018/2023 *	USD	200 000			103,897	185 009,49	0,04
3,4 % Stanley Black & Decker, Inc. (MTN) 2019/2026	USD	111 000			112,763	111 442,26	0,03
4,375 % State Grid Overseas Investment 2013 Ltd 2013/2043	USD	200 000			128,982	229 679,23	0,05
3,75 % State Grid Overseas Investment 2016 Ltd (MTN) 2018/2023	USD	300 000			106,657	284 885,80	0,06
2,75 % Sumitomo Mitsui Financial Group Inc (MTN) 2020/2030	USD	320 000	320 000		106,066	302 196,97	0,07
4,5 % Synchrony Financial (MTN) 2015/2025	USD	200 000			106,319	189 323,26	0,04
2,35 % Target Corp. (MTN) 2020/2030	USD	250 000	250 000		107,073	238 332,31	0,05
3,975 % Tencent Holdings Ltd -Reg- (MTN) 2019/2029	USD	200 000			112,364	200 086,40	0,05
5 % TransCanada PipeLines Ltd 2013/2043	USD	200 000			120,286	214 194,63	0,05
3,25 % Union Pacific Corp 2020/2050	USD	350 000	350 000		109,891	342 446,24	0,08
2,75 % UnitedHealth Group Inc 2020/2040	USD	300 000	300 000		107,216	286 379,50	0,07
7,625 % Uruguay Government International Bond 2006/2036	USD	300 000			151,931	405 815,33	0,09
4,125 % Uruguay Government International Bond 2012/2045	USD	300 000			115,751	309 177,75	0,07
5,1 % Uruguay Government International Bond 2014/2050	USD	300 000			129,431	345 716,50	0,08
4,375 % Uruguay Government International Bond 2015/2027	USD	200 000			114,607	204 081,37	0,05
4,975 % Uruguay Government International Bond 2018/2055	USD	200 000			128,531	228 875,03	0,05
4,375 % Uruguay Government International Bond 2019/2031	USD	200 000			117,158	208 623,06	0,05
3,4 % Valero Energy Corp. (MTN) 2016/2026	USD	180 000			109,540	175 552,76	0,04
3,875 % Verizon Communications, Inc. (MTN) 2019/2029	USD	245 000			118,362	258 189,99	0,06
5,25 % Verizon Communications, Inc. 2017/2037	USD	200 000			134,037	238 679,68	0,05
6,025 % Vnesheconombank Via VEB Finance PLC -Reg- (MTN) 2012/2022	USD	600 000			107,152	572 418,63	0,13
5,942 % Vnesheconombank Via VEB Finance PLC -Reg- (MTN) 2013/2023	USD	300 000			111,230	297 100,56	0,07
6,8 % Vnesheconombank Via VEB Finance PLC -Reg- 2010/2025	USD	300 000			119,355	318 804,25	0,07
2,375 % Walmart Inc (MTN) 2019/2029	USD	350 000			109,168	340 191,92	0,08
3,5 % Walt Disney Co./The 2020/2040	USD	230 000	230 000		109,608	224 457,41	0,05
5,606 % Wells Fargo & Co 2014/2044	USD	200 000			138,131	245 970,53	0,06
3,55 % Zimmer Biomet Holdings, Inc. (MTN) 2015/2025	USD	200 000			108,726	193 608,82	0,04

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

20 717 291,27 **4,71**

Verzinsliche Wertpapiere

1,5 % JPMorgan Chase & Co. 2015/2022	EUR	390 000			103,036	401 838,45	0,09
3,25 % Logicor Financing (MTN) 2018/2028	EUR	225 000			109,332	245 997,00	0,06
1 % OMV AG 2015/2049 *	EUR	320 000	320 000		117,687	376 598,40	0,09
1 % Skandinaviska Enskilda Banken AB 2014/2026 *	EUR	400 000			100,923	403 690,00	0,09
1 % Stedin Holding NV 2014/2049 *	EUR	600 000			101,401	608 406,00	0,14
1,5 % Wells Fargo & Co. (MTN) 2015/2022	EUR	320 000			102,382	327 620,80	0,08
2,95 % AbbVie, Inc. -144A- (MTN) 2019/2026	USD	120 000			108,858	116 306,50	0,03
4,25 % AbbVie, Inc. -144A- 2019/2049	USD	150 000			121,757	162 610,47	0,04
2,3 % Adobe, Inc. (MTN) 2020/2030	USD	172 000	172 000		108,136	165 599,92	0,04
2,4 % American Honda Finance Corp. (MTN) 2019/2024	USD	360 000			105,174	337 110,01	0,08
3,15 % Amgen, Inc. 2020/2040	USD	400 000	400 000		107,790	383 885,48	0,09
3,45 % ANZ New Zealand Int'l Ltd/London (MTN) 2018/2028	USD	300 000			113,900	304 233,27	0,07
2,2 % Apple, Inc. (MTN) 2019/2029	USD	300 000			107,242	286 449,59	0,07
4,85 % AT&T Inc 2019/2045	USD	200 000			119,282	212 405,59	0,05
3,3 % Bank of Montreal (MTN) 2019/2024	USD	310 000			108,686	299 982,67	0,07
3,4 % Bank of Nova Scotia/The (MTN) 2019/2024	USD	270 000			108,482	260 785,76	0,06
3,75 % BB&T Corp. (MTN) 2018/2023	USD	300 000			109,590	292 722,34	0,07
1 % BHP Billiton Finance USA Ltd 2015/2075 *	USD	200 000			116,003	206 567,24	0,05
1 % BNP Paribas SA -Reg- 2020/2031 *	USD	200 000	400 000	200 000	105,460	187 793,61	0,04
4,5 % BPCE SA 2014/2025	USD	200 000			109,326	194 677,40	0,04
3,125 % Broadcom, Inc. -144A- 2019/2022	USD	300 000			104,246	278 447,31	0,06
4,2 % CBS Corp. (MTN) 2019/2029	USD	289 000			112,235	288 795,29	0,07
3,875 % Celulosa Arauco y Constitucion SA (MTN) 2018/2027	USD	200 000			102,356	182 265,94	0,04
5,5 % Celulosa Arauco y Constitucion SA 2018/2047	USD	200 000			103,180	183 732,35	0,04
5,9 % Cisco Systems Inc 2009/2039	USD	200 000			149,301	265 860,79	0,06
1 % Citigroup Inc 2020/2031 *	USD	380 000	380 000		103,957	351 720,86	0,08
5,625 % Codelco Inc 2005/2035	USD	400 000			123,256	438 965,40	0,10
4 % Colombia Government International Bond 2013/2024	USD	400 000			105,538	375 862,52	0,09
4,7 % Comcast Corp 2018/2048	USD	110 000			134,725	131 947,66	0,03
4,95 % Comcast Corp. 2018/2058	USD	120 000			142,661	152 422,21	0,03
3,9 % Commonwealth Bank of Australia 2017/2047	USD	170 000			122,416	185 288,11	0,04
3,35 % Commonwealth Bank of Australia -Reg- (MTN) 2019/2024	USD	260 000			109,755	254 073,95	0,06
2,625 % Cooperatieve Rabobank UA -144A- (MTN) 2019/2024	USD	280 000			106,320	265 053,48	0,06
5,625 % Corp Nacional del Cobre de Chile -Reg- 2013/2043	USD	200 000			130,228	231 898,07	0,05

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1,375 % Costco Wholesale Corp. (MTN) 2020/2027	USD	120 000	120 000		% 102,352	109 355,03	0,02	
4,6 % Cox Communications Inc 2017/2047	USD	170 000			% 126,482	191 443,65	0,04	
4,75 % CSX Corp 2011/2042	USD	200 000			% 128,061	228 038,96	0,05	
8,35 % Dell International LLC / EMC Corp 2016/2046	USD	150 000			% 133,544	178 351,31	0,04	
6,02 % Dell International LLC -144A- (MTN) 2016/2026	USD	150 000			% 114,732	153 227,61	0,04	
4 % Dell International LLC Via EMC Corp. -144A- (MTN) 2019/2024	USD	200 000			% 107,914	192 163,34	0,04	
6,65 % E.ON International Finance BV -Reg- 2008/2038	USD	200 000			% 141,777	252 462,26	0,06	
3,625 % EDP Finance BV -Reg- (MTN) 2017/2024	USD	250 000			% 108,152	240 733,64	0,05	
3,75 % Empresa Nacional del Petroleo (MTN) 2016/2026	USD	250 000			% 103,594	230 588,37	0,05	
2,9 % Enbridge Inc (MTN) 2017/2022	USD	300 000			% 103,781	277 205,14	0,06	
4,75 % Enel Finance International NV 2017/2047	USD	200 000			% 119,524	212 836,98	0,05	
1 % Enterprise Products Operating LLC 2017/2077 *	USD	350 000			% 92,704	288 887,50	0,07	
2,25 % Fifth Third Bank NA (MTN) 2020/2027	USD	250 000	250 000		% 106,117	236 203,97	0,05	
7,288 % Gaz Capital SA 2013/2037	USD	350 000			% 144,338	449 789,64	0,10	
4,6 % Gilead Sciences Inc 2015/2035	USD	250 000			% 131,520	292 748,07	0,07	
4 % Glencore Funding LLC -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	200 000			% 107,332	191 126,38	0,04	
1 % Goldman Sachs Group Inc/The (MTN) 2017/2022 *	USD	300 000			% 102,549	273 913,44	0,06	
6,35 % Hasbro Inc 2010/2040	USD	200 000			% 115,688	206 006,32	0,05	
3,75 % Hyundai Capital America 2018/2021	USD	400 000			% 101,920	362 978,88	0,08	
3,05 % Jackson National Life Global Funding -144A- (MTN) 2019/2029	USD	300 000			% 106,733	285 089,99	0,06	
4,375 % KazTransGas JSC -Reg- (MTN) 2017/2027	USD	400 000	400 000		% 107,950	384 452,64	0,09	
2,875 % Kimberly-Clark Corp. 2020/2050	USD	380 000	380 000		% 109,215	369 509,94	0,08	
3,95 % Mars Inc 2019/2049	USD	190 000			% 125,284	211 938,43	0,05	
2,7 % Mars, Inc. -144A- (MTN) 2019/2025	USD	100 000			% 107,177	95 425,27	0,02	
3,45 % Microsoft Corp 2016/2036	USD	300 000			% 120,997	323 189,08	0,07	
3,375 % MPLX LP (MTN) 2018/2023	USD	300 000			% 104,729	279 737,34	0,06	
4,9 % MPLX LP 2018/2058	USD	200 000			% 99,834	177 774,70	0,04	
3,25 % Nasdaq, Inc. 2020/2050	USD	130 000	130 000		% 105,173	121 733,32	0,03	
1 % NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2017/2077 *	USD	145 000			% 103,483	133 597,14	0,03	
2,3 % PayPal Holdings Inc (MTN) 2020/2030	USD	120 000	120 000		% 104,670	111 832,13	0,03	
3,375 % PepsiCo, Inc. 2019/2049	USD	357 000	164 000		% 115,262	366 367,21	0,08	
6,75 % Petroleos Mexicanos 2017/2047	USD	500 000			% 77,063	343 066,37	0,08	
6,84 % Petroleos Mexicanos -Reg- 2019/2030	USD	400 000	290 000		% 88,193	314 091,61	0,07	
3,5 % Petronas Capital Ltd -Reg- (MTN) 2015/2025	USD	900 000			% 109,263	875 544,79	0,20	
4,5 % Petronas Capital Ltd -Reg- (MTN) 2015/2045	USD	250 000			% 124,143	276 326,62	0,06	
3,878 % Prudential Financial, Inc. (MTN) 2018/2028	USD	300 000			% 114,512	305 866,97	0,07	
2,55 % T-Mobile USA Inc 2020/2031	USD	400 000	400 000		% 100,522	357 998,48	0,08	
2,65 % Toronto-Dominion Bank/The (MTN) 2019/2024	USD	350 000			% 107,069	333 651,67	0,08	
2,986 % Total Capital International SA 2020/2041	USD	200 000	400 000	200 000	% 102,415	182 370,60	0,04	
3,386 % Total Capital International SA 2020/2060	USD	250 000	250 000		% 102,779	228 774,73	0,05	
1 % TransCanada PipeLines Ltd 2007/2067 *	USD	100 000			% 67,995	60 539,11	0,01	
2,65 % Ventas Realty LP (MTN) 2019/2025	USD	180 000			% 100,416	160 930,94	0,04	
4,875 % Vodafone Group PLC 2019/2049	USD	200 000			% 126,595	225 427,75	0,05	
2,5 % Volkswagen Group of America Finance LLC 2019/2021	USD	290 000			% 101,618	262 379,51	0,06	
Nichtnotierte Wertpapiere						892 570,95	0,20	
Verzinsliche Wertpapiere								
1,5 % AbbVie, Inc. -Reg- 2020/2023	EUR	260 000			% 103,350	268 708,70	0,06	
1,25 % AbbVie, Inc. -Reg- 2020/2024	EUR	610 000			% 102,273	623 862,25	0,14	
Investmentanteile						38 111 121,34	8,67	
Gruppeneigene Investmentanteile								
DWS Institutional SICAV - DWS Institutional ESG Euro Money Market Fund -IC- EUR - (0,110%)	Anteile	1 131		150	EUR	13 864,260	15 680 478,06	3,57
DWS Invest SICAV - DWS Invest Euro High Yield Corporates -IC- EUR - (0,450%)	Anteile	167 912		45 098	EUR	105,130	17 652 588,56	4,01
DWS Invest SICAV - DWS Invest Euro High Yield -XC- EUR - (0,200%)	Anteile	51 004	51 004		EUR	93,680	4 778 054,72	1,09
Summe Wertpapiervermögen						379 287 547,30	86,25	
Derivate								
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)								
Zins-Derivate						- 366 770,00	- 0,07	
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Zinsterminkontrakte								
Euro Buxl Futures 09/2020 (DB)	Stück	- 11		11		- 52 820,00	- 0,01	
Germany Federal Republic Notes 10 year 09/2020 (MS)	Stück	- 161		161		- 313 950,00	- 0,07	
Devisen-Derivate						- 298 844,58	- 0,07	
Forderungen/Verbindlichkeiten								

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Devisentermingeschäfte (Verkauf)							
Offene Positionen							
EUR/USD 40,6 Mio.						- 298 844,58	- 0,07
Swaps							
Forderungen/Verbindlichkeiten						71 176 923,74	16,19
Zinsswaps							
3M Euribor / 0.666% 06/10/2036 (OTC) (HS)	Stück	-20 000 000				2 223 420,00	0,51
3M Euribor / 0.721% 06/10/2056 (OTC) (HS)	Stück	-11 000 000				2 973 004,10	0,68
3M Euribor / 0.728% 06/10/2046 (OTC) (HS)	Stück	-12 500 000				2 274 261,25	0,52
3M Euribor / 1.125% 04/02/2065 (OTC) (GS)	Stück	-7 500 000				4 041 045,75	0,92
3M Euribor / 1.161% 04/02/2055 (OTC) (GS)	Stück	-8 000 000				3 274 445,60	0,74
3M Euribor / 1.63% 11/06/2055 (OTC) (HS)	Stück	-6 000 000				3 488 642,40	0,79
3M Euribor / 1.932% 11/08/2044 (OTC) (GS)	Stück	-7 000 000				3 229 318,40	0,73
3M Euribor / 1.979% 11/08/2054 (OTC) (GS)	Stück	-6 500 000				4 465 478,55	1,02
3M Euribor / 2.494% 04/02/2054 (OTC) (HS)	Stück	-11 000 000				9 369 495,30	2,13
6M Euribor / 0.326% 18/09/2069 (OTC) (DB)	Stück	-6 600 000				1 361 530,50	0,31
6M Euribor / 0.37% 18/09/2059 (OTC) (DB)	Stück	-12 875 000				2 046 949,90	0,47
6M Euribor / 0.441% 16/01/2026 (OTC) (DB)	Stück	-26 000 000				- 1 138 121,40	- 0,26
6M Euribor / 0.773% 18/09/2049 (OTC) (DB)	Stück	-15 000 000				1 641 160,50	0,37
6M Euribor / 0.896% 14/08/2028 (OTC) (DB)	Stück	-3 000 000				284 388,90	0,06
6M Euribor / 1.153% 16/01/2034 (OTC) (DB)	Stück	-6 000 000				- 993 885,60	- 0,23
6M Euribor / 1.359% 16/01/2069 (OTC) (DB)	Stück	-25 600 000				19 069 744,89	4,34
6M Euribor / 1.376% 16/01/2059 (OTC) (DB)	Stück	-15 250 000				8 383 943,70	1,91
6M Euribor / 1.413% 01/06/2042 (OTC) (DB)	Stück	-4 800 000				1 437 784,80	0,33
6M Euribor / 1.88% 03/06/2052 (OTC) (HS)	Stück	-9 000 000				5 436 016,20	1,24
6M Euribor / 1.906% 05/02/2024 (OTC) (HS)	Stück	-36 000 000				- 2 996 917,20	- 0,68
6M Euribor / 2.311% 03/04/2043 (OTC) (GS)	Stück	-3 000 000				1 559 928,30	0,35
6M Euribor / 3.347% 24/06/2021 (OTC) (DB)	Stück	-7 000 000				- 254 711,10	- 0,06
Bankguthaben							
EUR-Guthaben.	EUR					5 637 319,65	1,29
						4 068 196,75	0,94
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen							
Britisches Pfund	GBP	3 020				3 322,61	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
US-Dollar	USD	1 758 629				1 565 800,29	0,36
Sonstige Vermögensgegenstände							
Zinsansprüche						4 135 017,38	0,94
						4 135 017,38	0,95
Summe der Vermögensgegenstände **						465 620 443,37	104,60
Sonstige Verbindlichkeiten							
Andere sonstige Verbindlichkeiten						- 583 969,15	- 0,13
						- 583 969,15	- 0,13
Summe der Verbindlichkeiten						- 25 888 016,13	- 4,60
Fondsvermögen						439 732 427,24	100,00

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

Eine Aufstellung über die während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, ist auf Anforderung kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Währung	Anteilwert in der jeweiligen Währung
Anteilwert		
Klasse C.	EUR	164,55
Umlaufende Anteile		
Klasse C.	Stück	2 672 387,000

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

Darstellung der Maximalgrenze (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

Zusammenstellung aus inflationsbereinigten und normalen Zero-Coupon Anleihen mit Laufzeiten zwischen 1 und 90 Jahren

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

kleinster potenzieller Risikobetrag	%	83,273
größter potenzieller Risikobetrag	%	99,428
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	%	89,145

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 1.1.2020 bis 31.6.2020 auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99% Konfidenzniveau, 10 Tage Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraumes von einem Jahr berechnet. Als Bewertungsmaßstab wird das Risiko eines derivatfreien Vergleichsvermögens herangezogen. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigsten Entwicklung von Marktpreisen für das Fondsvermögen ergibt. Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Gesellschaft den **relativen Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an.

Die durchschnittliche Hebelwirkung aus der Nutzung von Derivaten betrug im Berichtszeitraum 0,9, wobei zur Berechnung die Summe der Nominalbeträge der Derivate in Relation zum Fondsvermögen gesetzt wurde (Nominalwertmethode).

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure gem. Punkt 40 a) der „Leitlinien zu börsengehandelten Indexfonds und anderen OGAW-Themen“ der European Securities and Markets Authority (ESMA) belief sich zum Berichtsstichtag unter Zugrundelegung einer Bruttobetachtung auf EUR 396 662 285,83.

Marktschlüssel

Vertragspartner der Derivate (mit Ausnahme von Devisenterminkontrakten)

DB = Deutsche Bank AG
GS = Goldman Sachs International
HS = HSBC
MS = Morgan Stanley and Co. International

Vertragspartner der Devisentermingeschäfte

J.P.Morgan AG

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.6.2020	
Britisches Pfund	GBP	0,908991	= EUR 1
US-Dollar	USD	1,12315	= EUR 1

Erläuterungen zur Bewertung

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

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

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

Fußnoten

- * Variabler Zinssatz
- ** Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

DB ADVISORS PB ENHANCED FIXED INCOME STRATEGY

Wertentwicklung im Überblick

ISIN	6 Monate
LU0970854393	3,1%

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

Stand: 30.6.2020
Angaben auf Euro-Basis

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensübersicht zum 30.6.2020

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen (Emittenten)		
Unternehmen	1 741 158 041,76	88,51
Zentralregierungen	156 773 811,25	7,96
Summe Anleihen	1 897 931 853,01	96,47
2. Derivate	20 816 560,55	1,06
3. Bankguthaben	85 285 659,04	4,34
4. Sonstige Vermögensgegenstände	17 128 649,27	0,87
II. Verbindlichkeiten		
1. Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	- 35 362 300,78	- 1,79
2. Sonstige Verbindlichkeiten	- 17 425 571,48	- 0,88
III. Fondsvermögen	1 968 374 849,61	100,00

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

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensaufstellung zum 30.6.2020

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						1 897 931 853,01	96,42
Vorzinsliche Wertpapiere							
1,75 % 3M Co. (MTN) 2015/2030	EUR	14 389 000		6 000 000	% 113,162	16 282 808,24	0,83
1,5 % 3M Co. 2016/2031	EUR	587 000			% 111,280	653 210,67	0,03
2,125 % Aeroports de Paris 2018/2038	EUR	3 400 000			% 106,889	3 634 209,00	0,18
1,125 % Aeroports de Paris 2019/2034	EUR	11 200 000			% 96,943	10 857 616,00	0,55
1,5 % Aeroports de Paris 2020/2032	EUR	5 300 000	5 300 000		% 100,199	5 310 547,00	0,27
1,375 % Air Liquide Finance SA 2020/2030	EUR	1 400 000	1 400 000		% 109,380	1 531 313,00	0,08
0,8 % Air Products and Chemicals Inc 2020/2032	EUR	3 950 000	3 950 000		% 100,728	3 978 736,25	0,20
1,375 % Airbus Group Finance BV (MTN) 2016/2031	EUR	681 000			% 101,865	693 700,65	0,04
0,875 % Allander NV (MTN) 2019/2032	EUR	5 861 000			% 106,122	6 219 810,42	0,32
1,375 % Allianz Finance II BV (MTN) 2016/2031	EUR	800 000			% 109,759	878 068,00	0,04
1,5 % Allianz Finance II BV (MTN) 2019/2030	EUR	6 300 000			% 111,548	7 027 524,00	0,36
0,5 % Allianz Finance II BV (MTN) 2020/2031	EUR	14 100 000	14 100 000		% 100,866	14 222 106,00	0,72
3,25 % Anheuser-Busch InBev SA/NV (MTN) 2013/2033	EUR	4 395 000			% 118,619	5 213 305,05	0,26
2,75 % Anheuser-Busch InBev SA/NV 2016/2036	EUR	20 380 000			% 110,579	22 536 000,20	1,14
3,7 % Anheuser-Busch InBev SA/NV 2020/2040	EUR	2 430 000	2 430 000		% 121,430	2 950 736,85	0,15
1,375 % Apple, Inc. 2017/2029	EUR	3 819 000			% 110,101	4 204 757,19	0,21
0,5 % Apple, Inc. 2019/2031	EUR	17 540 000	8 820 000		% 102,112	17 910 357,10	0,91
1,875 % APRR SA (MTN) 2016/2031	EUR	400 000			% 111,224	444 896,00	0,02
1,625 % APRR SA (MTN) 2017/2032	EUR	300 000			% 109,570	328 708,50	0,02
1,25 % APRR SA (MTN) 2019/2028	EUR	4 000 000			% 105,803	4 232 100,00	0,22
2,45 % AT&T Inc 2015/2035	EUR	364 000			% 106,429	387 399,74	0,02
3,55 % AT&T, Inc. 2012/2032	EUR	4 215 000		6 120 000	% 120,220	5 067 251,93	0,26
3,375 % AT&T, Inc. 2014/2034	EUR	402 000			% 119,159	479 017,17	0,02
2,45 % AT&T, Inc. 2015/2035	EUR	10 000 000			% 106,429	10 642 850,00	0,54
3,15 % AT&T, Inc. 2017/2036	EUR	4 200 000			% 113,359	4 761 078,00	0,24
1,8 % AT&T, Inc. 2019/2039	EUR	5 450 000			% 93,908	5 117 986,00	0,26
2,6 % AT&T, Inc. 2020/2038	EUR	3 050 000	3 050 000		% 105,866	3 228 913,00	0,16
0,625 % AusNet Services Holdings Pty Ltd. (MTN) 2020/2030	EUR	3 940 000	3 940 000		% 100,910	3 975 854,00	0,20
1,375 % Autoroutes du Sud de la France SA (MTN) 2019/2031	EUR	500 000			% 108,952	544 757,50	0,03
1,25 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2020/2030	EUR	4 400 000	4 400 000		% 102,968	4 530 592,00	0,23
3 % BASF SE (MTN) 2013/2033	EUR	16 000 000			% 128,114	20 498 160,00	1,04
2,875 % BASF SE (MTN) 2013/2033	EUR	400 000			% 123,452	493 806,00	0,03
0,875 % BASF SE (MTN) 2016/2031	EUR	5 291 000			% 103,723	5 487 957,48	0,28
1,625 % BASF SE 2017/2037	EUR	779 000			% 111,053	865 102,87	0,04
1,5 % BASF SE 2018/2030	EUR	473 000		60 000	% 110,719	523 700,87	0,03
1,625 % Berkshire Hathaway, Inc. 2015/2035	EUR	7 440 000			% 112,924	8 401 508,40	0,43
1,5 % BMW Finance NV (MTN) 2019/2029	EUR	6 491 000			% 105,118	6 823 209,38	0,35
0,875 % BMW Finance NV 2020/2032	EUR	5 260 000	5 260 000		% 101,558	5 341 950,80	0,27
1,375 % BNP Paribas SA (MTN) 2019/2029	EUR	6 400 000			% 104,434	6 683 776,00	0,34
1,104 % BP Capital Markets PLC (MTN) 2019/2034	EUR	5 230 000			% 94,624	4 948 835,20	0,25
0,625 % BPCE SA (MTN) 2020/2030	EUR	7 500 000	7 500 000		% 101,567	7 617 525,00	0,39
1,75 % Bristol-Myers Squibb Co. 2015/2035	EUR	15 848 000			% 113,674	18 014 976,28	0,92
1 % Bundesrepublik Deutschland (MTN) 2014/2024	EUR	5 500 000			% 107,198	5 895 862,50	0,30
0,5 % Bundesrepublik Deutschland (MTN) 2015/2025	EUR	9 000 000			% 105,729	9 515 565,00	0,48
0,5 % Bundesrepublik Deutschland (MTN) 2016/2026	EUR	7 500 000			% 106,854	8 014 050,00	0,41
0,01 % Bundesrepublik Deutschland (MTN) 2016/2026	EUR	4 000 000			% 104,257	4 170 260,00	0,21
0,25 % Bundesrepublik Deutschland (MTN) 2017/2027	EUR	3 750 000			% 106,203	3 982 593,75	0,20
6,5 % Bundesrepublik Deutschland 1997/2027	EUR	8 000 000			% 151,109	12 088 680,00	0,61
4,75 % Bundesrepublik Deutschland 1998/2028	EUR	8 500 000			% 143,725	12 216 582,50	0,62
5,625 % Bundesrepublik Deutschland 1998/2028	EUR	8 000 000			% 147,775	11 822 000,00	0,60
6,25 % Bundesrepublik Deutschland 2000/2030	EUR	7 500 000			% 166,072	12 455 400,00	0,63
5,5 % Bundesrepublik Deutschland 2000/2031	EUR	8 000 000			% 164,159	13 132 720,00	0,67
4,75 % Bundesrepublik Deutschland 2003/2034	EUR	7 500 000			% 173,444	13 008 262,50	0,66
4 % Bundesrepublik Deutschland 2005/2037	EUR	6 500 000			% 171,985	11 178 992,50	0,57
4,25 % Bundesrepublik Deutschland 2007/2039	EUR	5 500 000			% 186,318	10 247 490,00	0,52
4,75 % Bundesrepublik Deutschland 2008/2040	EUR	5 500 000			% 200,762	11 041 882,50	0,56
3,25 % Bundesrepublik Deutschland 2010/2042	EUR	5 000 000			% 175,916	8 795 775,00	0,45
2,5 % Bundesrepublik Deutschland 2012/2044	EUR	3 500 000			% 163,159	5 710 565,00	0,29
0,01 % Bundesrepublik Deutschland 2019/2050	EUR	3 500 000			% 99,918	3 497 130,00	0,18
0,75 % Cadent Finance PLC (MTN) 2020/2032	EUR	3 200 000	3 200 000		% 97,964	3 134 832,00	0,16
2,5 % Chubb INA Holdings, Inc. 2018/2038	EUR	7 276 000			% 115,403	8 396 685,90	0,43
1,4 % Chubb INA Holdings, Inc. 2019/2031	EUR	6 581 000			% 103,584	6 816 830,14	0,35
1,25 % Citigroup, Inc. (MTN) 2019/2029	EUR	7 985 000			% 104,109	8 313 103,65	0,42
1,625 % Coca-Cola Co./The 2015/2035	EUR	12 894 000			% 110,107	14 197 196,58	0,72
1,1 % Coca-Cola Co./The 2016/2036	EUR	602 000			% 103,142	620 911,83	0,03
1,25 % Coca-Cola Co./The 2019/2031	EUR	6 442 000			% 106,743	6 876 351,85	0,35
2,125 % Coentreprise de Transport d'Electricite SA 2017/2032	EUR	10 800 000			% 112,932	12 196 656,00	0,62
1,375 % Colgate-Palmolive Co. (MTN) 2019/2034	EUR	9 862 000			% 112,718	11 116 199,85	0,56
0,875 % Colgate-Palmolive Co. (MTN) 2019/2039	EUR	18 020 000			% 102,265	18 428 062,90	0,94
1,25 % Comcast Corp 2020/2040	EUR	9 080 000	12 080 000	3 000 000	% 96,855	8 794 434,00	0,45
1,125 % Cooperatieve Rabobank UA (MTN) 2019/2031	EUR	6 200 000		5 000 000	% 104,583	6 484 146,00	0,33
1 % Credit Agricole SA (MTN) 2019/2029	EUR	6 800 000			% 106,695	7 255 260,00	0,37
0,875 % Credit Agricole SA 2020/2032	EUR	7 100 000	7 100 000		% 98,703	7 007 877,50	0,36

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1,75 % Credit Agricole SA/London (MTN) 2019/2029	EUR	3 300 000		1 600 000	%	107,717	3 554 644,50	0,18
1,5 % Daimler AG (MTN) 2017/2029	EUR	8 000 000			%	101,167	8 093 360,00	0,41
2,125 % Daimler AG (MTN) 2017/2037	EUR	12 819 000			%	104,438	13 387 843,13	0,68
2 % Daimler AG (MTN) 2019/2031	EUR	398 000			%	104,652	416 512,97	0,02
1,125 % Daimler AG 2019/2034	EUR	3 640 000		6 450 000	%	92,614	3 371 149,60	0,17
1,375 % Deutsche Bahn Finance GmbH (MTN) 2020/2040	EUR	6 280 000	6 280 000		%	106,157	6 666 628,20	0,34
0,875 % Deutsche Bahn Finance GmbH 2020/2039	EUR	11 060 000	11 060 000		%	97,300	10 761 324,70	0,55
1 % Deutsche Post AG 2020/2032	EUR	10 430 000	10 430 000		%	103,276	10 771 634,65	0,55
7,5 % Deutsche Telekom International Finance BV (MTN) 2003/2033	EUR	403 000			%	173,237	698 143,10	0,04
1,35 % DH Europe Finance 2019/perpetual	EUR	12 080 000			%	95,469	11 532 655,20	0,59
1,35 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2039	EUR	2 200 000			%	95,469	2 100 318,00	0,11
1,8 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2049	EUR	6 490 000			%	96,040	6 232 996,00	0,32
1,8 % DH Europe Finance II Sarl 2019/perpetual	EUR	11 150 000	5 840 000		%	96,040	10 708 460,00	0,54
1,625 % E.ON SE (MTN) 2017/2029	EUR	7 610 000		7 420 000	%	108,413	8 250 191,25	0,42
0,35 % E.ON SE (MTN) 2019/2030	EUR	4 110 000			%	96,928	3 983 720,25	0,20
0,625 % E.ON SE (MTN) 2019/2031	EUR	3 870 000			%	98,184	3 799 720,80	0,19
0,875 % E.ON SE (MTN) 2020/2031	EUR	5 980 000	5 980 000		%	100,934	6 035 853,20	0,31
2 % Electricite de France SA (MTN) 2018/2030	EUR	500 000			%	110,649	553 245,00	0,03
2,125 % Eli Lilly & Co. 2015/2030	EUR	5 002 000			%	116,909	5 847 788,18	0,30
1,7 % Eli Lilly & Co. 2019/2049	EUR	26 360 000			%	104,164	27 457 630,40	1,39
6,125 % EnBW International Finance BV (MTN) 2009/2039	EUR	10 164 000			%	180,211	18 316 595,22	0,93
1,875 % EnBW International Finance BV (MTN) 2018/2033	EUR	15 601 000			%	116,856	18 230 626,56	0,93
5,6 % Enel Finance International NV (MTN) 2011/2031	EUR	500 000			%	144,617	723 085,00	0,04
1,125 % Enel Finance International NV (MTN) 2019/2034	EUR	17 530 000			%	103,580	18 157 574,00	0,92
0,75 % Enexis Holding NV (MTN) 2019/2031	EUR	11 440 000			%	102,538	11 730 290,00	0,60
0,625 % Enexis Holding NV (MTN) 2020/2032	EUR	5 320 000	5 320 000		%	101,475	5 398 470,00	0,27
5,95 % Engie SA (MTN) 2011/2111	EUR	521 000			%	207,975	1 083 547,15	0,06
1,5 % Engie SA (MTN) 2015/2035	EUR	10 400 000			%	105,644	10 986 976,00	0,56
1,875 % Engie SA (MTN) 2018/2033	EUR	200 000			%	112,937	225 873,00	0,01
1,375 % Engie SA (MTN) 2019/2039	EUR	8 200 000			%	101,642	8 334 603,00	0,42
1,25 % Engie SA 2019/2041	EUR	17 300 000			%	98,560	17 050 880,00	0,87
1 % ENI Spa 2019/2034	EUR	10 640 000			%	99,285	10 563 924,00	0,54
2 % ENI Spa 2020/2031	EUR	5 140 000	5 140 000		%	110,375	5 673 249,30	0,29
1,625 % Equinor ASA (MTN) 2015/2035	EUR	5 676 000		5 000 000	%	110,392	6 265 849,92	0,32
1,625 % Equinor ASA (MTN) 2016/2036	EUR	537 000			%	110,516	593 468,24	0,03
1,375 % Equinor ASA (MTN) 2020/2032	EUR	3 180 000	3 180 000		%	106,408	3 383 758,50	0,17
1,875 % ESB Finance DAC (MTN) 2016/2031	EUR	5 859 000			%	113,263	6 636 079,17	0,34
2,125 % ESB Finance DAC (MTN) 2018/2033	EUR	399 000			%	116,471	464 719,29	0,02
0,75 % Essilor Luxottica (MTN) 2019/2031	EUR	8 700 000			%	101,080	8 793 960,00	0,45
1,5 % Euroclear Investments SA 2018/2030	EUR	6 100 000			%	109,227	6 662 816,50	0,34
1,75 % Exor NV 2019/2034	EUR	9 770 000			%	92,168	9 004 813,60	0,46
1,408 % Exxon Mobil Corp 2020/2039	EUR	25 690 000	25 690 000		%	98,893	25 405 483,25	1,29
2,875 % Fluvius System Operator CVBA (MTN) 2014/2029	EUR	300 000			%	119,569	358 707,00	0,02
6,025 % GE Capital European Funding (MTN) 2008/2038	EUR	5 373 000			%	130,172	6 994 114,70	0,36
1,625 % Gecina SA (MTN) 2019/2034	EUR	7 900 000			%	103,435	8 171 365,00	0,42
1,75 % GlaxoSmithKline Capital PLC (MTN) 2018/2030	EUR	450 000			%	112,264	505 185,75	0,03
3 % Goldman Sachs Group, Inc. (MTN) 2016/2031	EUR	4 111 000			%	118,415	4 868 040,65	0,25
1,875 % Heathrow Funding Ltd (MTN) 2019/2034	EUR	11 327 000			%	101,401	11 485 634,64	0,58
2,02 % Heineken NV (MTN) 2017/2032	EUR	12 559 000			%	110,853	13 921 965,48	0,71
1,75 % Heineken NV (MTN) 2018/2031	EUR	1 876 000			%	109,343	2 051 274,68	0,10
2,25 % Heineken NV (MTN) 2020/2030	EUR	1 810 000	1 810 000		%	113,244	2 049 716,40	0,10
1,75 % Heineken NV (MTN) 2020/2040	EUR	7 910 000	15 820 000	7 910 000	%	100,440	7 944 804,00	0,40
1,621 % Iberdrola Finanzas SA (MTN) 2017/2029	EUR	500 000			%	111,324	556 617,50	0,03
3 % Illinois Tool Works, Inc. (MTN) 2014/2034	EUR	7 110 000			%	125,819	8 945 730,90	0,45
2,125 % Illinois Tool Works, Inc. 2015/2030	EUR	486 000			%	113,401	551 126,43	0,03
1 % Illinois Tool Works, Inc. 2019/2031	EUR	9 118 000			%	102,867	9 379 413,06	0,48
2,5 % ING Groep NV (MTN) 2018/2030	EUR	7 000 000			%	118,520	8 296 365,00	0,42
1,75 % International Business Machines Corp. 2019/2031	EUR	15 568 000			%	109,187	16 998 154,32	0,86
1,2 % International Business Machines Corp. 2020/2040	EUR	15 910 000	15 910 000		%	95,820	15 244 882,45	0,77
1,5 % Investor AB (MTN) 2018/2030	EUR	7 327 000			%	107,816	7 899 641,69	0,40
1,5 % Investor AB (MTN) 2019/2039	EUR	5 682 000			%	106,025	6 024 312,09	0,31
0,875 % Italgas SpA (MTN) 2019/2030	EUR	5 250 000			%	101,290	5 317 725,00	0,27
1 % Italgas SpA (MTN) 2019/2031	EUR	11 260 000			%	101,906	11 474 615,60	0,58
1,65 % John Deere Cash Management SA (MTN) 2019/2039	EUR	13 068 000			%	107,129	13 999 552,38	0,71
2,2 % John Deere Cash Management SA (MTN) 2020/2032	EUR	2 880 000	5 760 000	2 880 000	%	113,341	3 264 220,80	0,17
1,65 % Johnson & Johnson 2016/2035	EUR	1 143 000			%	117,650	1 344 733,79	0,07
1,65 % Johnson & Johnson 2016/2035	EUR	19 000 000			%	117,650	22 353 405,00	1,14
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2031 *	EUR	3 490 000		5 250 000	%	100,214	3 497 468,60	0,18
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2032 *	EUR	22 510 000			%	100,337	22 585 858,70	1,15
1,625 % KKR Group Finance Co., V LLC -Reg- (MTN) 2019/2029	EUR	4 841 000			%	101,569	4 916 931,09	0,25
1,625 % Klepierre SA (MTN) 2017/2032	EUR	500 000			%	99,802	499 007,50	0,03
1 % La Poste 2019/2034	EUR	12 200 000			%	100,353	12 243 005,00	0,62
1,375 % La Poste SA (MTN) 2020/2032	EUR	6 100 000	6 100 000		%	105,506	6 435 866,00	0,33
0,55 % Linde Finance BV 2020/2032	EUR	13 200 000	13 200 000		%	100,504	13 266 462,00	0,67
0,375 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 2020/2031	EUR	18 200 000	18 200 000		%	98,096	17 853 381,00	0,91
1,979 % Marsh & McLennan Cos, Inc. 2019/2030	EUR	5 266 000		5 000 000	%	110,426	5 815 006,83	0,30
1,75 % McDonald's Corp. 2016/2028	EUR	6 000 000			%	107,683	6 460 950,00	0,33
1,5 % McDonald's Corp. 2017/2029	EUR	2 600 000			%	105,851	2 752 126,00	0,14

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1,625 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2031	EUR	10 203 000			%	109,074	11 128 820,22	0,57
2,25 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2039	EUR	10 557 000			%	112,507	11 877 363,99	0,60
1,75 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2049	EUR	4 180 000	2 930 000		%	97,658	4 082 104,40	0,21
1,75 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2049	EUR	8 880 000			%	97,658	8 672 030,40	0,44
2,5 % Merck & Co., Inc. 2014/2034	EUR	10 410 000			%	125,184	13 031 654,40	0,66
1,375 % Merck & Co., Inc. 2016/2036	EUR	406 000			%	109,158	443 181,48	0,02
0,875 % Merck Financial Services GmbH (MTN) 2019/2031	EUR	17 300 000			%	102,595	17 748 848,50	0,90
2,625 % Microsoft Corp. 2013/2033	EUR	10 956 000			%	128,304	14 056 931,46	0,71
1,25 % Nestle Finance International Ltd (MTN) 2017/2029	EUR	462 000			%	110,083	508 581,15	0,03
1,75 % Nestle Finance International Ltd (MTN) 2017/2037	EUR	9 672 000			%	119,147	11 523 897,84	0,59
1,375 % Novartis Finance SA 2018/2030	EUR	498 000			%	110,307	549 328,86	0,03
1,7 % Novartis Finance SA 2018/2038	EUR	15 588 000			%	117,302	18 284 957,82	0,93
1 % OMV AG (MTN) 2019/2034	EUR	12 340 000			%	97,983	12 091 040,50	0,61
2,375 % OMV AG (MTN) 2020/2032	EUR	9 730 000	9 730 000		%	114,791	11 169 115,65	0,57
1 % Optus Finance Pty Ltd (MTN) 2019/2029	EUR	5 174 000			%	101,490	5 251 066,73	0,27
8,125 % Orange SA (MTN) 2003/2033	EUR	5 000 000			%	181,617	9 080 850,00	0,46
1,875 % Orange SA (MTN) 2018/2030	EUR	5 300 000			%	112,176	5 945 328,00	0,30
1,375 % Orange SA (MTN) 2019/perpetual	EUR	12 400 000			%	95,984	11 902 016,00	0,60
1,625 % Orange SA (MTN) 2020/2032	EUR	2 800 000	2 800 000		%	108,578	3 040 184,00	0,15
1,125 % PepsiCo, Inc. 2019/2031	EUR	7 819 000			%	105,906	8 280 751,05	0,42
0,875 % PepsiCo, Inc. 2019/2039	EUR	12 040 000			%	98,583	11 869 393,20	0,60
0,875 % Pernod Ricard SA 2019/2031	EUR	6 100 000			%	99,117	6 046 106,50	0,31
1,875 % Procter & Gamble Co. 2018/2038	EUR	6 794 000			%	120,573	8 191 695,65	0,42
1,5 % Prologis Euro Finance LLC 2019/perpetual	EUR	9 440 000			%	95,711	9 035 071,20	0,46
1 % Prologis Euro Finance LLC 2020/2035	EUR	9 630 000	9 630 000		%	97,077	9 348 515,10	0,47
1,625 % Prologis International Funding II SA (MTN) 2020/2032	EUR	1 535 000	1 535 000		%	104,548	1 604 811,80	0,08
1,5 % Richemont International Holding SA 2018/2030	EUR	4 491 000			%	109,479	4 916 679,44	0,25
2 % Richemont International Holding SA 2018/2038	EUR	7 884 000		3 290 000	%	113,031	8 911 324,62	0,45
1,625 % Richemont International Holding SA 2020/2040	EUR	6 820 000	6 820 000		%	102,650	7 000 730,00	0,36
2,979 % Robert Bosch Investment Nederland BV (MTN) 2013/2033	EUR	2 100 000			%	129,731	2 724 351,00	0,14
2 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SA (MTN) 2016/2036	EUR	300 000			%	117,963	353 889,00	0,02
1,875 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SA (MTN) 2017/2037	EUR	7 500 000	1 600 000		%	116,772	8 757 900,00	0,44
2,125 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR (MTN) 2018/2038	EUR	4 200 000			%	121,597	5 107 053,00	0,26
1,125 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR (MTN) 2019/perpetual	EUR	10 700 000	6 300 000		%	99,336	10 628 898,50	0,54
1,125 % Sanofi (MTN) 2016/2028	EUR	2 200 000			%	107,321	2 361 051,00	0,12
1,375 % Sanofi (MTN) 2018/2030	EUR	2 800 000	2 000 000		%	110,463	3 092 964,00	0,16
1,875 % Sanofi (MTN) 2018/2038	EUR	11 200 000			%	119,029	13 331 192,00	0,68
1,25 % Sanofi (MTN) 2019/2034	EUR	600 000			%	111,026	666 153,00	0,03
1,375 % SAP SE 2018/2030	EUR	4 900 000			%	109,588	5 369 812,00	0,27
1,625 % SAP SE 2018/2031	EUR	5 500 000			%	112,225	6 172 347,50	0,31
2 % Schlumberger Finance BV 2020/2032	EUR	6 650 000	6 650 000		%	106,956	7 112 574,00	0,36
1,375 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2018/2030	EUR	4 039 000			%	108,952	4 400 551,09	0,22
0,5 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2019/2034	EUR	7 400 000			%	96,024	7 105 776,00	0,36
1,75 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2019/2039	EUR	19 695 000			%	111,676	21 994 489,73	1,12
1 % Snam SpA (MTN) 2019/2034	EUR	3 350 000		4 160 000	%	100,880	3 379 480,00	0,17
1,5 % Statkraft AS 2015/2030	EUR	7 496 000		3 000 000	%	108,569	8 138 332,24	0,41
0,5 % Stedin Holding NV (MTN) 2019/2029	EUR	4 530 000			%	100,112	4 535 050,95	0,23
2,625 % Stryker Corp. 2018/2030	EUR	6 307 000			%	114,793	7 239 994,51	0,37
1 % Stryker Corp. 2019/2031	EUR	12 290 000			%	98,909	12 155 916,10	0,62
1,5 % Suez (MTN) 2017/2029	EUR	700 000			%	107,824	754 768,00	0,04
1,625 % Suez (MTN) 2017/2032	EUR	8 500 000			%	109,488	9 306 437,50	0,47
1,625 % Suez (MTN) 2018/2030	EUR	2 300 000			%	109,557	2 519 799,50	0,13
0,5 % Suez (MTN) 2019/2031	EUR	7 100 000			%	97,689	6 935 919,00	0,35
1,25 % Suez SA 2020/2035	EUR	11 300 000	11 300 000		%	101,721	11 494 416,50	0,58
2 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd 2020/2040	EUR	0	10 930 000		%	99,513	10 876 770,90	0,55
3 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd -Reg- 2018/2030	EUR	20 775 000			%	117,552	24 421 324,13	1,24
1,957 % Telefonica Emisiones SA 2019/2039	EUR	6 550 000			%	105,235	6 892 859,75	0,35
1,75 % Telenor ASA (MTN) 2019/2034	EUR	8 034 000			%	110,958	8 914 325,55	0,45
0,875 % Telenor ASA 2020/2035	EUR	10 890 000	10 890 000		%	98,424	10 718 319,15	0,54
2,125 % Telia Co., AB (MTN) 2019/2034	EUR	248 000			%	109,438	271 405,00	0,01
3,5 % TeliaSonera AB (MTN) 2013/2033	EUR	273 000			%	126,286	344 759,42	0,02
1,625 % TeliaSonera AB (MTN) 2015/2035	EUR	10 273 000			%	102,903	10 571 173,83	0,54
1,375 % Telstra Corp., Ltd (MTN) 2019/2029	EUR	10 496 000			%	107,247	11 256 592,64	0,57
1,875 % TenneT Holding BV (MTN) 2016/2036	EUR	6 487 000			%	115,314	7 480 419,18	0,38
2 % TenneT Holding BV (MTN) 2018/2034	EUR	536 000			%	117,231	628 355,48	0,03
1,5 % TenneT Holding BV (MTN) 2019/2039	EUR	15 732 000			%	108,473	17 064 893,70	0,87
1,5 % Thermo Fisher Scientific 2019/2039	EUR	12 560 000	2 000 000		%	98,295	12 345 789,20	0,63
1,875 % Thermo Fisher Scientific 2019/perpetual	EUR	8 120 000	5 240 000		%	95,756	7 775 346,60	0,40
2,875 % Thermo Fisher Scientific, Inc. 2017/2037	EUR	4 950 000			%	121,578	6 018 111,00	0,31
1,875 % Thermo Fisher Scientific, Inc. 2019/2049	EUR	5 700 000			%	95,756	5 458 063,50	0,28
1,535 % Total Capital International SA (MTN) 2019/2039	EUR	19 800 000			%	105,203	20 830 194,00	1,06
1,994 % Total Capital International SA (MTN) 2020/2032	EUR	4 200 000	4 200 000		%	112,854	4 739 847,00	0,24
1,618 % Total Capital International SA 2020/2040	EUR	7 800 000	7 800 000		%	104,263	8 132 475,00	0,41
2 % Unibail-Rodamco SE (MTN) 2017/2037	EUR	5 103 000			%	96,890	4 944 296,70	0,25

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
2,25 % Unibail-Rodamco SE (MTN) 2018/2038	EUR	7 100 000			100,182	7 112 922,00	0,36
1,75 % Unibail-Rodamco SE (MTN) 2019/2049	EUR	10 100 000		2 200 000	86,216	8 707 765,50	0,44
1,375 % Unilever NV (MTN) 2017/2029	EUR	17 000 000			111,238	18 910 375,00	0,96
1,625 % Unilever NV (MTN) 2018/2033	EUR	363 000			114,983	417 386,48	0,02
1,5 % Unilever PLC 2019/2039	EUR	7 616 000			113,352	8 632 850,24	0,44
0,8 % Veolia Environnement SA 2020/2032	EUR	6 900 000	6 900 000		100,050	6 903 415,50	0,35
0,875 % Verizon Communications 2019/2032	EUR	10 780 000			98,258	10 592 158,50	0,54
1,85 % Verizon Communications Inc 2020/2040	EUR	4 500 000	4 500 000		102,372	4 606 717,50	0,23
2,625 % Verizon Communications, Inc. 2014/2031	EUR	1 966 000			117,493	2 309 912,38	0,12
2,875 % Verizon Communications, Inc. 2017/2038	EUR	18 890 000			120,540	22 770 006,00	1,16
2,5 % Vodafone Group PLC (MTN) 2019/2039	EUR	9 558 000			110,559	10 567 229,22	0,54
1,125 % Vonovia Finance (MTN) 2019/2034	EUR	9 300 000			97,318	9 050 574,00	0,46
2,75 % Vonovia Finance BV (MTN) 2018/2038	EUR	300 000			115,858	347 572,50	0,02
1,625 % Vonovia Finance BV (MTN) 2019/2039	EUR	18 100 000	5 600 000		98,748	17 873 388,00	0,91
1,823 % Wintershall Dea Finance BV 2019/2031	EUR	6 800 000			93,935	6 387 546,00	0,32
1,625 % Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. (MTN) 2019/2039	EUR	15 878 000			111,024	17 628 311,33	0,90
Summe Wertpapiervermögen						1 897 931 853,01	96,42
Derivate							
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							
Swaps						20 816 560,55	1,06
Forderungen/Verbindlichkeiten							
Zinsswaps							
12M CPTFE Inflation / 1.045% 01/15/2027 (OTC) (DB)	Stück	65 000 000,00				- 2 049 469,50	- 0,10
12M CPTFE Inflation / 1.136% 01/15/2030 (OTC) (DB)	Stück	64 000 000,00				- 2 493 881,60	- 0,13
12M CPTFE Inflation / 1.182% 01/15/2030 (OTC) (DB)	Stück	1 000 000,00				- 44 522,90	0,00
12M CPTFE Inflation / 1.267% 01/15/2035 (OTC) (DB)	Stück	65 000 000,00				- 3 456 154,00	- 0,18
12M CPTFE Inflation / 1.378% 01/15/2040 (OTC) (DB)	Stück	100 000 000,00				- 6 888 530,00	- 0,35
12M CPTFE Inflation / 1.492% 01/15/2050 (OTC) (DB)	Stück	82 000 000,00				- 7 021 684,60	- 0,36
12M CPTFE Inflation / 1.524% 01/15/2060 (OTC) (DB)	Stück	26 000 000,00				- 3 494 550,80	- 0,18
12M CPTFE Inflation / 1.544% 01/15/2070 (OTC) (DB)	Stück	13 500 000,00				- 2 708 430,75	- 0,14
6M Euribor / 0.048% 06/18/2035 (OTC) (DB)	Stück	261 000 000,00				- 1 833 107,40	- 0,09
6M Euribor / 0.201% 13/09/2069 (OTC) (DB)	Stück	76 000 000,00				10 762 914,80	0,54
6M Euribor / 0.226% 12/09/2059 (OTC) (DB)	Stück	182 000 000,00				18 189 753,40	0,92
6M Euribor / 0.262% 12/09/2049 (OTC) (DB)	Stück	221 000 000,00				14 389 464,70	0,73
6M Euribor / 0.278% 13/09/2044 (OTC) (DB)	Stück	192 000 000,00				9 714 585,60	0,49
6M Euribor / 1% 06/18/2030 (OTC) (DB)	Stück	488 000 000,00				- 2 249 826,40	- 0,11
Bankguthaben						85 285 659,04	4,34
EUR-Guthaben	EUR					85 285 659,04	4,34
Sonstige Vermögensgegenstände						17 128 649,27	0,87
Zinsansprüche						17 044 236,24	0,87
Sonstige Ansprüche						84 413,03	0,00
Summe der Vermögensgegenstände **						2 053 402 879,82	104,31
Kurzfristige Verbindlichkeiten						- 35 362 300,78	- 1,79
EUR-Kredite	EUR					- 35 362 300,78	- 1,79
Sonstige Verbindlichkeiten						- 17 425 571,48	- 0,88
Andere sonstige Verbindlichkeiten						- 17 425 571,48	- 0,88
Summe der Verbindlichkeiten						- 85 028 030,21	- 4,31
Fondsvermögen						1 968 374 849,61	100,00

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

Eine Aufstellung über die während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, ist auf Anforderung kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Währung	Anteilwert in der jeweiligen Währung
Anteilwert		
Klasse B	EUR	141,82
Umlaufende Anteile		
Klasse B	Stück	13 879 354,347

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

Zusammensetzung des Referenzportfolios (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

Zusammenstellung aus inflationsbereinigten und normalen Zero-Coupon Anleihen mit Laufzeiten zwischen 1 und 50 Jahren

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

kleinster potenzieller Risikobetrag	%	70,698
größter potenzieller Risikobetrag	%	110,038
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	%	94,838

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 1.1.2020 bis 30.6.2020 auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99% Konfidenzniveau, 10 Tage Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraumes von einem Jahr berechnet. Als Bewertungsmaßstab wird das Risiko eines derivativefreien Vergleichsvermögens herangezogen. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigsten Entwicklung von Marktpreisen für das Fondsvermögen ergibt. Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Gesellschaft den **relativen Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an.

Die durchschnittliche Hebelwirkung aus der Nutzung von Derivaten betrug im Berichtszeitraum 0,5, wobei zur Berechnung die Summe der Nominalbeträge der Derivate in Relation zum Fondsvermögen gesetzt wurde (Nominalwertmethode).

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure gem. Punkt 40 a) der „Leitlinien zu börsengehandelten Indexfonds und anderen OGAW-Themen“ der European Securities and Markets Authority (ESMA) belief sich zum Berichtsstichtag unter Zugrundelegung einer Bruttobetrachtung auf EUR 1 927 657 342,10.

Marktschlüssel

Vertragspartner der Derivate (mit Ausnahme von Devisenterminkontrakten)

DB = Deutsche Bank AG

Erläuterung zur Bewertung

Die Anteilswerte werden in Verantwortung des Verwaltungsrats der SICAV durch die Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den vom Verwaltungsrat der SICAV auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen / Verordnungen bzw. im Prospekt der SICAV definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

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

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

Fußnoten

* Variabler Zinssatz.

** Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

DB ADVISORS BSPK ENHANCED FIXED INCOME STRATEGY

Wertentwicklung im Überblick

ISIN	6 Monate
LU1068386405	2,5%

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

Stand: 30.6.2020
Angaben auf Euro-Basis

DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensübersicht zum 30.6.2020

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen)		
Informationstechnologie	5 543 384,05	1,39
Telekommunikationsdienste	14 652 884,45	3,66
Dauerhafte Konsumgüter	50 626 253,39	12,67
Energie	5 909 705,80	1,48
Hauptverbrauchsgüter	5 403 617,30	1,35
Finanzsektor	23 785 220,00	5,96
Grundstoffe	2 136 683,50	0,53
Industrien	20 490 069,10	5,13
Versorger	26 430 105,60	6,60
Summe Aktien	154 977 923,19	38,77
2. Anleihen (Emittenten)		
Unternehmen	196 462 552,77	49,16
Zentralregierungen	27 148 022,50	6,81
Summe Anleihen	223 610 575,27	55,97
3. Derivate	5 065 471,03	1,27
4. Bankguthaben	16 797 586,37	4,20
5. Sonstige Vermögensgegenstände	2 582 474,77	0,65
II. Verbindlichkeiten		
1. Sonstige Verbindlichkeiten	- 3 429 081,16	- 0,86
III. Fondsvermögen	399 604 949,47	100,00

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

DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

Vermögensaufstellung zum 30.6.2020

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						378 588 498,46	94,74
Vorzinsliche Wertpapiere							
1,75 % 3M Co 2015/2030	EUR	3 890 000			% 113,162	4 401 982,35	1,10
2,125 % Aeroports de Paris 2018/2038	EUR	1 500 000			% 106,889	1 603 327,50	0,40
1,125 % Aeroports de Paris 2019/2034	EUR	3 700 000			% 96,943	3 586 891,00	0,90
1,5 % Aeroports de Paris 2020/2032	EUR	1 000 000	1 000 000		% 100,199	1 001 990,00	0,25
1,375 % Air Liquide Finance SA 2020/2030	EUR	300 000	300 000		% 109,380	328 138,50	0,08
0,8 % Air Products and Chemicals Inc 2020/2032	EUR	770 000	770 000		% 100,728	775 601,75	0,19
0,875 % Alliant NV 2019/2032	EUR	1 190 000			% 106,122	1 262 851,80	0,32
0,5 % Allianz Finance II BV (MTN) 2020/2031	EUR	3 400 000	3 400 000		% 100,866	3 429 444,00	0,87
2,75 % Anheuser-Busch InBev SA/NV 2016/2036	EUR	4 530 000		2 000 000	% 110,579	5 009 228,70	1,26
3,7 % Anheuser-Busch InBev SA/NV 2020/2040	EUR	380 000	380 000		% 121,430	461 432,10	0,12
0,5 % Apple, Inc. 2019/2031	EUR	3 100 000			% 102,112	3 165 456,50	0,79
1,625 % APRR SA 2017/2032	EUR	1 200 000			% 109,570	1 314 834,00	0,33
2,45 % AT&T Inc 2015/2035	EUR	2 240 000			% 106,429	2 383 998,40	0,60
3,15 % AT&T Inc 2017/2036	EUR	1 200 000			% 113,359	1 360 308,00	0,34
3,55 % AT&T, Inc. 2012/2032	EUR	820 000		1 140 000	% 120,220	985 799,90	0,25
1,8 % AT&T, Inc. 2019/2039	EUR	1 120 000			% 93,908	1 051 769,60	0,26
2,6 % AT&T, Inc. 2020/2038	EUR	620 000	620 000		% 105,866	656 369,20	0,16
0,625 % AusNet Services Holdings Pty Ltd. (MTN) 2020/2030	EUR	760 000	760 000		% 100,910	766 916,00	0,19
1,25 % Banque Federative du Credit Mutuel SA (MTN) 2020/2030	EUR	900 000	900 000		% 102,968	926 712,00	0,23
0,875 % BASF SE 2016/2031	EUR	2 060 000			% 103,723	2 136 683,50	0,53
1,625 % BASF SE 2017/2037	EUR	2 150 000			% 111,053	2 387 639,50	0,60
1,625 % Berkshire Hathaway Inc 2015/2035	EUR	1 860 000			% 112,924	2 100 377,10	0,53
1,5 % BMW Finance NV (MTN) 2019/2029	EUR	1 310 000			% 105,118	1 377 045,80	0,34
0,875 % BMW Finance NV 2020/2032	EUR	1 000 000	1 000 000		% 101,558	1 015 580,00	0,25
1,375 % BNP Paribas SA (MTN) 2019/2029	EUR	1 700 000			% 104,434	1 775 378,00	0,44
1,104 % BP Capital Markets PLC 2019/2034	EUR	1 020 000			% 94,624	965 164,80	0,24
0,625 % BPCE SA (MTN) 2020/2030	EUR	1 500 000	1 500 000		% 101,567	1 523 505,00	0,38
1,75 % Bristol-Myers Squibb Co 2015/2035	EUR	2 591 000			% 113,674	2 945 280,39	0,74
0,01 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (MTN) 2016/2026	EUR	6 500 000			% 104,257	6 776 672,50	1,70
1,25 % Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2017/2048	EUR	15 000 000			% 135,809	20 371 350,00	5,11
0,75 % Cadent Finance PLC (MTN) 2020/2032	EUR	620 000	620 000		% 97,964	607 373,70	0,15
2,5 % Chubb INA Holdings Inc 2018/2038	EUR	1 460 000			% 115,403	1 684 876,50	0,42
1,4 % Chubb INA Holdings Inc 2019/2031	EUR	1 000 000			% 103,584	1 035 835,00	0,26
1,25 % Citigroup Inc (MTN) 2019/2029	EUR	1 690 000			% 104,109	1 759 442,10	0,44
1,1 % Coca-Cola Co/The 2016/2036	EUR	1 960 000			% 103,142	2 021 573,40	0,51
1,25 % Coca-Cola Co/The 2019/2031	EUR	1 640 000			% 106,743	1 750 577,00	0,44
2,125 % Coentreprise de Transport d'Electricite SA 2017/2032	EUR	2 300 000			% 112,932	2 597 436,00	0,65
1,375 % Colgate-Palmolive Co 2019/2034	EUR	2 580 000			% 112,718	2 908 111,50	0,73
0,875 % Colgate-Palmolive Co 2019/2039	EUR	2 100 000			% 102,265	2 147 554,50	0,54
1,25 % Comcast Corp 2020/2040	EUR	1 180 000	1 180 000		% 96,855	1 142 889,00	0,29
1,125 % Cooperatieve Rabobank UA 2019/2031	EUR	2 400 000			% 104,583	2 509 992,00	0,63
1 % Credit Agricole SA (MTN) 2019/2029	EUR	1 300 000			% 106,695	1 387 035,00	0,35
1,75 % Credit Agricole SA/London (MTN) 2019/2029	EUR	1 000 000			% 107,717	1 077 165,00	0,27
0,65 % Credit Suisse Group AG (MTN) 2019/2029	EUR	1 110 000			% 97,330	1 080 363,00	0,27
2,125 % Daimler AG 2017/2037	EUR	3 020 000		1 460 000	% 104,438	3 154 012,50	0,79
2 % Daimler AG 2019/2031	EUR	2 000 000			% 104,652	2 093 030,00	0,52
1,375 % Deutsche Bahn Finance GmbH (MTN) 2020/2040	EUR	1 240 000	1 240 000		% 106,157	1 316 340,60	0,33
0,875 % Deutsche Bahn Finance GmbH 2020/2039	EUR	2 250 000	2 250 000		% 97,300	2 189 238,75	0,55
1 % Deutsche Post AG 2020/2032	EUR	2 090 000	2 090 000		% 103,276	2 158 457,95	0,54
1,35 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2039	EUR	2 530 000			% 95,469	2 415 365,70	0,60
1,8 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2049	EUR	1 150 000	1 150 000		% 96,040	1 104 460,00	0,28
1,8 % DH Europe Finance II Sarl 2019/2049	EUR	2 280 000			% 96,040	2 189 712,00	0,55
1,625 % E.ON SE (MTN) 2017/2029	EUR	1 490 000		920 000	% 108,413	1 615 346,25	0,40
0,35 % E.ON SE (MTN) 2019/2030	EUR	1 730 000			% 96,928	1 676 845,75	0,42
0,625 % E.ON SE (MTN) 2019/2031	EUR	990 000			% 98,184	972 021,60	0,24
0,875 % E.ON SE (MTN) 2020/2031	EUR	1 240 000	1 240 000		% 100,934	1 251 581,60	0,31
1,7 % Eli Lilly & Co. 2019/2049	EUR	4 080 000			% 104,164	4 249 891,20	1,06
2,125 % Eli Lilly and Co 2015/2030	EUR	1 820 000			% 116,909	2 127 743,80	0,53
6,125 % EnBW International Finance BV (MTN) 2009/2039	EUR	2 000 000			% 180,211	3 604 210,00	0,90
1,875 % EnBW International Finance BV (MTN) 2018/2033	EUR	3 193 000			% 116,856	3 731 196,12	0,94
1,125 % Enel Finance International NV 2019/2034	EUR	2 480 000			% 103,580	2 568 784,00	0,64
0,625 % Enxsis Holding NV (MTN) 2020/2032	EUR	1 620 000	1 620 000		% 101,475	1 643 895,00	0,41
1,5 % Engie SA 2015/2035	EUR	2 200 000			% 105,644	2 324 168,00	0,58
1,375 % Engie SA 2019/2039	EUR	2 000 000			% 101,642	2 032 830,00	0,51
1,25 % Engie SA 2019/2041	EUR	3 500 000			% 98,560	3 449 600,00	0,86
0,625 % Eni SpA (MTN) 2020/2030	EUR	1 540 000	1 540 000		% 97,736	1 505 126,70	0,38
1 % Eni SpA 2019/2034	EUR	2 130 000			% 99,285	2 114 770,50	0,53
2 % Eni SpA 2020/2031	EUR	1 030 000	1 030 000		% 110,375	1 136 857,35	0,28
1,375 % Equinor ASA (MTN) 2020/2032	EUR	660 000	660 000		% 106,408	702 289,50	0,18
2,125 % ESB Finance DAC 2018/2033	EUR	1 500 000			% 116,471	1 747 065,00	0,44
0,75 % EssilorLuxottica SA 2019/2031	EUR	1 800 000			% 101,080	1 819 440,00	0,46
1,5 % Euroclear Investments SA 2018/2030	EUR	1 300 000			% 109,227	1 419 944,50	0,36

DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1,75 % Exor NV 2019/2034	EUR	1 980 000			%	92,168	1 824 926,40	0,46
1,408 % Exxon Mobil Corp 2020/2039	EUR	5 660 000	5 660 000		%	98,893	5 597 315,50	1,41
6,025 % GE Capital European Funding Unlimited Co 2008/2038								
1,625 % Gecina SA 2019/2034	EUR	1 220 000			%	130,172	1 588 092,30	0,40
1,75 % GlaxoSmithKline Capital PLC 2018/2030	EUR	1 600 000			%	103,435	1 654 960,00	0,41
3 % Goldman Sachs Group Inc/The 2016/2031	EUR	3 000 000			%	112,264	3 367 905,00	0,84
1,875 % Heathrow Funding Ltd (MTN) 2019/2034	EUR	1 440 000			%	118,415	1 705 176,00	0,43
2,25 % Heineken NV (MTN) 2020/2030	EUR	2 310 000			%	101,401	2 342 351,55	0,59
1,75 % Heineken NV (MTN) 2020/2040	EUR	370 000	370 000		%	113,244	419 002,80	0,10
3 % Illinois Tool Works Inc 2014/2034	EUR	1 510 000	1 510 000		%	100,440	1 516 644,00	0,38
1 % Illinois Tool Works Inc 2019/2031	EUR	1 370 000			%	125,819	1 723 720,30	0,43
2,5 % ING Groep NV (MTN) 2018/2030	EUR	2 040 000			%	102,867	2 098 486,80	0,53
1,5 % innogy Finance BV 2018/2029	EUR	1 500 000			%	118,520	1 777 792,50	0,44
1,75 % International Business Machines Corp 2019/2031	EUR	1 310 000			%	107,260	1 405 106,00	0,35
1,2 % International Business Machines Corp. 2020/2040	EUR	3 170 000			%	109,187	3 461 212,05	0,87
1,5 % Investor AB (MTN) 2019/2039	EUR	3 060 000	3 060 000		%	95,820	2 932 076,70	0,73
1,5 % Investor AB 2018/2030	EUR	1 810 000			%	106,025	1 919 043,45	0,48
0,875 % Italgas SpA 2019/2030	EUR	2 500 000			%	107,816	2 695 387,50	0,67
1 % Italgas SpA 2019/2031	EUR	2 280 000			%	101,290	1 245 867,00	0,31
2,2 % John Deere Cash Management SA (MTN) 2020/2032	EUR	570 000	1 140 000	570 000	%	113,341	646 043,70	0,16
1,65 % John Deere Cash Management SA 2019/2039	EUR	2 620 000			%	107,129	2 806 766,70	0,70
1,65 % Johnson & Johnson 2016/2035	EUR	4 670 000			%	117,650	5 494 231,65	1,37
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2031 *	EUR	2 430 000			%	100,214	2 435 200,20	0,61
1 % JPMorgan Chase & Co. (MTN) 2019/2032 *	EUR	4 370 000			%	100,337	4 384 726,90	1,10
1,625 % KKR Group Finance Co., V LLC -Reg- (MTN) 2019/2029	EUR	1 000 000			%	101,569	1 015 685,00	0,25
1,375 % La Poste SA (MTN) 2020/2032	EUR	1 200 000	1 200 000		%	105,506	1 266 072,00	0,32
1 % La Poste SA 2019/2034	EUR	2 600 000			%	100,353	2 609 165,00	0,65
0,55 % Linde Finance BV 2020/2032	EUR	2 700 000	2 700 000		%	100,504	2 713 594,50	0,68
0,375 % LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 2020/2031	EUR	3 500 000	3 500 000		%	98,096	3 433 342,50	0,86
1,979 % Marsh & McLennan Cos Inc 2019/2030	EUR	1 190 000			%	110,426	1 314 063,45	0,33
1,625 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2031	EUR	1 230 000			%	109,074	1 341 610,20	0,34
2,25 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2039	EUR	2 500 000			%	112,507	2 812 675,00	0,70
1,75 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2049	EUR	1 380 000			%	97,658	1 347 680,40	0,34
1,75 % Medtronic Global Holdings SCA 2019/2049	EUR	1 160 000	1 160 000		%	97,658	1 132 832,80	0,28
0,875 % Merck Financial Services GmbH (MTN) 2019/2031	EUR	3 100 000			%	102,595	3 180 429,50	0,80
1,5 % Nestle Finance International Ltd (MTN) 2020/2030	EUR	400 000	400 000		%	110,520	442 078,00	0,11
1,75 % Nestle Finance International Ltd 2017/2037	EUR	2 050 000			%	119,147	2 442 513,50	0,61
1,375 % Novartis Finance SA 2018/2030	EUR	1 630 000			%	110,307	1 798 004,10	0,45
1,7 % Novartis Finance SA 2018/2038	EUR	1 470 000	1 470 000		%	117,302	1 724 323,05	0,43
2,375 % OMV AG (MTN) 2020/2032	EUR	1 920 000	1 920 000		%	114,791	2 203 977,60	0,55
1 % OMV AG 2019/2034	EUR	2 460 000			%	97,983	2 410 369,50	0,60
1,375 % Orange SA (MTN) 2019/2049	EUR	1 000 000			%	95,984	959 840,00	0,24
1,625 % Orange SA (MTN) 2020/2032	EUR	500 000	500 000		%	108,578	542 890,00	0,14
8,125 % Orange SA 2003/2033	EUR	1 010 000			%	181,617	1 834 331,70	0,46
1,875 % Orange SA 2018/2030	EUR	1 900 000			%	112,176	2 131 344,00	0,53
1,125 % PepsiCo Inc 2019/2031	EUR	4 500 000			%	105,906	4 765 747,50	1,20
0,875 % PepsiCo Inc 2019/2039	EUR	2 580 000			%	98,583	2 543 441,40	0,64
0,875 % Pernod Ricard SA 2019/2031	EUR	500 000			%	99,117	495 582,50	0,12
1,875 % Procter & Gamble Co/The 2018/2038	EUR	3 620 000			%	120,573	4 364 724,50	1,09
1,5 % Prologis Euro Finance LLC 2019/2049	EUR	1 880 000			%	95,711	1 799 357,40	0,45
1 % Prologis Euro Finance LLC 2020/2035	EUR	1 870 000	1 870 000		%	97,077	1 815 339,90	0,45
1,625 % Prologis International Funding II SA (MTN) 2020/2032	EUR	315 000	315 000		%	104,548	329 326,20	0,08
1,5 % Richemont International Holding SA 2018/2030	EUR	960 000			%	109,479	1 050 993,60	0,26
2 % Richemont International Holding SA 2018/2038	EUR	1 540 000			%	113,031	1 740 669,70	0,44
1,625 % Richemont International Holding SA 2020/2040	EUR	1 380 000	1 380 000		%	102,650	1 416 570,00	0,35
2,979 % Robert Bosch Investment Nederland BV 2013/2033	EUR	400 000			%	129,731	518 924,00	0,13
1,125 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR (MTN) 2019/2049	EUR	2 100 000	800 000		%	99,336	2 086 045,50	0,52
1,875 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 2017/2037	EUR	1 200 000			%	116,772	1 401 264,00	0,35
2,125 % RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 2018/2038	EUR	900 000			%	121,597	1 094 368,50	0,27
1,375 % Sanofi 2018/2030	EUR	1 600 000			%	110,463	1 767 408,00	0,44
1,875 % Sanofi 2018/2038	EUR	1 700 000			%	119,029	2 023 484,50	0,51
1,25 % Sanofi 2019/2034	EUR	1 300 000			%	111,026	1 443 331,50	0,36
1,375 % SAP SE 2018/2030	EUR	1 900 000			%	109,588	2 082 172,00	0,52
1,625 % SAP SE 2018/2031	EUR	1 500 000			%	112,225	1 683 367,50	0,42
2 % Schlumberger Finance BV 2020/2032	EUR	1 300 000	1 300 000		%	106,956	1 390 428,00	0,35
0,5 % Siemens Financieringsmaatschappij NV (MTN) 2019/2034	EUR	1 130 000			%	96,024	1 085 071,20	0,27
1,375 % Siemens Financieringsmaatschappij NV 2018/2030	EUR	1 300 000			%	108,952	1 416 369,50	0,35
1,75 % Siemens Financieringsmaatschappij NV 2019/2039	EUR	3 990 000			%	111,676	4 455 852,45	1,12
1 % Snam SpA 2019/2034	EUR	660 000			%	100,880	665 808,00	0,17
0,5 % Stedin Holding NV (MTN) 2019/2029	EUR	970 000			%	100,112	971 081,55	0,24
2,625 % Stryker Corp 2018/2030	EUR	1 340 000			%	114,793	1 538 226,20	0,38
1 % Stryker Corp. 2019/2031	EUR	2 090 000			%	98,909	2 067 198,10	0,52
1,625 % Suez SA 2018/2030	EUR	1 500 000			%	109,557	1 643 347,50	0,41
0,5 % Suez SA 2019/2031	EUR	2 100 000			%	97,689	2 051 469,00	0,51

DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Nominalbetrag bzw. Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
1,25 % Suez SA 2020/2035	EUR	2 200 000	2 200 000	%	101,721	2 237 851,00	0,56	
2 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd 2020/2040	EUR	0	2 190 000	%	99,513	2 179 334,70	0,55	
3 % Takeda Pharmaceutical Co., Ltd -Reg- 2018/2030	EUR	3 000 000		%	117,552	3 526 545,00	0,88	
1,75 % Telenor ASA 2019/2034	EUR	2 070 000		%	110,958	2 296 820,25	0,57	
0,875 % Telenor ASA 2020/2035	EUR	2 140 000	2 140 000	%	98,424	2 106 262,90	0,53	
1,625 % Telia Co AB 2015/2035	EUR	4 500 000		%	102,903	4 630 612,50	1,16	
1,375 % Telstra Corp., Ltd (MTN) 2019/2029	EUR	2 300 000		%	107,247	2 466 669,50	0,62	
1,5 % TenneT Holding BV (MTN) 2019/2039	EUR	4 760 000		2 740 000	%	108,473	5 163 291,00	1,29
2,875 % Thermo Fisher Scientific Inc 2017/2037	EUR	1 000 000		%	121,578	1 215 780,00	0,30	
1,5 % Thermo Fisher Scientific Inc 2019/2039	EUR	2 120 000		%	98,295	2 083 843,40	0,52	
1,875 % Thermo Fisher Scientific, Inc. (MTN) 2019/2049	EUR	1 720 000		%	95,756	1 646 994,60	0,41	
1,875 % Thermo Fisher Scientific, Inc. 2019/2049	EUR	970 000	970 000	%	95,756	928 828,35	0,23	
1,994 % Total Capital International SA (MTN) 2020/2032	EUR	800 000	800 000	%	112,854	902 828,00	0,23	
1,535 % Total Capital International SA 2019/2039	EUR	4 700 000		%	105,203	4 944 541,00	1,24	
1,618 % Total Capital International SA 2020/2040	EUR	1 600 000	1 600 000	%	104,263	1 668 200,00	0,42	
2,25 % Unibail-Rodamco-Westfield SE 2018/2038	EUR	1 600 000		%	100,182	1 602 912,00	0,40	
1,75 % Unibail-Rodamco-Westfield SE 2019/2049	EUR	1 900 000		200 000	%	86,216	1 638 094,50	0,41
1,625 % Unilever NV (MTN) 2018/2033	EUR	3 690 000		%	114,983	4 242 854,25	1,06	
1,5 % Unilever PLC 2019/2039	EUR	1 630 000		%	113,352	1 847 629,45	0,46	
1,94 % Veolia Environnement SA 2018/2030	EUR	1 700 000		%	111,493	1 895 381,00	0,47	
0,8 % Veolia Environnement SA 2020/2032	EUR	1 400 000	1 400 000	%	100,050	1 400 693,00	0,35	
2,625 % Verizon Communications Inc 2014/2031	EUR	3 200 000		%	117,493	3 759 776,00	0,94	
1,85 % Verizon Communications Inc 2020/2040	EUR	910 000	910 000	%	102,372	931 580,65	0,23	
2,875 % Verizon Communications, Inc. 2017/2038	EUR	2 860 000		%	120,540	3 447 444,00	0,86	
2,5 % Vodafone Group PLC (MTN) 2019/2039	EUR	2 890 000		%	110,559	3 195 155,10	0,80	
1,125 % Vonovia Finance BV 2019/2034	EUR	1 500 000		%	97,318	1 459 770,00	0,37	
1,625 % Vonovia Finance BV 2019/2039	EUR	2 700 000	1 000 000	%	98,748	2 666 196,00	0,67	
1,823 % Wintershall Dea Finance BV 2019/2031	EUR	1 400 000		%	93,935	1 315 083,00	0,33	
1,625 % Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 2019/2039	EUR	3 230 000		%	111,024	3 586 059,05	0,90	
Summe Wertpapiervermögen						378.588.498,46	94,74	
Derivate								
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)								
Swaps						5 065 471,03	1,27	
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Zinsswaps								
6M Euribor / 0.014% 06/18/2060 (OTC) (DB)	Stück	17 700 000				317 396,40	0,08	
6M Euribor / 0.048% 06/18/2035 (OTC) (DB)	Stück	40 500 000				- 284 447,70	- 0,07	
6M Euribor / 0.086% 06/18/2050 (OTC) (DB)	Stück	9 300 000				145 101,39	0,04	
6M Euribor / 0.116% 06/18/2045 (OTC) (DB)	Stück	10 900 000				134 673,86	0,03	
6M Euribor / 0.12% 06/18/2040 (OTC) (DB)	Stück	7 500 000				- 72 778,50	- 0,02	
6M Euribor / 1% 06/18/2030 (OTC) (DB)	Stück	78 000 000				- 359 603,40	- 0,09	
6M Euribor / 1% 06/18/2070 (OTC) (DB)	Stück	5 200 000				69 984,20	0,02	
6M Euribor / 1.295% 09/12/2046 (OTC) (DB)	Stück	15 700 000				5 115 144,78	1,28	
Bankguthaben						16 797 586,37	4,20	
EUR-Guthaben	EUR					16 797 586,37	4,20	
Sonstige Vermögensgegenstände						2 582 474,77	0,65	
Zinsansprüche						2 553 660,81	0,64	
Sonstige Ansprüche						28 813,96	0,01	
Summe der Vermögensgegenstände **						403 034 030,63	100,86	
Sonstige Verbindlichkeiten						- 3 429 081,16	- 0,86	
Andere sonstige Verbindlichkeiten						- 3 429 081,16	- 0,86	
Summe der Verbindlichkeiten						- 3 429 081,16	- 0,86	
Fondsvermögen						399 604 949,47	100,00	

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

Eine Aufstellung über die während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, ist auf Anforderung kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Währung	Anteilwert in der jeweiligen Währung
Anteilwert		
Klasse D	EUR	109,56
Umlaufende Anteile		
Klasse D	Stück	3 647 468,396

DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

Zusammensetzung des Referenzportfolios (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

Zusammenstellung aus inflationsbereinigten und normalen Zero-Coupon Anleihen mit Laufzeiten zwischen 1 und 100 Jahren

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (gem. CSSF-Rundschreiben 11/512)

kleinster potenzieller Risikobetrag	%	58,441
größter potenzieller Risikobetrag	%	115,979
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	%	84,047

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 1.1.2020 bis 30.6.2020 auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99% Konfidenzniveau, 10 Tage Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraumes von einem Jahr berechnet. Als Bewertungsmaßstab wird das Risiko eines derivatfreien Vergleichsvermögens herangezogen. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigsten Entwicklung von Marktpreisen für das Fondsvermögen ergibt. Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Gesellschaft den **relativen Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an.

Die durchschnittliche Hebelwirkung aus der Nutzung von Derivaten betrug im Berichtszeitraum 0,1, wobei zur Berechnung die Summe der Nominalbeträge der Derivate in Relation zum Fondsvermögen gesetzt wurde (Nominalwertmethode).

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure gem. Punkt 40 a) der „Leitlinien zu börsengehandelten Indexfonds und anderen OGAW-Themen“ der European Securities and Markets Authority (ESMA) belief sich zum Berichtsstichtag unter Zugrundelegung einer Bruttobetrachtung auf EUR 191 882 265,08.

Marktschlüssel

Vertragspartner der Derivate (mit Ausnahme von Devisentermingeschäften)

DB = Deutsche Bank AG

Erläuterung zur Bewertung

Die Anteilswerte werden in Verantwortung des Verwaltungsrats der SICAV durch die Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den vom Verwaltungsrat der SICAV auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen / Verordnungen bzw. im Prospekt der SICAV definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

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

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

Fußnoten

* Variabler Zinssatz.

** Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

DB Advisors, SICAV – 30.6.2020

Konsolidierte Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 30. Juni 2020				
	DB Advisors SICAV		DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy EUR	DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy EUR
	EUR *			
	Konsolidiert	% Anteil am Fonds- vermögen		
Vermögenswerte				
Summe Wertpapiervermögen	8 743 670 736,99	95,10	378 588 498,46	6 087 862 838,22
Devisen-Derivate	1 387 116,72	0,02	0,00	1 387 116,72
Swaps	128 973 403,41	1,40	5 065 471,03	31 914 448,09
Bankguthaben	429 486 662,81	4,67	16 797 586,37	321 766 097,75
Sonstige Vermögensgegenstände	84 486 969,51	0,92	2 582 474,77	60 640 828,09
Summe der Vermögenswerte **	9 388 004 889,44	102,11	403 034 030,63	6 503 571 328,87
Verbindlichkeiten				
Aktienindex-Derivate	- 2 785 954,90	- 0,03	0,00	- 2 785 954,90
Zins-Derivate	- 405 051,67	0,00	0,00	- 38 281,67
Devisen-Derivate	- 298 844,58	0,00	0,00	0,00
Kurzfristige Verbindlichkeiten	- 106 590 837,34	- 1,16	0,00	- 51 973 739,46
Sonstige Verbindlichkeiten	- 83 356 485,02	- 0,92	- 3 429 081,16	- 61 917 863,23
Summe der Verbindlichkeiten **	- 193 437 173,51	- 2,11	- 3 429 081,16	- 116 715 839,26
Fondsvermögen	9 194 567 715,93	100,00	399 604 949,47	6 386 855 489,61

Konsolidierte Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 30. Juni 2020		
	DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy EUR	DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy EUR
	Vermögenswerte	
Summe Wertpapiervermögen	379 287 547,30	1 897 931 853,01
Devisen-Derivate	0,00	0,00
Swaps	71 176 923,74	20 816 560,55
Bankguthaben	5 637 319,65	85 285 659,04
Sonstige Vermögensgegenstände	4 135 017,38	17 128 649,27
Summe der Vermögenswerte **	460 236 808,07	2 021 162 721,87
Verbindlichkeiten		
Aktienindex-Derivate	0,00	0,00
Zins-Derivate	- 366 770,00	0,00
Devisen-Derivate	- 298 844,58	0,00
Kurzfristige Verbindlichkeiten	- 19 254 797,10	- 35 362 300,78
Sonstige Verbindlichkeiten	- 583 969,15	- 17 425 571,48
Summe der Verbindlichkeiten **	- 20 504 380,83	- 52 787 872,26
Fondsvermögen	439 732 427,24	1 968 374 849,61

* Das konsolidierte Fondsvermögen, die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie die Entwicklung des Fondsvermögens entsprechen der Summe der Ergebnisse der einzelnen Teilfonds. Im Falle von Anlagen zwischen Teilfonds (bei denen ein Teilfonds in einen anderen Teilfonds desselben Umbrellafonds investiert) waren die entsprechenden Konten des Fonds nicht Gegenstand einer Eliminierung für Zwecke der konsolidierten Ergebnisdarstellung.

** Im Falle von Derivaten bzw. Termingeschäften enthält der als Summe der Vermögenswerte ausgewiesene Betrag den positiven Nettoüberhang der saldierten Einzelpositionen innerhalb der gleichen Produktkategorie, während negative Überhänge unter der Summe der Verbindlichkeiten subsumiert werden.

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	224 114 122,91		
in % des Fondsvermögens	3,51%		
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	Goldman Sachs Int.	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	59 112 921,96		
Sitzstaat	USA	-	-
2. Name	Citigroup Global Markets Limited FI	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	59 077 765,30		
Sitzstaat	USA	-	-
3. Name	Deutsche Bank AG FI	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	40 521 272,81		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland	-	-
4. Name	Barclays Capital Securities Limited	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	32 986 397,00		
Sitzstaat	Vereinigtes Königreich	-	-
5. Name	Morgan Stanley Europe SE FI	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	8 801 140,85		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland	-	-
6. Name	Zuercher Kantonalbank	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	7 490 894,83		
Sitzstaat	Schweiz	-	-
7. Name	Unicredit Bank AG	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	5 293 077,97		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland	-	-
8. Name	Merrill Lynch International	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	4 294 173,00		
Sitzstaat	USA	-	-
9. Name	BofA Securities Europe SA EQ	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	2 464 575,00		
Sitzstaat	Frankreich	-	-

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

10. Name	BNP Paribas S.A.	-	-
Bruttovolumen offene Geschäfte	2 407 694,80		
Sitzstaat	Frankreich	-	-

3. Art(en) von Abwicklung und Clearing

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

4. Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche			
1 Woche bis 1 Monat			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr			
über 1 Jahr			
unbefristet	224 114 122,91		

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

Art(en):			
Bankguthaben			
Schuldverschreibungen	209 493 023,07		
Aktien	47 262 126,01		
Sonstige			
Qualität(en):	<p>Dem Fonds werden – soweit Wertpapier-Darlehensgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte oder Geschäfte mit OTC-Derivaten (außer Währungstermingeschäften) abgeschlossen werden – Sicherheiten in einer der folgenden Formen gestellt:</p> <ul style="list-style-type: none"> - 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. <p>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.</p> <p>Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds.</p>		

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten		
Wahrung(en):	AUD, CAD, CHF, DKK, EUR, GBP, JPY, MXN, NOK, USD	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)		
unter 1 Tag		
1 Tag bis 1 Woche		
1 Woche bis 1 Monat		
1 bis 3 Monate		
3 Monate bis 1 Jahr		
uber 1 Jahr		
unbefristet	256 755 149,08	
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)		
Ertragsanteil des Fonds		
absolut	615 787,40	
in % der Bruttoertrage	67,00%	
Kostenanteil des Fonds	-	
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft		
absolut	307 893,70	
in % der Bruttoertrage	33,00%	
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	
Ertragsanteil Dritter		
absolut		
in % der Bruttoertrage		
Kostenanteil Dritter		
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
absolut		
10. Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds		
Summe	224 114 122,91	
Anteil	3,68%	
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
1. Name	European Stability Mechanism	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	42 987 033,94	
2. Name	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	39 090 821,29	

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

3. Name	French Republic Government Bond OAT	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	31 512 490,26		
4. Name	European Financial Stability Facility	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	22 886 547,13		
5. Name	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	22 260 025,70		
6. Name	European Investment Bank	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	16 321 264,66		
7. Name	European Union	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	8 639 049,35		
8. Name	Banco Santander SA	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 735 620,28		
9. Name	Scentre Group	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2 862 167,89		
10. Name	Council Of Europe Development Bank	-	-
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2 837 990,80		
12. Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
Anteil			
13. Verwahrt begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps (In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps)			
gesonderte Konten / Depots	Nicht anwendbar, da keine Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihegeschäften gewährt wurden.		
Sammelkonten / Depots			
andere Konten / Depots			
Verwahrt bestimmt Empfänger			

DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy

14. Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer	1		
1. Name	State Street Bank International GmbH, Zweigniederlassung Luxembourg	-	-
verwahrter Betrag absolut	256 755 149,08		
2. Name	-	-	-
verwahrter Betrag absolut			

DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy

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

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gemäß der o.g. rechtlichen Bestimmung vor.

DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy

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

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gemäß der o.g. rechtlichen Bestimmung vor.

DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy

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

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gemäß der o.g. rechtlichen Bestimmung vor.

Investmentgesellschaft

DB Advisors, SICAV
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxemburg, Luxemburg
RC B 145 884

Verwaltungsrat der Investmentgesellschaft

Thilo Hubertus Wendenburg
Vorsitzender
Unabhängiges Mitglied
Frankfurt am Main

Patrick Basner
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Michael Koschatzki
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Gerd Wagner
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Registerstelle, Transferstelle und Hauptvertriebsstelle

DWS Investment S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxemburg, Luxemburg
Eigenkapital per 31.12.2019: 331,1 Mio. Euro
vor Gewinnverwendung

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

Claire Peel
Vorsitzende (seit dem 22.6.2020)
DWS Management GmbH,
Frankfurt am Main

Stefan Kreuzkamp
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Frank Krings
Deutsche Bank Luxembourg S.A.,
Luxemburg

Dr. Matthias Liermann
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Holger Naumann
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Nikolaus von Tippelskirch (bis zum 10.6.2020)
DWS Management GmbH,
Frankfurt am Main

Vorstand der Verwaltungsgesellschaft

Nathalie Bausch
Vorsitzende (seit dem 1.7.2020)
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Manfred Bauer (bis zum 30.6.2020)
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Dr. Stefan Junglen (seit dem 6.1.2020)
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Barbara Schots
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Poolmanager

für die Pools und Overlays TAA, TAA II, TAA III, Euroland Government Bonds, Corporate Bonds Euroland, ESG Corporate Bonds, US High Yield Bonds, Alternative Investments, Alternative Investments II, USD Investment Grade Corporate Bonds, ILS Overlay, ILS Overlay II, IRS Overlay, IRS Overlay II, Credit Overlay, Emerging Markets Sovereign Bonds, Government Bonds, Corporate Bonds, IRS Overlay PB, Euroland Government Bonds PB, EUR Corporate Bonds PB, USD Corporate Bonds PB, USD Investment Grade Corporate Bonds II und Euro Government Bonds BSPK:

DB Advisors SICAV
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxemburg, Luxemburg

Anlageberater

für die Pools und Overlays TAA, TAA II, TAA III, Euroland Government Bonds, Corporate Bonds Euroland, ESG Corporate Bonds, US High Yield Bonds, Alternative Investments, Alternative Investments II, USD Investment Grade Corporate Bonds, ILS Overlay, ILS Overlay II, IRS Overlay, IRS Overlay II, Credit Overlay, Emerging Markets Sovereign Bonds, Government Bonds, Corporate Bonds, IRS Overlay PB, Euroland Government Bonds PB, EUR Corporate Bonds PB, USD Corporate Bonds PB, USD Investment Grade Corporate Bonds II und Euro Government Bonds BSPK:

DWS International GmbH
Mainzer Landstraße 11-17
60329 Frankfurt am Main, Deutschland

Anlageberater

Für die Teilfonds
DB Advisors NL Enhanced Fixed Income Strategy, DB Advisors PB Enhanced Fixed Income Strategy und DB Advisors BSPK Enhanced Fixed Income Strategy:

DWS International GmbH
Mainzer Landstraße 11–17
60329 Frankfurt am Main, Deutschland

Für den Teilfonds
DB Advisors Enhanced Fixed Income Strategy:

DWS International GmbH
Mainzer Landstraße 11–17
60329 Frankfurt am Main, Deutschland

und

DWS Investment Management Americas Inc.
345 Park Avenue,
New York, NY 10154
USA

Verwahrstelle und Subadministrator

State Street Bank International GmbH
Zweigniederlassung Luxemburg
49, Avenue John F. Kennedy
1855 Luxemburg, Luxemburg

Untertransferstelle

State Street Bank International GmbH
Brienner St. 59
80333 München, Deutschland

Abschlussprüfer

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

Rechtsberater

Linklaters LLP
35, Avenue John F. Kennedy
1855 Luxemburg, Luxemburg

Vertriebs- und Zahlstelle*

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

* weitere Vertriebs- und Zahlstellen, siehe Verkaufsprospekt

DB Advisors, SICAV
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxemburg, Luxemburg
RC B 145 884
Tel.: +352 4 21 01-1
Fax: +352 4 21 01-9 00