

Halbjahresbericht  
zum 30. April 2023.

# **Deka-Institutionell Renten Europa**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. April 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Institutionell Renten Europa für den Zeitraum vom 1. November 2022 bis zum 30. April 2023.

Auch mehr als ein Jahr nach dem russischen Überfall auf die Ukraine sind die Auswirkungen auf die verschiedenen Volkswirtschaften deutlich spürbar. Exorbitante Preissteigerungen sowie Befürchtungen vor Versorgungsengpässen sorgten zeitweise für große Verunsicherung. Der milde Winter und leicht rückläufige Teuerungsraten trugen jedoch sukzessive zu einer Entspannung bei. Zudem führte die abrupte Abkehr von der rigiden Null-Covid-Politik und entsprechender Lockdown-Maßnahmen in China zu einer Wiedererstarkung des globalen Handels. Andererseits schürte der Zusammenbruch mehrerer regionaler Finanzhäuser in den USA sowie der Notverkauf der Schweizer Großbank Credit Suisse an die UBS im März die Angst vor einer neuerlichen Bankenkrise.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtshalbjahr die dynamische Inflationsentwicklung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten zwang. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 4,75 Prozent bis 5,00 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen bis Ende April auf 3,50 Prozent an. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen bis Mitte Februar zunächst weiter an, ehe im späteren Verlauf in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken wieder Rückgänge zu konstatieren waren. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 3,4 Prozent.

An den etablierten globalen Aktienbörsen setzte sich die Erholungsbewegung unter Schwankungen im Wesentlichen fort. Unsicherheiten hinsichtlich der zukünftigen Energiesicherheit und der hohen Inflation in Kombination mit dem Krieg in der Ukraine wechselten sich mit unterstützenden Signalen, wie etwa der Hoffnung auf eine weniger aggressive Fortführung der restriktiven Geldpolitik in den USA, ab. Vor allem in Europa schlugen deutlich steigende Notierungen zu Buche. Der im Herbst unter Druck geratene Euro, der zeitweise unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, konnte sich bis Ende April signifikant auf 1,10 US-Dollar erholen.

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter [www.deka.de](http://www.deka.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

|   |    |
|---|----|
| Anlagepolitik                               | 5  |
| Vermögensübersicht zum 30. April 2023       | 6  |
| Vermögensaufstellung zum 30. April 2023     | 7  |
| Anhang                                      | 17 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 19 |

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

# Deka-Institutionell Renten Europa Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte bei gleichzeitiger Geringhaltung wirtschaftlicher Risiken.

Um dies zu erreichen legt der Fonds überwiegend in verzinsliche Wertpapiere von europäischen Emittenten (u.a. Staatsanleihen, Pfandbriefe und Unternehmensanleihen) an. Bei der Auswahl der Wertpapiere wird die Bonität der Emittenten berücksichtigt. Es werden nur Wertpapiere erworben, die auf Euro oder die Währung eines anderen Mitgliedstaates der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit (OECD) lauten. Fremdwährungsrisiken sind auf 20% des Fondsvermögens begrenzt und werden aktiv gemanagt.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental orientierte Investmentansatz kombiniert gezielt „Top-Down“ sowie „Bottom-Up“-Elemente. Die Basis stellt die Analyse makroökonomischer sowie (geo)politischer Parameter dar, ergänzt durch qualitative sowie quantitative fundamentale Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände, z.B. Bonitätsanalyse der Emittenten, relativer Vergleich der Wertpapiere mit anderen korrespondierenden Ausstellern. Um den Erfolg des Wertpapierauswahlprozesses zu bewerten wird der Index ICE BofA® Euro Broad Market in EUR <sup>1)</sup>verwendet. Die initiale und kontinuierliche Wertpapierauswahl erfolgt im Rahmen des beschriebenen Investmentansatzes unabhängig von diesem Referenzwert und damit verbundenen quantitativen oder qualitativen Einschränkungen.

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35% des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland investieren.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-Institutionell Renten Europa

| Performance* | 6 Monate     |
|--------------|--------------|
|              | 2,3%         |
| ISIN         | DE0007019416 |

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

1) Referenzindex: ICE BofA® Euro Broad Market1) in EUR: Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Index-Marke stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

# Deka-Institutionell Renten Europa

## Vermögensübersicht zum 30. April 2023.

| Gliederung nach Anlageart - Land                            | Kurswert<br>in EUR    | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|-----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                       |                              |
| <b>1. Anleihen</b>  | <b>254.743.160,38</b> | <b>84,21</b>                 |
| Belgien   | 20.608.274,00         | 6,82                         |
| Dänemark  | 17.305.884,00         | 5,71                         |
| Deutschland   | 35.820.301,91         | 11,84                        |
| Finnland  | 7.246.062,25          | 2,40                         |
| Frankreich  | 36.374.408,88         | 12,03                        |
| Großbritannien  | 2.816.180,27          | 0,93                         |
| Irland  | 2.571.090,63          | 0,85                         |
| Italien   | 29.161.560,76         | 9,64                         |
| Luxemburg   | 3.775.561,50          | 1,25                         |
| Niederlande   | 9.625.263,27          | 3,19                         |
| Norwegen  | 9.940.631,42          | 3,29                         |
| Österreich  | 9.722.918,88          | 3,22                         |
| Portugal  | 9.688.178,75          | 3,21                         |
| Rumänien  | 5.900.133,54          | 1,95                         |
| Slowakei  | 9.283.955,13          | 3,06                         |
| Sonstige  | 20.657.397,75         | 6,81                         |
| Spanien   | 17.770.803,38         | 5,87                         |
| Tschechische Republik                                       | 4.559.126,06          | 1,51                         |
| Zypern  | 1.915.428,00          | 0,63                         |
| <b>2. Derivate</b>  | <b>-2.343.936,03</b>  | <b>-0,75</b>                 |
| <b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>46.347.036,93</b>  | <b>15,31</b>                 |
| <b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>17.129.720,56</b>  | <b>5,67</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-13.444.125,29</b> | <b>-4,44</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>302.431.856,55</b> | <b>100,00</b>                |

| Gliederung nach Anlageart - Währung                         | Kurswert<br>in EUR    | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|-----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                       |                              |
| <b>1. Anleihen</b>  | <b>254.743.160,38</b> | <b>84,21</b>                 |
| CZK   | 2.177.460,56          | 0,72                         |
| DKK   | 12.566.079,00         | 4,15                         |
| EUR   | 225.515.370,42        | 74,55                        |
| GBP   | 5.046.304,29          | 1,67                         |
| HUF   | 2.110.886,15          | 0,70                         |
| NOK   | 6.347.781,42          | 2,10                         |
| USD   | 979.278,54            | 0,32                         |
| <b>2. Derivate</b>  | <b>-2.343.936,03</b>  | <b>-0,75</b>                 |
| <b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>46.347.036,93</b>  | <b>15,31</b>                 |
| <b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>17.129.720,56</b>  | <b>5,67</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-13.444.125,29</b> | <b>-4,44</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>302.431.856,55</b> | <b>100,00</b>                |

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

# Deka-Institutionell Renten Europa

## Vermögensaufstellung zum 30. April 2023.

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs      | Kurswert in EUR       | % des Fondsvermögens *) |
|-------------------------------------|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------------|-------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>244.231.117,73</b> | <b>80,74</b>            |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>     |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>244.231.117,73</b> | <b>80,74</b>            |
| <b>EUR</b>                          |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>216.003.290,04</b> | <b>71,41</b>            |
| ES0265936031                        | 5,2500 % ABANCA Corporación Bancaria SA FLR MTN 22/28                    | EUR   |                              | 700.000            | 0                                  | 700.000           | % 98,716  | 691.012,00            | 0,23                    |
| XS2435570895                        | 0,6250 % ABN AMRO Bank N.V. Cov. MTN 22/37                               | EUR   |                              | 3.500.000          | 0                                  | 0                 | % 70,790  | 2.477.650,00          | 0,82                    |
| ES0200002063                        | 0,5500 % Adif - Alta Velocidad MTN 21/31                                 | EUR   |                              | 1.800.000          | 0                                  | 0                 | % 77,162  | 1.388.907,00          | 0,46                    |
| FR0014005HY8                        | 0,3750 % Air Liquide Finance S.A. MTN 21/33                              | EUR   |                              | 900.000            | 0                                  | 0                 | % 74,478  | 670.297,50            | 0,22                    |
| FR001400EZL5                        | 3,2500 % Arkéa Public Sector SCF MT Obl.Fonc.Pu.S. 23/31                 | EUR   |                              | 1.300.000          | 1.300.000                          | 0                 | % 99,901  | 1.298.706,50          | 0,43                    |
| FR00140005T0                        | 0,1250 % Arkema S.A. MTN 20/26   | EUR   |                              | 500.000            | 0                                  | 0                 | % 89,920  | 449.597,50            | 0,15                    |
| FR001400FAZ5                        | 3,5000 % Arkema S.A. MTN 23/31   | EUR   |                              | 1.000.000          | 1.000.000                          | 0                 | % 97,111  | 971.105,00            | 0,32                    |
| FR0013516176                        | 0,2500 % AXA Bank Europe SCF MT Obl. Fonc. 20/40                         | EUR   |                              | 1.500.000          | 0                                  | 0                 | % 58,907  | 883.597,50            | 0,29                    |
| ES0413900913                        | 3,3750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 23/30                     | EUR   |                              | 2.000.000          | 2.000.000                          | 0                 | % 99,413  | 1.988.260,00          | 0,66                    |
| PTBSPAOM0008                        | 3,3750 % Banco Santander Totta S.A. MT Obr.Hip. 23/28                    | EUR   |                              | 1.800.000          | 1.800.000                          | 0                 | % 99,405  | 1.789.290,00          | 0,59                    |
| DE0008HY0GM2                        | 3,0000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 23/33                                   | EUR   |                              | 1.225.000          | 1.225.000                          | 0                 | % 99,047  | 1.213.325,75          | 0,40                    |
| FR001400FB22                        | 5,1250 % BPCE S.A. FLR MTN 23/35   | EUR   |                              | 1.300.000          | 1.300.000                          | 0                 | % 97,142  | 1.262.846,00          | 0,42                    |
| FR00140027U2                        | 0,7500 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 21/31                               | EUR   |                              | 1.000.000          | 0                                  | 0                 | % 77,563  | 775.630,00            | 0,26                    |
| FR0014009YC1                        | 2,3750 % BPCE S.A. Preferred MTN 22/32                                   | EUR   |                              | 3.100.000          | 0                                  | 0                 | % 87,659  | 2.717.413,50          | 0,90                    |
| FR001400F323                        | 5,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 23/33                         | EUR   |                              | 600.000            | 600.000                            | 0                 | % 98,398  | 590.385,00            | 0,20                    |
| FR001400A3G4                        | 2,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Non-Pref. MTN 22/29               | EUR   |                              | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 90,715  | 1.814.290,00          | 0,60                    |
| DE0001102614                        | 1,8000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/53                                | EUR   |                              | 1.625.000          | 1.625.000                          | 0                 | % 86,046  | 1.398.247,50          | 0,46                    |
| DE000BU32005                        | 2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl. Gruene 23/33                         | EUR   |                              | 3.175.000          | 3.175.000                          | 0                 | % 99,427  | 3.156.807,25          | 1,04                    |
| FR0014005MV4                        | 0,5000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 21/46               | EUR   |                              | 1.000.000          | 0                                  | 0                 | % 54,708  | 547.080,00            | 0,18                    |
| BE0002933142                        | 3,7500 % Communauté française Belgique MTN 23/33                         | EUR   |                              | 3.000.000          | 3.000.000                          | 0                 | % 102,456 | 3.073.665,00          | 1,02                    |
| XS2577836187                        | 2,8750 % Coöperatieve Rabobank U.A. MT Cov. Bds 23/33                    | EUR   |                              | 3.000.000          | 3.000.000                          | 0                 | % 97,513  | 2.925.390,00          | 0,97                    |
| FR001400FZ32                        | 3,1250 % Crédit Mu. Home Loan SFH SA MT Obl.Fin.Hab. 23/33 <sup>1)</sup> | EUR   |                              | 1.700.000          | 1.700.000                          | 0                 | % 98,308  | 1.671.227,50          | 0,55                    |
| FR0013511227                        | 0,8750 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 20/27                                   | EUR   |                              | 800.000            | 0                                  | 0                 | % 88,660  | 709.280,00            | 0,23                    |
| IT0005451759                        | 0,0100 % Credito Emiliano S.p.A. Mortg.Cov. Bds 21/28 <sup>1)</sup>      | EUR   |                              | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 83,640  | 1.672.790,00          | 0,55                    |
| XS1396367911                        | 0,8750 % Enxsis Holding N.V. MTN 16/26                                   | EUR   |                              | 900.000            | 0                                  | 0                 | % 93,150  | 838.350,00            | 0,28                    |
| AT0000A2UXN9                        | 0,5000 % Erste Group Bank AG MT Hyp.-Pfe. 22/37                          | EUR   |                              | 1.600.000          | 0                                  | 0                 | % 67,418  | 1.078.680,00          | 0,36                    |
| XS2579482006                        | 3,7500 % ESB Finance DAC MTN 23/43                                       | EUR   |                              | 625.000            | 625.000                            | 0                 | % 94,728  | 592.046,88            | 0,20                    |
| ES0457089029                        | 0,1250 % Eurocaja Rural, S.C.C. Cédulas Hipotec. 21/31                   | EUR   |                              | 1.600.000          | 0                                  | 0                 | % 76,412  | 1.222.592,00          | 0,40                    |
| EU000A2SCAG3                        | 2,8750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 23/33                        | EUR   |                              | 2.900.000          | 2.900.000                          | 0                 | % 98,311  | 2.851.019,00          | 0,94                    |
| EU000A3KTGW6                        | 0,7000 % Europaeische Union MTN 21/51                                    | EUR   |                              | 1.500.000          | 0                                  | 0                 | % 52,547  | 788.205,00            | 0,26                    |
| EU000A3K7MW2                        | 1,6250 % Europaeische Union MTN 22/29                                    | EUR   |                              | 1.050.000          | 1.050.000                          | 0                 | % 91,937  | 965.333,25            | 0,32                    |
| EU000A3K4DW8                        | 2,7500 % Europaeische Union MTN 22/33                                    | EUR   |                              | 1.500.000          | 3.125.000                          | 1.625.000         | % 97,331  | 1.459.965,00          | 0,48                    |
| EU000A3K4D09                        | 2,7500 % Europaeische Union MTN 22/37                                    | EUR   |                              | 2.125.000          | 2.125.000                          | 0                 | % 94,102  | 1.999.667,50          | 0,66                    |
| EU000A3K4DG1                        | 1,2500 % Europaeische Union MTN 22/43                                    | EUR   |                              | 1.350.000          | 0                                  | 0                 | % 69,655  | 940.342,50            | 0,31                    |
| EU000A3K4DM9                        | 2,6250 % Europaeische Union MTN 22/48 <sup>1)</sup>                      | EUR   |                              | 3.025.000          | 1.000.000                          | 0                 | % 87,470  | 2.645.967,50          | 0,87                    |
| EU000A3K4DT4                        | 2,5000 % Europaeische Union MTN 22/52                                    | EUR   |                              | 1.750.000          | 0                                  | 0                 | % 83,303  | 1.457.793,75          | 0,48                    |
| EU000A3K4DY4                        | 3,0000 % Europaeische Union MTN 22/53                                    | EUR   |                              | 1.875.000          | 1.875.000                          | 0                 | % 91,945  | 1.723.968,75          | 0,57                    |
| EU000A3K4D41                        | 3,2500 % Europaeische Union MTN 23/34                                    | EUR   |                              | 1.650.000          | 1.650.000                          | 0                 | % 100,728 | 1.662.012,00          | 0,55                    |
| XS1500338618                        | 0,5000 % European Investment Bank MTN 16/37                              | EUR   |                              | 3.800.000          | 0                                  | 0                 | % 68,735  | 2.611.930,00          | 0,86                    |
| BE0002890722                        | 3,0000 % Flaemische Gemeinschaft MTN 22/32                               | EUR   |                              | 3.200.000          | 0                                  | 0                 | % 96,930  | 3.101.744,00          | 1,03                    |
| DE000A2G8W65                        | 1,0000 % Freie Hansestadt Bremen Landessch. Ausg.217 19/39               | EUR   |                              | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 71,466  | 1.429.320,00          | 0,47                    |

# Deka-Institutionell Renten Europa

| ISIN         | Gattungsbezeichnung   | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs      | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|--------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------|-------------------------|
| LU2591860569 | 3,0000 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 23/33                              |       | EUR                          | 1.650.000          | 1.650.000                          | 0                 | % 100,293 | 1.654.834,50    | 0,55                    |
| LU2591861021 | 3,2500 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 23/43 <sup>1)</sup>                |       | EUR                          | 2.100.000          | 2.100.000                          | 0                 | % 100,987 | 2.120.727,00    | 0,70                    |
| FR001400FIM6 | 3,0500 % Ile-de-France Mobilités MTN 23/33                                |       | EUR                          | 1.300.000          | 1.300.000                          | 0                 | % 98,227  | 1.276.951,00    | 0,42                    |
| BE0000356650 | 2,7500 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 22/39                              |       | EUR                          | 2.100.000          | 0                                  | 0                 | % 92,624  | 1.945.093,50    | 0,64                    |
| BE0000355645 | 1,4000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 22/53                              |       | EUR                          | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 62,254  | 1.245.070,00    | 0,41                    |
| BE0000357666 | 3,0000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 23/33                              |       | EUR                          | 5.250.000          | 6.687.500                          | 1.437.500         | % 99,457  | 5.221.492,50    | 1,73                    |
| XS2547290432 | 2,5000 % Koenigreich Daenemark MTN 22/24                                  |       | EUR                          | 3.000.000          | 3.000.000                          | 0                 | % 99,152  | 2.974.560,00    | 0,98                    |
| ES0000012I32 | 0,5000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/31 <sup>1)</sup>                    |       | EUR                          | 3.000.000          | 0                                  | 0                 | % 79,720  | 2.391.600,00    | 0,79                    |
| ES0000012J07 | 1,0000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/42                                  |       | EUR                          | 575.000            | 0                                  | 0                 | % 61,993  | 356.459,75      | 0,12                    |
| ES0000012K46 | 1,9000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/52                                  |       | EUR                          | 2.675.000          | 0                                  | 0                 | % 64,548  | 1.726.645,63    | 0,57                    |
| ES0000012L52 | 3,1500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33                                  |       | EUR                          | 2.300.000          | 2.300.000                          | 0                 | % 97,676  | 2.246.548,00    | 0,74                    |
| ES0000012G00 | 1,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/50                           |       | EUR                          | 6.000.000          | 0                                  | 0                 | % 52,142  | 3.128.520,00    | 1,03                    |
| ES0000012K95 | 3,4500 % Koenigreich Spanien Obligaciones 22/43                           |       | EUR                          | 2.450.000          | 0                                  | 0                 | % 93,682  | 2.295.209,00    | 0,76                    |
| XS2226280084 | 0,1250 % KommuneKredit MTN 20/40  |       | EUR                          | 3.000.000          | 3.000.000                          | 0                 | % 58,842  | 1.765.245,00    | 0,58                    |
| ES0000012G42 | 1,2000 % Königreich Spanien Obligaciones 20/40                            |       | EUR                          | 500.000            | 0                                  | 0                 | % 67,010  | 335.050,00      | 0,11                    |
| DE000A351P20 | 3,0000 % Konsortium HB,HH,MV,RP,SL,SH Laender. 23/30                      |       | EUR                          | 2.800.000          | 2.800.000                          | 0                 | % 99,937  | 2.798.236,00    | 0,93                    |
| XS2586942448 | 2,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33                              |       | EUR                          | 775.000            | 775.000                            | 0                 | % 98,724  | 765.111,00      | 0,25                    |
| DE000A30V9M4 | 2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33 <sup>1)</sup>                |       | EUR                          | 3.000.000          | 3.000.000                          | 0                 | % 99,369  | 2.981.055,00    | 0,99                    |
| DE000NRW0NW3 | 2,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1551 23/32               |       | EUR                          | 3.100.000          | 3.100.000                          | 0                 | % 98,277  | 3.046.587,00    | 1,01                    |
| DE000NRW0NX1 | 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1552 23/53 <sup>1)</sup> |       | EUR                          | 2.125.000          | 2.125.000                          | 0                 | % 94,615  | 2.010.558,13    | 0,66                    |
| XS2489772991 | 4,5000 % Lb.Hessen-Thueringen GZ FLR MTN S.H354 22/32                     |       | EUR                          | 2.000.000          | 0                                  | 2.500.000         | % 94,279  | 1.885.570,00    | 0,62                    |
| XS2582098930 | 5,3750 % Lb.Hessen-Thueringen GZ Nach. MTN IHS S.H363 23/33               |       | EUR                          | 2.000.000          | 2.000.000                          | 0                 | % 97,106  | 1.942.120,00    | 0,64                    |
| XS2592628791 | 5,7630 % NatWest Group PLC FLR MTN 23/34 <sup>1)</sup>                    |       | EUR                          | 1.800.000          | 1.800.000                          | 0                 | % 100,901 | 1.816.218,00    | 0,60                    |
| XS2498042584 | 3,3750 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 22/34                              |       | EUR                          | 1.200.000          | 0                                  | 0                 | % 97,308  | 1.167.696,00    | 0,39                    |
| DE000A30VKNO | 1,9500 % NRW Staedteanleihe 7 NRW Staedteanl.Nr.7 22/32                   |       | EUR                          | 1.000.000          | 0                                  | 0                 | % 89,346  | 893.460,00      | 0,30                    |
| DE000NWB0AK3 | 0,1000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.0AK 20/35                                  |       | EUR                          | 1.000.000          | 0                                  | 0                 | % 68,910  | 689.100,00      | 0,23                    |
| DE000NWB0AM9 | 0,5000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.0AM 21/41                                  |       | EUR                          | 3.100.000          | 0                                  | 0                 | % 62,910  | 1.950.194,50    | 0,64                    |
| DE000NWB0AR8 | 1,6250 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.0AR 22/32                                  |       | EUR                          | 2.650.000          | 0                                  | 0                 | % 88,814  | 2.353.557,75    | 0,78                    |
| XS2577033553 | 7,1250 % Raiffeisenbank a.s. FLR Non-Pref. MTN 23/26                      |       | EUR                          | 1.500.000          | 1.500.000                          | 0                 | % 99,246  | 1.488.690,00    | 0,49                    |
| XS2613629372 | 3,3750 % Raiffeisenl.Niederost.-Wien AG MT Hyp.-Pfe. 23/28                |       | EUR                          | 1.500.000          | 1.500.000                          | 0                 | % 99,953  | 1.499.295,00    | 0,50                    |
| FR001400H8C5 | 3,2500 % Régie Auton.Transp. Par.(RATP) MTN 23/33                         |       | EUR                          | 1.600.000          | 1.600.000                          | 0                 | % 98,892  | 1.582.272,00    | 0,52                    |
| FR001400FG43 | 2,9000 % Région Île de France MTN 23/31                                   |       | EUR                          | 700.000            | 700.000                            | 0                 | % 97,980  | 685.860,00      | 0,23                    |
| BE0002922038 | 3,2500 % Région Wallonne MTN 23/33  |       | EUR                          | 3.200.000          | 3.200.000                          | 0                 | % 98,190  | 3.142.064,00    | 1,04                    |
| BE0002923044 | 3,5000 % Région Wallonne MTN 23/43  |       | EUR                          | 3.000.000          | 3.000.000                          | 0                 | % 95,972  | 2.879.145,00    | 0,95                    |
| FR0013515806 | 0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40 <sup>1)</sup>                          |       | EUR                          | 2.100.000          | 4.200.000                          | 2.100.000         | % 64,259  | 1.349.428,50    | 0,45                    |
| FR001400H7V7 | 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33  |       | EUR                          | 5.000.000          | 5.000.000                          | 0                 | % 100,441 | 5.022.050,00    | 1,66                    |
| FR001400FTH3 | 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/54  |       | EUR                          | 1.425.000          | 1.425.000                          | 0                 | % 92,812  | 1.322.563,88    | 0,44                    |
| FI4000546528 | 2,7500 % Republik Finnland Bonds 23/38                                    |       | EUR                          | 1.500.000          | 3.000.000                          | 1.500.000         | % 94,579  | 1.418.677,50    | 0,47                    |
| IE00BKFVC345 | 0,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 20/35                             |       | EUR                          | 900.000            | 900.000                            | 0                 | % 74,377  | 669.388,50      | 0,22                    |
| IE000GVLBXU6 | 3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43                             |       | EUR                          | 1.350.000          | 1.350.000                          | 0                 | % 97,012  | 1.309.655,25    | 0,43                    |
| IT0005321325 | 2,9500 % Republik Italien B.T.P. 18/38                                    |       | EUR                          | 1.500.000          | 0                                  | 0                 | % 83,408  | 1.251.112,50    | 0,41                    |
| IT0005419848 | 0,5000 % Republik Italien B.T.P. 20/26                                    |       | EUR                          | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 92,207  | 1.844.140,00    | 0,61                    |
| IT0005416570 | 0,9500 % Republik Italien B.T.P. 20/27                                    |       | EUR                          | 4.500.000          | 0                                  | 0                 | % 89,389  | 4.022.505,00    | 1,33                    |
| IT0005402117 | 1,4500 % Republik Italien B.T.P. 20/36                                    |       | EUR                          | 1.500.000          | 0                                  | 0                 | % 71,656  | 1.074.840,00    | 0,36                    |
| IT0005437147 | 0,0000 % Republik Italien B.T.P. 21/26                                    |       | EUR                          | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 90,348  | 1.806.950,00    | 0,60                    |
| IT0005433690 | 0,2500 % Republik Italien B.T.P. 21/28                                    |       | EUR                          | 2.900.000          | 0                                  | 0                 | % 84,908  | 2.462.332,00    | 0,81                    |

# Deka-Institutionell Renten Europa

| ISIN  | Gattungsbezeichnung                                       | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs      | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|---|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|----------------------|-------------------------|
| IT0005433195  | 0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/37                    |       | EUR                          | 3.000.000          | 0                                  | 0                 | % 65,033  | 1.950.990,00         | 0,65                    |
| IT0005496770  | 3,2500 % Republik Italien B.T.P. 22/38                    |       | EUR                          | 3.600.000          | 0                                  | 0                 | % 86,679  | 3.120.444,00         | 1,03                    |
| IT0005530032  | 4,4500 % Republik Italien B.T.P. 22/43                    |       | EUR                          | 2.850.000          | 2.850.000                          | 0                 | % 97,983  | 2.792.515,50         | 0,92                    |
| IT0005534141  | 4,5000 % Republik Italien B.T.P. 22/53                    |       | EUR                          | 1.300.000          | 2.600.000                          | 1.300.000         | % 97,414  | 1.266.382,00         | 0,42                    |
| IT0005542359  | 4,0000 % Republik Italien B.T.P. 23/31                    |       | EUR                          | 2.400.000          | 2.400.000                          | 0                 | % 99,527  | 2.388.648,00         | 0,79                    |
| IT0005532723  | 2,0000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 23/28 |       | EUR                          | 3.500.000          | 3.500.000                          | 0                 | % 100,226 | 3.507.911,76         | 1,16                    |
| AT0000A2WSC8  | 0,9000 % Republik Oesterreich MTN 22/32                   |       | EUR                          | 4.500.000          | 4.500.000                          | 0                 | % 84,122  | 3.785.490,00         | 1,25                    |
| AT0000A32458  | 2,9000 % Republik Oesterreich MTN 23/33                   |       | EUR                          | 1.075.000          | 1.075.000                          | 0                 | % 98,871  | 1.062.857,88         | 0,35                    |
| AT0000A33SK7  | 3,1500 % Republik Oesterreich MTN 23/53                   |       | EUR                          | 2.300.000          | 2.300.000                          | 0                 | % 99,852  | 2.296.596,00         | 0,76                    |
| PTOTEYOE0031  | 1,6500 % Republik Portugal Obr. 22/32                     |       | EUR                          | 3.500.000          | 2.000.000                          | 0                 | % 87,769  | 3.071.897,50         | 1,02                    |
| PTOTEPOE0032  | 1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42                     |       | EUR                          | 4.250.000          | 0                                  | 0                 | % 66,617  | 2.831.201,25         | 0,94                    |
| PTOTEZOE0014  | 3,5000 % Republik Portugal Obr. 23/38                     |       | EUR                          | 2.000.000          | 2.000.000                          | 0                 | % 99,790  | 1.995.790,00         | 0,66                    |
| XS2538440780  | 5,0000 % Republik Rumänien MTN 22/26 Reg.S                |       | EUR                          | 2.000.000          | 1.200.000                          | 700.000           | % 100,450 | 2.009.000,00         | 0,66                    |
| XS2538441598  | 6,6250 % Republik Rumänien MTN 22/29 Reg.S                |       | EUR                          | 2.100.000          | 2.100.000                          | 1.525.000         | % 103,005 | 2.163.105,00         | 0,72                    |
| XS1968706876  | 4,6250 % Republik Rumänien MTN 19/49 Reg.S                |       | EUR                          | 1.000.000          | 0                                  | 0                 | % 74,875  | 748.750,00           | 0,25                    |
| XS2610236445  | 4,1250 % Republik Zypern MTN 23/33                        |       | EUR                          | 1.900.000          | 1.900.000                          | 0                 | % 100,812 | 1.915.428,00         | 0,63                    |
| XS2482887879  | 2,7500 % RWE AG MTN 22/30                                 |       | EUR                          | 1.400.000          | 0                                  | 1.500.000         | % 92,053  | 1.288.735,00         | 0,43                    |
| SK4000019857  | 1,0000 % Slowakei Anl. 21/51                              |       | EUR                          | 3.000.000          | 3.000.000                          | 2.000.000         | % 51,465  | 1.543.950,00         | 0,51                    |
| SK4000022539  | 3,7500 % Slowakei Anl. 23/35 <sup>1)</sup>                |       | EUR                          | 2.325.000          | 2.325.000                          | 0                 | % 97,647  | 2.270.281,13         | 0,75                    |
| SK4000022547  | 4,0000 % Slowakei Anl. 23/43                              |       | EUR                          | 2.800.000          | 2.800.000                          | 0                 | % 96,557  | 2.703.582,00         | 0,89                    |
| FR0013409612  | 1,1250 % Société du Grand Paris MTN 19/34                 |       | EUR                          | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 78,864  | 1.577.280,00         | 0,52                    |
| FR0014003CJ5  | 0,8750 % Société du Grand Paris MTN 21/46                 |       | EUR                          | 2.800.000          | 0                                  | 0                 | % 56,315  | 1.576.820,00         | 0,52                    |
| FR0014009KL1  | 1,6250 % Société du Grand Paris MTN 22/42 <sup>1)</sup>   |       | EUR                          | 4.500.000          | 0                                  | 0                 | % 71,536  | 3.219.097,50         | 1,06                    |
| XS2579319513  | 3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA MTN 23/27                |       | EUR                          | 1.400.000          | 2.825.000                          | 1.425.000         | % 99,238  | 1.389.325,00         | 0,46                    |
| XS2524675050  | 1,6250 % SR-Boligkredit A.S. Mortg. Covered MTN 22/28     |       | EUR                          | 2.375.000          | 0                                  | 0                 | % 92,780  | 2.203.525,00         | 0,73                    |
| FR0013420429  | 1,2000 % Stadt Paris MTN 19/39                            |       | EUR                          | 2.000.000          | 0                                  | 0                 | % 70,914  | 1.418.280,00         | 0,47                    |
| SK4000022505  | 5,9520 % Tatra Banka AS FLR MTN 23/26                     |       | EUR                          | 800.000            | 800.000                            | 0                 | % 98,679  | 789.432,00           | 0,26                    |
| SK4000022430  | 3,3750 % Tatra Banka AS MT Mtg.Cov.Bds 23/26              |       | EUR                          | 2.000.000          | 2.000.000                          | 0                 | % 98,836  | 1.976.710,00         | 0,65                    |
| DE000HV2AYS3  | 0,3750 % UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2116 22/33 |       | EUR                          | 3.800.000          | 0                                  | 0                 | % 77,003  | 2.926.114,00         | 0,97                    |
| XS2585977882  | 3,6250 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as Mrtg Cov.Bds 23/26 |       | EUR                          | 900.000            | 900.000                            | 0                 | % 99,220  | 892.975,50           | 0,30                    |
| <b>CZK</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>2.177.460,56</b>  | <b>0,72</b>             |
| CZ0001005243  | 2,0000 % Tschechien Bonds S.15Y 17/33                     |       | CZK                          | 65.000.000         | 65.000.000                         | 0                 | % 78,675  | 2.177.460,56         | 0,72                    |
| <b>DKK</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>12.566.079,00</b> | <b>4,15</b>             |
| DK0009924102  | 0,0000 % Koenigreich Daenemark Anl. 20/31                 |       | DKK                          | 20.000.000         | 45.000.000                         | 25.000.000        | % 80,395  | 2.157.328,40         | 0,71                    |
| DK0009924532  | 2,2500 % Koenigreich Daenemark Anl. 22/33                 |       | DKK                          | 55.000.000         | 55.000.000                         | 0                 | % 96,210  | 7.099.702,14         | 2,35                    |
| DK0009922320  | 4,5000 % Königreich Dänemark Anl. 07/39                   |       | DKK                          | 20.000.000         | 20.000.000                         | 0                 | % 123,315 | 3.309.048,46         | 1,09                    |
| <b>GBP</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>4.046.342,02</b>  | <b>1,34</b>             |
| XS2588986724  | 6,2500 % ING Groep N.V. FLR MTN 23/33 <sup>1)</sup>       |       | GBP                          | 2.000.000          | 2.000.000                          | 0                 | % 97,662  | 2.216.177,27         | 0,73                    |
| XS2318615569  | 0,3750 % Municipality Finance PLC MTN 21/25               |       | GBP                          | 1.800.000          | 1.800.000                          | 0                 | % 89,613  | 1.830.164,75         | 0,61                    |
| <b>HUF</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>2.110.886,15</b>  | <b>0,70</b>             |
| XS2524813545  | 11,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/24             |       | HUF                          | 800.000.000        | 0                                  | 0                 | % 98,395  | 2.110.886,15         | 0,70                    |
| <b>NOK</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>6.347.781,42</b>  | <b>2,10</b>             |
| NO0012837642  | 3,0000 % Koenigreich Norwegen Anl. 23/33                  |       | NOK                          | 35.000.000         | 35.000.000                         | 0                 | % 99,011  | 2.954.745,83         | 0,98                    |
| NO0010705536  | 3,0000 % Königreich Norwegen Anl. 14/24                   |       | NOK                          | 40.000.000         | 40.000.000                         | 0                 | % 99,486  | 3.393.035,59         | 1,12                    |
| <b>USD</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>979.278,54</b>    | <b>0,32</b>             |
| XS2571924070  | 7,6250 % Republik Rumänien MTN 23/53 Reg.S                |       | USD                          | 1.000.000          | 1.000.000                          | 0                 | % 107,774 | 979.278,54           | 0,32                    |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>10.512.042,65</b> | <b>3,47</b>             |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>10.512.042,65</b> | <b>3,47</b>             |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>9.512.080,38</b>  | <b>3,14</b>             |
| FR0014009N55  | 1,3750 % Action Logement Services SAS MTN 22/32           |       | EUR                          | 3.500.000          | 0                                  | 0                 | % 85,210  | 2.982.350,00         | 0,99                    |
| XS2391406530  | 0,3500 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 21/31             |       | EUR                          | 1.225.000          | 0                                  | 0                 | % 80,108  | 981.316,88           | 0,32                    |



# Deka-Institutionell Renten Europa

| ISIN  | Gattungsbezeichnung   | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |              |
|---|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------|----------------------|-------------------------|--------------|
| EU000A3K4D74  | 3,3750 % Europaeische Union MTN 23/38                           |       | EUR                          | 1.550.000          | 1.550.000                          | 0                 | % 100,077  | 1.551.193,50         | 0,51                    |              |
| FI4000550249  | 3,0000 % Republik Finnland Bonds 23/33                          |       | EUR                          | 4.000.000          | 4.000.000                          | 0                 | % 99,931   | 3.997.220,00         | 1,32                    |              |
| <b>GBP</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>999.962,27</b>    | <b>0,33</b>             |              |
| XS2540612129  | 6,3750 % NatWest Markets PLC MTN 22/27                          |       | GBP                          | 850.000            | 850.000                            | 0                 | % 103,685  | 999.962,27           | 0,33                    |              |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>EUR</b>           | <b>254.743.160,38</b>   | <b>84,21</b> |
| <b>Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| <b>Zins-Derivate</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>-927.000,00</b>   | <b>-0,30</b>            |              |
|   | EURO Bund Future (FGBL) Juni 23                                 |       | XEUR EUR                     | 6.000.000          |                                    |                   |            | 88.800,00            | 0,03                    |              |
|   | EURO Buxl Future (FGBX) Juni 23                                 |       | XEUR EUR                     | -1.500.000         |                                    |                   |            | -71.160,00           | -0,02                   |              |
|   | Long Term EURO OAT Future (FOAT) Juni 23                        |       | XEUR EUR                     | -27.200.000        |                                    |                   |            | -944.640,00          | -0,31                   |              |
| <b>Optionsrechte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>53.868,61</b>     | <b>0,02</b>             |              |
| <b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>53.868,61</b>     | <b>0,02</b>             |              |
|   | EURO Bund Future (FGBL) Call Juni 23 136,5                      |       | XEUR EUR                     | Anzahl 500         |                                    |                   | EUR 0,098  | 48.868,61            | 0,02                    |              |
|   | EURO Bund Future (FGBL) Call Juni 23 138,5                      |       | XEUR EUR                     | Anzahl -500        |                                    |                   | EUR -0,010 | 5.000,00             | 0,00                    |              |
| <b>Summe Zins-Derivate</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>EUR</b>           | <b>-873.131,39</b>      | <b>-0,28</b> |
| <b>Devisen-Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| <b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>27.439,76</b>     | <b>0,01</b>             |              |
| <b>Offene Positionen</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
|   | CZK/EUR 16.000.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -3,12                | 0,00                    |              |
|   | NOK/EUR 639.000,00  |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -98,20               | 0,00                    |              |
|   | USD/EUR 9.975.000,00  |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 27.541,08            | 0,01                    |              |
| <b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>-7.582,67</b>     | <b>0,01</b>             |              |
| <b>Offene Positionen</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
|   | CZK/EUR 31.992.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 252,47               | 0,00                    |              |
|   | DKK/EUR 91.910.105,20   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 15.343,53            | 0,01                    |              |
|   | GBP/EUR 6.650.000,00  |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -39.432,11           | -0,01                   |              |
|   | HUF/EUR 500.000.000,00  |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -10.901,97           | 0,00                    |              |
|   | NOK/EUR 70.305.100,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 33.788,28            | 0,01                    |              |
|   | PLN/EUR 5.597.000,00  |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -6.632,87            | 0,00                    |              |
| <b>Optionsrechte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>375.884,12</b>    | <b>0,12</b>             |              |
| <b>Optionsrechte auf Devisen (Kauf)</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>447.337,83</b>    | <b>0,15</b>             |              |
|   | CALL EUR/HUF 382,50000 10.05.2023                               |       | OTC EUR                      | 24.500.000         |                                    |                   | % 0,239    | 58.481,50            | 0,02                    |              |
|   | CALL NOK/SEK 0,98250 11.05.2023                                 |       | OTC NOK                      | 180.000.000        |                                    |                   | % 0,115    | 17.603,72            | 0,01                    |              |
|   | CALL USD/KRW 1,330,00000 11.05.2023                             |       | OTC USD                      | 13.000.000         |                                    |                   | % 1,182    | 139.632,91           | 0,05                    |              |
|   | PUT AUD/JPY 87,50000 26.05.2023                                 |       | OTC AUD                      | 18.500.000         |                                    |                   | % 0,548    | 60.736,07            | 0,02                    |              |
|   | PUT GBP/USD 1,23500 17.05.2023                                  |       | OTC GBP                      | 13.000.000         |                                    |                   | % 0,407    | 60.076,47            | 0,02                    |              |
|   | PUT USD/JPY 132,75000 05.05.2023                                |       | OTC USD                      | 17.000.000         |                                    |                   | % 0,063    | 9.800,39             | 0,00                    |              |
|   | PUT USD/JPY 125,00000 10.07.2023                                |       | OTC USD                      | 11.000.000         |                                    |                   | % 0,265    | 26.436,78            | 0,01                    |              |
|   | PUT USD/TRY 21,00000 16.01.2024                                 |       | OTC USD                      | 3.000.000          |                                    |                   | % 2,736    | 74.569,99            | 0,02                    |              |
| <b>Optionsrechte auf Devisen (Verkauf)</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>-71.453,71</b>    | <b>-0,03</b>            |              |
|   | CALL EUR/HUF 390,00000 10.05.2023                               |       | OTC EUR                      | -24.500.000        |                                    |                   | % 0,083    | -20.432,76           | -0,01                   |              |
|   | CALL USD/KRW 1,355,00000 11.05.2023                             |       | OTC USD                      | -13.000.000        |                                    |                   | % 0,388    | -45.843,44           | -0,02                   |              |
|   | PUT USD/JPY 130,00000 05.05.2023                                |       | OTC USD                      | -17.000.000        |                                    |                   | % 0,009    | -1.456,17            | 0,00                    |              |
|   | PUT USD/JPY 115,00000 10.07.2023                                |       | OTC USD                      | -11.000.000        |                                    |                   | % 0,037    | -3.721,34            | 0,00                    |              |
| <b>Summe Devisen-Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>EUR</b>           | <b>395.741,21</b>       | <b>0,14</b>  |
| <b>Swaps</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |              |
| <b>Zinsswaps (Erhalten/Zahlen)</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>-1.566.535,23</b> | <b>-0,52</b>            |              |
|   | IRS 0,331 % EUR / EURIBORM06 EUR / MERRILL_LDN 15.08.2025       |       | OTC EUR                      | 30.000.000         |                                    |                   |            | -2.113.451,40        | -0,70                   |              |
|   | IRS 3,73 % CZK / PRIBORM03 CZK / JPMORGAN_FRA 08.02.2024        |       | OTC CZK                      | 1.100.000.000      |                                    |                   |            | -1.578.448,36        | -0,52                   |              |
|   | IRS EURIBORM06 EUR / 0,4765 % EUR / JPM_LDN 15.02.2025          |       | OTC EUR                      | 36.700.000         |                                    |                   |            | 2.125.364,53         | 0,70                    |              |
| <b>Credit Default Swaps (CDS)</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>-359.392,62</b>   | <b>-0,11</b>            |              |
| <b>Protection Buyer</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>-1.423.678,02</b> | <b>-0,47</b>            |              |
|   | CDS ECTRVYYCFE89VWYS6K36 / CITIGLMD_FRA 20.06.2027              |       | OTC USD                      | 6.000.000          |                                    |                   |            | -169.401,87          | -0,06                   |              |
|   | CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y / CITIGLMD_FRA 20.12.2027 |       | OTC EUR                      | 28.000.000         |                                    |                   |            | -1.064.285,42        | -0,35                   |              |
|   | CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S39 V1 5Y / CITIGLMD_FRA 20.06.2028 |       | OTC EUR                      | 7.000.000          |                                    |                   |            | -189.990,73          | -0,06                   |              |
| <b>Protection Seller</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>1.064.285,40</b>  | <b>0,36</b>             |              |
|   | CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y / CITIGLMD_FRA 20.12.2027 |       | OTC EUR                      | -7.000.000         |                                    |                   |            | 266.071,35           | 0,09                    |              |

# Deka-Institutionell Renten Europa

| ISIN   | Gattungsbezeichnung                          | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs      | Kurswert in EUR           | % des Fondsvermögens *) |
|--|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|---------------------------|-------------------------|
| CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y / GOLDMANS_FRA 20.12.2027    |  | OTC   | EUR                          | -7.000.000         |                                    |                   |           | 266.071,35                | 0,09                    |
| CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y / JPMORGAN_FRA 20.12.2027    |  | OTC   | EUR                          | -7.000.000         |                                    |                   |           | 266.071,35                | 0,09                    |
| CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y / CITIGLMD_FRA 20.12.2027    |  | OTC   | EUR                          | -7.000.000         |                                    |                   |           | 266.071,35                | 0,09                    |
| <b>Optionsrechte</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| <b>Optionsrechte auf Credit Default Swaps (CDS)</b>                |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| <b>Payer Swap</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>59.382,00</b>          | <b>0,02</b>             |
| CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S39 V1 5Y 17.05.2023                   |  | OTC   | EUR                          | 18.000.000         |                                    |                   | % 0,055   | 9.882,00                  | 0,00                    |
| CDS ITRAXX EUROPE S39 V1 5Y 21.06.2023                             |  | OTC   | EUR                          | 30.000.000         |                                    |                   | % 0,260   | 78.120,00                 | 0,03                    |
| CDS ITRAXX EUROPE S39 V1 5Y 21.06.2023                             |  | OTC   | EUR                          | -30.000.000        |                                    |                   | % 0,095   | -28.620,00                | -0,01                   |
| <b>Summe Swaps</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR -1.866.545,85</b>  | <b>-0,61</b>            |
| <b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>           |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| <b>Bankguthaben</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| <b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>                          |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |  |       | EUR                          | 44.892.619,93      |                                    |                   | % 100,000 | 44.892.619,93             | 14,83                   |
| <b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>                      |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |  |       | HUF                          | 0,58               |                                    |                   | % 100,000 | 0,00                      | 0,00                    |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                          |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |  |       | GBP                          | 270.357,39         |                                    |                   | % 100,000 | 306.750,24                | 0,10                    |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |  |       | KRW                          | 1,00               |                                    |                   | % 100,000 | 0,00                      | 0,00                    |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |  |       | USD                          | 56.278,86          |                                    |                   | % 100,000 | 51.137,03                 | 0,02                    |
| <b>Summe Bankguthaben</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR 45.250.507,20</b>  | <b>14,95</b>            |
| <b>Geldmarktpapiere</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| <b>PLN</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| XS2525878703   | 8,8000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/23 |       | PLN                          | 5.000.000,00       | 0                                  | 0                 | % 100,418 | 1.096.529,73              | 0,36                    |
| <b>Summe Geldmarktpapiere</b>                                      |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR 1.096.529,73</b>   | <b>0,36</b>             |
| <b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR 46.347.036,93</b>  | <b>15,31</b>            |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                               |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| Zinsansprüche  |  |       | EUR                          | 2.320.060,14       |                                    |                   |           | 2.320.060,14              | 0,77                    |
| Einschüsse (Initial Margins)                                       |  |       | EUR                          | 1.319.377,80       |                                    |                   |           | 1.319.377,80              | 0,44                    |
| Forderungen aus Wertpapier-Darlehen                                |  |       | EUR                          | 1.924,45           |                                    |                   |           | 1.924,45                  | 0,00                    |
| Forderungen aus Wertpapiergeschäften                               |  |       | EUR                          | 9.215.769,13       |                                    |                   |           | 9.215.769,13              | 3,05                    |
| Forderungen aus Ersatzleistung Zinsen/Dividenden                   |  |       | EUR                          | 32.589,04          |                                    |                   |           | 32.589,04                 | 0,01                    |
| Forderungen aus Cash Collateral                                    |  |       | EUR                          | 4.240.000,00       |                                    |                   |           | 4.240.000,00              | 1,40                    |
| <b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>                         |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR 17.129.720,56</b>  | <b>5,67</b>             |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                  |  |       |                              |                    |                                    |                   |           |                           |                         |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften                        |  |       | EUR                          | -1.947.453,30      |                                    |                   |           | -1.947.453,30             | -0,64                   |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften                         |  |       | EUR                          | -8.687.955,75      |                                    |                   |           | -8.687.955,75             | -2,87                   |
| Verbindlichkeiten aus Derivategeschäften                           |  |       | EUR                          | -54.484,06         |                                    |                   |           | -54.484,06                | -0,02                   |
| Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten                       |  |       | EUR                          | -154.232,18        |                                    |                   |           | -154.232,18               | -0,05                   |
| Verbindlichkeiten aus Cash Collateral                              |  |       | EUR                          | -2.600.000,00      |                                    |                   |           | -2.600.000,00             | -0,86                   |
| <b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>                            |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR -13.444.125,29</b> | <b>-4,44</b>            |
| <b>Fondsvermögen</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR 302.431.856,55</b> | <b>100,00</b>           |
| <b>Umlaufende Anteile</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>STK 4.945.961,000</b>  |                         |
| <b>Anteilwert</b>  |  |       |                              |                    |                                    |                   |           | <b>EUR 61,15</b>          |                         |

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

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

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Nominal in Währung | Wertpapier-Darlehen in EUR |                      | gesamt               |
|--|-------------------------------|----------------------------|----------------------|----------------------|
|  |                               | befristet                  | unbefristet          |                      |
| <b>Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)</b>                        |                               |                            |                      |                      |
| Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: |                               |                            |                      |                      |
| 3,1250 % Crédit Mu. Home Loan SFH SA MT Obl.Fin.Hab. 23/33                         | EUR 1.700.000                 |                            | 1.671.227,50         |                      |
| 0,0100 % Credito Emiliano S.p.A. Mortg.Cov. Bds 21/28                              | EUR 325.000                   |                            | 271.828,38           |                      |
| 2,6250 % Europaeische Union MTN 22/48  | EUR 2.025.000                 |                            | 1.771.267,50         |                      |
| 3,2500 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 23/43                                       | EUR 310.000                   |                            | 313.059,70           |                      |
| 6,2500 % ING Groep N.V. FLR MTN 23/33  | GBP 2.000.000                 |                            | 2.216.177,27         |                      |
| 0,5000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/31   | EUR 2.500.000                 |                            | 1.993.000,00         |                      |
| 2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33                                       | EUR 900.000                   |                            | 894.316,50           |                      |
| 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landesch.R.1552 23/53                         | EUR 1.400.000                 |                            | 1.324.603,01         |                      |
| 5,7630 % NatWest Group PLC FLR MTN 23/34   | EUR 1.800.000                 |                            | 1.816.218,00         |                      |
| 0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40   | EUR 2.100.000                 |                            | 1.349.428,50         |                      |
| 3,7500 % Slowakei Anl. 23/35   | EUR 2.000.000                 |                            | 1.952.930,00         |                      |
| 1,6250 % Société du Grand Paris MTN 22/42  | EUR 2.500.000                 |                            | 1.788.387,50         |                      |
| <b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>          | <b>EUR</b>                    |                            | <b>17.362.443,86</b> | <b>17.362.443,86</b> |

# Deka-Institutionell Renten Europa

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.04.2023

|                               |       |             |                |
|-------------------------------|-------|-------------|----------------|
| Vereinigtes Königreich, Pfund | (GBP) | 0,88136     | = 1 Euro (EUR) |
| Dänemark, Kronen              | (DKK) | 7,45320     | = 1 Euro (EUR) |
| Norwegen, Kronen              | (NOK) | 11,72820    | = 1 Euro (EUR) |
| Polen, Zloty                  | (PLN) | 4,57890     | = 1 Euro (EUR) |
| Tschechische Republik, Kronen | (CZK) | 23,48550    | = 1 Euro (EUR) |
| Ungarn, Forint                | (HUF) | 372,90500   | = 1 Euro (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar    | (USD) | 1,10055     | = 1 Euro (EUR) |
| Südkorea, Won                 | (KRW) | 1.473,28500 | = 1 Euro (EUR) |
| Australien, Dollar            | (AUD) | 1,66858     | = 1 Euro (EUR) |

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

### OTC

Over-the-Counter

## Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuzuordnung zum Berichtsstichtag):

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung                                       | Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|-------------------------------------|---|---|----------------|-------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |   |   |                |                   |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>     |   |   |                |                   |
| <b>CZK</b>                          |   |   |                |                   |
| CZ0001006233                        | 1,7500 % Tschechien Bonds S.138 21/32                     | CZK                                     | 30.000.000     | 30.000.000        |
| CZ0001006688                        | 5,0000 % Tschechien Bonds S.150 22/30                     | CZK                                     | 0              | 50.000.000        |
| <b>EUR</b>                          |   |   |                |                   |
| XS2457496359                        | 1,5000 % A2A S.p.A. MTN 22/28                             | EUR                                     | 0              | 925.000           |
| XS2534976886                        | 4,5000 % A2A S.p.A. MTN 22/30                             | EUR                                     | 0              | 2.075.000         |
| XS2102283061                        | 0,6000 % ABN AMRO Bank N.V. Non-Pref. MTN 20/27           | EUR                                     | 0              | 900.000           |
| XS2175967343                        | 1,5000 % Achmea B.V. MTN 20/27                            | EUR                                     | 0              | 1.500.000         |
| XS2230399441                        | 2,8750 % AIB Group PLC FLR MTN 20/31                      | EUR                                     | 0              | 2.000.000         |
| XS2464405229                        | 2,2500 % AIB Group PLC FLR MTN 22/28                      | EUR                                     | 0              | 600.000           |
| XS2555925218                        | 5,7500 % AIB Group PLC FLR MTN 22/29                      | EUR                                     | 1.900.000      | 1.900.000         |
| FR001400D7M0                        | 4,7500 % ALD S.A. MTN 22/25                               | EUR                                     | 0              | 1.900.000         |
| XS2583211201                        | 4,6250 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 23/27         | EUR                                     | 1.250.000      | 1.250.000         |
| XS2536431617                        | 4,7500 % Anglo American Capital PLC MTN 22/32             | EUR                                     | 0              | 1.100.000         |
| XS2598746290                        | 4,5000 % Anglo American Capital PLC MTN 23/28             | EUR                                     | 875.000        | 875.000           |
| XS2598746373                        | 5,0000 % Anglo American Capital PLC MTN 23/31             | EUR                                     | 1.875.000      | 1.875.000         |
| XS2537060746                        | 4,8750 % ArcelorMittal S.A. MTN 22/26                     | EUR                                     | 0              | 2.100.000         |
| XS2589367528                        | 5,3750 % B.A.T. Netherlands Finance BV MTN 23/31          | EUR                                     | 2.300.000      | 2.300.000         |
| XS2545206166                        | 4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/29 | EUR                                     | 0              | 2.500.000         |
| XS2455392584                        | 2,6250 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26   | EUR                                     | 0              | 1.100.000         |
| XS2575952697                        | 3,8750 % Banco Santander S.A. Preferred MTN 23/28         | EUR                                     | 2.400.000      | 2.400.000         |
| XS2465984289                        | 1,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 22/26          | EUR                                     | 0              | 1.125.000         |
| XS2539425095                        | 10,0000 % Bank of Valletta PLC FLR Non-Pref. MTN 22/27    | EUR                                     | 1.225.000      | 1.225.000         |
| XS2342060360                        | 1,1060 % Barclays PLC FLR MTN 21/32                       | EUR                                     | 0              | 1.475.000         |
| XS2560422581                        | 5,2620 % Barclays PLC FLR MTN 22/34                       | EUR                                     | 1.825.000      | 1.825.000         |
| XS2595418679                        | 4,5000 % BASF SE MTN 23/35                                | EUR                                     | 1.600.000      | 1.600.000         |
| XS2411178630                        | 1,3750 % Bayerische Landesbank FLR Sub. Anl. 21/32        | EUR                                     | 0              | 4.300.000         |
| DE000BLB6JJO                        | 0,1250 % Bayerische Landesbank MT IHS 21/28               | EUR                                     | 0              | 2.700.000         |
| XS2383811424                        | 1,7500 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 21/28     | EUR                                     | 0              | 600.000           |
| BE6331190973                        | 1,2500 % Belfius Bank S.A. FLR MTN 21/34                  | EUR                                     | 0              | 3.100.000         |
| FR001400AKP6                        | 2,7500 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 22/28                   | EUR                                     | 0              | 2.000.000         |
| FR0014009HA0                        | 2,5000 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 22/32                   | EUR                                     | 0              | 1.700.000         |
| FR0013532280                        | 0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 20/28         | EUR                                     | 0              | 2.500.000         |
| FR0014009LQ8                        | 2,1000 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 22/32         | EUR                                     | 0              | 1.200.000         |
| FR001400AJY0                        | 3,2500 % Bouygues S.A. Bonds 22/37                        | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| XS2579483319                        | 4,5000 % Bulgarien Bonds 23/33 Reg.S                      | EUR                                     | 1.350.000      | 1.350.000         |
| XS2536817211                        | 4,1250 % Bulgarien MTN 22/29                              | EUR                                     | 0              | 3.025.000         |
| XS2536817484                        | 4,6250 % Bulgarien MTN 22/34                              | EUR                                     | 0              | 2.625.000         |
| XS2585964476                        | 5,8850 % C.C.Bca-Cr.Coop.Italiano S.p.A FLR MTN 23/27     | EUR                                     | 1.325.000      | 1.325.000         |
| XS2558978883                        | 6,2500 % CaixaBank S.A. FLR MTN 22/33                     | EUR                                     | 2.500.000      | 2.500.000         |
| XS2465792294                        | 2,2500 % Cellnex Finance Company S.A. MTN 22/26           | EUR                                     | 0              | 1.300.000         |
| XS2555412001                        | 6,6930 % Ceska Sporitelna AS FLR Non-Pref.MTN 22/25       | EUR                                     | 1.600.000      | 1.600.000         |
| XS2495084621                        | 5,6250 % Ceske Drahy AS Notes 22/27                       | EUR                                     | 0              | 3.625.000         |
| XS2393742122                        | 1,6250 % Citadele banka FLR Preferred Nts 21/26           | EUR                                     | 0              | 200.000           |
| DE000CZ45W57                        | 3,0000 % Commerzbank AG FLR MTN S.992 22/27               | EUR                                     | 0              | 2.200.000         |
| DE000CZ43ZB3                        | 4,6250 % Commerzbank AG FLR MTN S.995 22/28               | EUR                                     | 0              | 2.100.000         |
| DE000CZ43ZN8                        | 5,1250 % Commerzbank AG MT FLN 23/30                      | EUR                                     | 900.000        | 900.000           |
| DE000CZ45W81                        | 6,5000 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 22/32        | EUR                                     | 0              | 1.300.000         |
| XS2517103417                        | 2,1250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 22/28         | EUR                                     | 0              | 1.200.000         |
| XS2193657561                        | 1,1250 % Conti-Gummi Finance B.V. MTN 20/24               | EUR                                     | 0              | 1.225.000         |
| XS2554997937                        | 4,7500 % Covestro AG MTN 22/28                            | EUR                                     | 1.300.000      | 1.300.000         |
| FR0014005RZ4                        | 1,5000 % Crédit Agricole Assurances SA Notes 21/31        | EUR                                     | 0              | 1.500.000         |
| FR001400E717                        | 3,8750 % Crédit Agricole S.A. Preferred MTN 22/34         | EUR                                     | 1.600.000      | 1.600.000         |
| ES0205045026                        | 0,8750 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 20/27                  | EUR                                     | 0              | 1.200.000         |
| XS2573569576                        | 4,1250 % Danske Bank AS FLR Preferred MTN 23/31           | EUR                                     | 1.675.000      | 1.675.000         |

# Deka-Institutionell Renten Europa

| ISIN         | Gattungsbezeichnung   | Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|--------------|---|---|----------------|-------------------|
| XS2475502832 | 2,3750 % De Volksbank N.V. FLR Non-Pref. MTN 22/27          | EUR                                     | 0              | 3.800.000         |
| DE000A30VT06 | 5,0000 % Deutsche Bank AG FLR MTN 22/30                     | EUR                                     | 0              | 1.800.000         |
| DE000A2NBKK3 | 0,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35325 19/24       | EUR                                     | 0              | 2.200.000         |
| XS2458285355 | 1,3750 % DSV Finance B.V. MTN 22/30                         | EUR                                     | 0              | 1.800.000         |
| XS2463518998 | 1,6250 % E.ON SE MTN 22/31                                  | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| XS2574873183 | 3,8750 % E.ON SE MTN 23/35                                  | EUR                                     | 650.000        | 650.000           |
| XS2542914986 | 3,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/30                         | EUR                                     | 0              | 250.000           |
| FR001400D6N0 | 4,3750 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 22/29           | EUR                                     | 0              | 2.300.000         |
| FR001400D6O8 | 4,7500 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 22/34           | EUR                                     | 0              | 2.100.000         |
| XS2390400807 | 0,8750 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 21/34                   | EUR                                     | 0              | 1.150.000         |
| XS2589260996 | 4,5000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 23/43                   | EUR                                     | 1.600.000      | 1.600.000         |
| FR0014005ZQ6 | 1,0000 % Engie S.A. MTN 21/36                               | EUR                                     | 0              | 2.200.000         |
| XS2532681074 | 3,7500 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA MTN 22/27            | EUR                                     | 0              | 2.300.000         |
| FI4000441860 | 10,2500 % Finnair Oyj FLR Secs 20/Und.                      | EUR                                     | 0              | 1.700.000         |
| XS2198798659 | 1,6250 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS 20/24            | EUR                                     | 0              | 4.000.000         |
| XS2198879145 | 2,1250 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS 20/27            | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| XS2530444624 | 3,8750 % Fresenius Medical Care KGaA MTN 22/27              | EUR                                     | 0              | 2.425.000         |
| XS2482872251 | 2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 22/30                  | EUR                                     | 0              | 1.700.000         |
| GR0114033583 | 3,8750 % Griechenland Notes 23/28                           | EUR                                     | 2.550.000      | 2.550.000         |
| GR0124039737 | 4,2500 % Griechenland Notes 23/33                           | EUR                                     | 2.650.000      | 2.650.000         |
| LU2475494477 | 1,7500 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 22/42                | EUR                                     | 0              | 1.600.000         |
| XS2407955827 | 0,5000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN Anl. 21/32                | EUR                                     | 0              | 1.300.000         |
| XS2597114284 | 4,7870 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 23/32                    | EUR                                     | 1.950.000      | 1.950.000         |
| ES0344251006 | 3,7500 % Ibercaja Banco S.A.U. Pref. Notes 22/25            | EUR                                     | 0              | 2.800.000         |
| XS2194283839 | 1,6250 % Infineon Technologies AG MTN 20/29                 | EUR                                     | 0              | 1.300.000         |
| XS2589361240 | 6,1840 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR MTN 23/34               | EUR                                     | 1.550.000      | 1.550.000         |
| XS2592658947 | 5,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Non-Preferred MTN 23/33     | EUR                                     | 1.700.000      | 1.700.000         |
| BE0002846278 | 1,5000 % KBC Groep N.V. FLR MTN 22/26                       | EUR                                     | 0              | 2.200.000         |
| ES0000012K61 | 2,5500 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32                    | EUR                                     | 0              | 1.500.000         |
| DE000A3E5XN1 | 0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/32                | EUR                                     | 0              | 4.500.000         |
| FR001400F5F6 | 4,3750 % La Banque Postale Non-Preferred MTN 23/30          | EUR                                     | 3.000.000      | 3.000.000         |
| FR001400CN54 | 3,1250 % La Poste MTN 22/33                                 | EUR                                     | 0              | 1.900.000         |
| XS2459163619 | 1,7500 % LANXESS AG MTN 22/28                               | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| XS2576365188 | 7,2500 % Luminor Bank AS FLR Preferred MTN 23/26            | EUR                                     | 725.000        | 725.000           |
| ES0224244105 | 2,8750 % Mapfre S.A. Obl. 22/30                             | EUR                                     | 0              | 900.000           |
| XS2597999452 | 4,7500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA FLR Pref. MTN 23/28 | EUR                                     | 2.250.000      | 2.250.000         |
| XS2407028435 | 0,8750 % MVM Energetika Zrt. Bonds 21/27                    | EUR                                     | 0              | 1.075.000         |
| XS2524740649 | 2,8750 % Nordea Bank Abp Non-Preferred MTN 22/32            | EUR                                     | 0              | 2.000.000         |
| XS2185867673 | 1,6250 % OP Yrityspankki Oyj FLR MTN 20/30                  | EUR                                     | 0              | 450.000           |
| FR001400BKZ3 | 2,0000 % Rep. Frankreich OAT 21/32                          | EUR                                     | 5.000.000      | 5.000.000         |
| XS2532370231 | 4,0000 % Republik Estland Bonds 22/32                       | EUR                                     | 0              | 2.500.000         |
| IT0005438004 | 1,5000 % Republik Italien B.T.P. 20/45                      | EUR                                     | 0              | 2.000.000         |
| XS2549862758 | 3,8750 % Republik Lettland MTN 22/27                        | EUR                                     | 0              | 1.750.000         |
| XS2576364371 | 3,5000 % Republik Lettland MTN 23/28                        | EUR                                     | 1.225.000      | 1.225.000         |
| XS2547270756 | 4,1250 % Republik Litauen MTN 22/28                         | EUR                                     | 0              | 3.000.000         |
| XS2487342649 | 2,1250 % Republik Litauen MTN 22/32                         | EUR                                     | 0              | 3.700.000         |
| SI0002104048 | 0,4875 % Republik Slowenien Bonds 20/50                     | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| SI0002104303 | 3,6250 % Republik Slowenien Bonds 23/33                     | EUR                                     | 950.000        | 950.000           |
| FR0013445137 | 0,0000 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. MTN 19/27           | EUR                                     | 0              | 1.600.000         |
| XS2482936247 | 2,1250 % RWE AG MTN 22/26                                   | EUR                                     | 0              | 1.875.000         |
| XS2584685031 | 3,6250 % RWE AG MTN 23/29                                   | EUR                                     | 1.475.000      | 1.475.000         |
| SK4000021986 | 4,0000 % Slowakei Anl. 22/32                                | EUR                                     | 0              | 1.800.000         |
| XS2433211310 | 0,7500 % Snam S.p.A. MTN 22/29                              | EUR                                     | 0              | 2.000.000         |
| FR0013518057 | 1,2500 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 20/30      | EUR                                     | 0              | 1.700.000         |
| XS2487016250 | 2,3750 % Stedin Holding N.V. MTN 22/30                      | EUR                                     | 0              | 1.275.000         |
| XS2356041165 | 1,2500 % Stellantis N.V. MTN 21/33                          | EUR                                     | 0              | 600.000           |
| XS2547609433 | 4,0000 % Talanx AG MTN 22/29                                | EUR                                     | 0              | 2.000.000         |
| SK4000018925 | 0,5000 % Tatra Banka AS FLR MTN 21/28                       | EUR                                     | 0              | 500.000           |
| XS2484502823 | 5,0560 % TDC Net A/S MTN 22/28                              | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| XS2576550672 | 4,3750 % Thames Water Utilities Fin.PLC MTN 23/31           | EUR                                     | 1.850.000      | 1.850.000         |
| DE000A3LBBG1 | 4,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. MTN 22/25           | EUR                                     | 800.000        | 800.000           |
| XS2558594391 | 5,0000 % Ungarn Bonds 22/27                                 | EUR                                     | 1.150.000      | 1.150.000         |
| XS2010026214 | 4,2500 % Ungarn Bonds 22/31 Reg.S                           | EUR                                     | 0              | 3.325.000         |
| XS2496288593 | 3,0000 % Universal Music Group N.V. MTN 22/27               | EUR                                     | 0              | 1.250.000         |
| XS2496289138 | 3,7500 % Universal Music Group N.V. MTN 22/32               | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| XS2586851300 | 4,0000 % Vodafone International Fin.DAC MTN 23/43           | EUR                                     | 1.800.000      | 1.800.000         |
| <b>GBP</b>   |   |   |                |                   |
| XS0161620942 | 5,4410 % Aeroporti di Roma S.p.A. Notes 03/23 Cl.A4         | GBP                                     | 0              | 775.000           |
| XS2582814385 | 5,7500 % British Telecommunications PLC MTN 23/41           | GBP                                     | 500.000        | 500.000           |
| XS2480050090 | 4,0000 % Deutsche Bank AG FLR MTN 22/26                     | GBP                                     | 0              | 1.700.000         |
| XS2598063480 | 6,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Non-Pref.MTN 23/29          | GBP                                     | 1.650.000      | 1.650.000         |
| <b>HUF</b>   |   |   |                |                   |
| HU0000404744 | 2,2500 % Ungarn Notes 20/33                                 | HUF                                     | 0              | 2.000.000.000     |
| HU0000405550 | 4,7500 % Ungarn Notes S.2032/A 22/32                        | HUF                                     | 3.300.000.000  | 3.300.000.000     |
| <b>NOK</b>   |   |   |                |                   |
| NO0012440397 | 2,1250 % Koenigreich Norwegen Anl. 22/32                    | NOK                                     | 30.000.000     | 30.000.000        |
| NO0012712506 | 3,5000 % Koenigreich Norwegen Anl. 22/42                    | NOK                                     | 0              | 20.000.000        |
| <b>PLN</b>   |   |   |                |                   |
| PL0000108866 | 2,5000 % Republik Polen Bonds S.0726 15/26                  | PLN                                     | 15.000.000     | 15.000.000        |
| PL0000113783 | 1,7500 % Republik Polen Bonds S.D50432 21/32                | PLN                                     | 0              | 20.000.000        |

# Deka-Institutionell Renten Europa

| ISIN  | Gattungsbezeichnung                                       | Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|---|---|---|----------------|-------------------|
| <b>USD</b>  |   |   |                |                   |
| USF1067PAD80  | 9,2500 % BNP Paribas S.A. FLR Nts 22/Und. Reg.S           | USD                                     | 200.000        | 200.000           |
| XS2586007036  | 8,7500 % OTP Bank Nyrt. FLR MTN 23/33                     | USD                                     | 1.550.000      | 1.550.000         |
| US857524AD47  | 5,5000 % Republik Polen Notes 22/27                       | USD                                     | 1.700.000      | 1.700.000         |
| US857524AE20  | 5,7500 % Republik Polen Notes 22/32                       | USD                                     | 1.200.000      | 1.200.000         |
| USF8500RAC63  | 9,3750 % Société Générale S.A. FLR Notes 22/Und. Reg.S    | USD                                     | 575.000        | 575.000           |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |   |   |                |                   |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |   |   |                |                   |
| <b>EUR</b>  |   |   |                |                   |
| BE6331562817  | 0,8750 % Aliaxis Finance S.A. Notes 21/28                 | EUR                                     | 0              | 2.100.000         |
| XS2585891967  | 6,0000 % Banco BPM S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 22/28         | EUR                                     | 1.200.000      | 1.200.000         |
| XS1692931121  | 5,2500 % Banco Santander S.A. FLR Nts 17/Und.             | EUR                                     | 0              | 1.600.000         |
| XS2456432413  | 4,8750 % Coöperatieve Rabobank U.A. FLR Cap. Secs 22/Und. | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| FR0014006IG1  | 1,0810 % Crédit Logement FLR Notes 21/34                  | EUR                                     | 0              | 2.000.000         |
| XS2484327999  | 1,8750 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 22/30             | EUR                                     | 0              | 2.025.000         |
| XS2577042893  | 3,6250 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 23/37             | EUR                                     | 750.000        | 750.000           |
| XS2197076651  | 2,7500 % Helvetia Europe FLR Notes 20/41                  | EUR                                     | 0              | 1.050.000         |
| DE000A30VGD9  | 2,6250 % Heraeus Finance GmbH Anl. 22/27                  | EUR                                     | 0              | 3.700.000         |
| XS2385390724  | 0,6250 % Hldg d'Infra.Métiers Environ. Notes 21/28        | EUR                                     | 0              | 800.000           |
| XS2407010656  | 0,6250 % JDE Peet's N.V. MTN 21/28                        | EUR                                     | 0              | 1.850.000         |
| XS2413677464  | 10,7500 % Nova Ljubljanska Banka d.d. FLR Notes 22/32     | EUR                                     | 1.300.000      | 1.300.000         |
| XS2430287362  | 2,0850 % Prosus N.V. MTN 22/30 Reg.S                      | EUR                                     | 0              | 1.000.000         |
| XS2601459162  | 4,2500 % Siemens Energy Finance B.V. Notes 23/29          | EUR                                     | 1.100.000      | 1.100.000         |
| XS2581647091  | 7,1250 % Verisure Holding AB Notes 23/28 Reg.S            | EUR                                     | 575.000        | 575.000           |
| XS2378468420  | 2,1250 % Wuestenrot& Wuerttem. AG FLR Nachr. Anl. 21/41   | EUR                                     | 0              | 1.700.000         |
| <b>GBP</b>  |   |   |                |                   |
| XS2552367687  | 8,4100 % Barclays PLC FLR MTN 22/32                       | GBP                                     | 600.000        | 600.000           |
| <b>PLN</b>  |   |   |                |                   |
| PL0000114393  | 3,7500 % Republik Polen Bonds S.PS0527 21/27              | PLN                                     | 0              | 15.000.000        |
| <b>USD</b>  |   |   |                |                   |
| US48241FAB04  | 5,7960 % KBC Groep N.V. FLR Notes 23/29 144A              | USD                                     | 725.000        | 725.000           |
| XS2233264808  | 2,5690 % UniCredit S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 20/26         | USD                                     | 0              | 2.100.000         |
| <b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>  |   |   |                |                   |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |   |   |                |                   |
| <b>USD</b>  |   |   |                |                   |
| US514887AB47  | 6,8750 % Ldsbk Baden-Württemb. St. up Sub. Anl. 98/28144A | USD                                     | 1.500.000      | 1.500.000         |

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000  |
|--|------------------------------|-------------------|
| <b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b> |                              |                   |
| <b>Terminkontrakte</b>   |                              |                   |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>   |                              |                   |
| <b>Gekaufte Kontrakte:</b>   | <b>EUR</b>                   | <b>330.904</b>    |
| (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), EURO-BTP Future (FBTP), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT))       |                              |                   |
| <b>Verkaufte Kontrakte:</b>  | <b>EUR</b>                   | <b>184.222</b>    |
| (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO-BTP Future (FBTP), Long Term EURO OAT Future (FOAT))                                 |                              |                   |
| <b>Optionsrechte</b>   |                              |                   |
| <b>Optionsrechte auf Swaps (Swaptions)</b>   |                              |                   |
| <b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>  | <b>EUR</b>                   | <b>573</b>        |
| (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y)  |                              |                   |
| <b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>   | <b>EUR</b>                   | <b>154</b>        |
| (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y)  |                              |                   |
| <b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>   |                              |                   |
| <b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>   |                              |                   |
| <b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b>   | <b>EUR</b>                   | <b>285.805</b>    |
| (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))  |                              |                   |
| <b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>  | <b>EUR</b>                   | <b>108.605</b>    |
| (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))  |                              |                   |
| <b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b>  | <b>EUR</b>                   | <b>289.885</b>    |
| (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))  |                              |                   |
| <b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>   | <b>EUR</b>                   | <b>106.995</b>    |
| (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))  |                              |                   |
| <b>Währungsderivate</b>  |                              |                   |
| <b>Optionsrechte auf Devisen-Derivate</b>  |                              |                   |
| <b>Optionsrechte auf Devisen</b>   |                              |                   |
| <b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b>   |                              |                   |
| AUD/NZD  | <b>EUR</b>                   | <b>18.355</b>     |
| AUD/USD  | <b>EUR</b>                   | <b>12.051</b>     |
| EUR/CZK  | <b>EUR</b>                   | <b>486.000</b>    |
| EUR/GBP  | <b>EUR</b>                   | <b>13.200</b>     |
| EUR/HUF  | <b>EUR</b>                   | <b>24.813.700</b> |
| EUR/USD  | <b>EUR</b>                   | <b>148.748</b>    |
| NOK/SEK  | <b>EUR</b>                   | <b>18.611</b>     |

# Deka-Institutionell Renten Europa

| Gattungsbezeichnung                      | Stück bzw.<br>Anteile bzw. Whg. | Volumen<br>in 1.000 |
|--|---------------------------------|---------------------|
| NZD/USD                                  | EUR                             | 7.374               |
| USD/CLP                                  | EUR                             | 13.474.876          |
| USD/ILS                                  | EUR                             | 292.139             |
| USD/KRW                                  | EUR                             | 65.744.966          |
| USD/MXN                                  | EUR                             | 466.607             |
| USD/PLN                                  | EUR                             | 60.531              |
| USD/SEK                                  | EUR                             | 147.093             |
| <b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>  |                                 |                     |
| AUD/JPY                                  | EUR                             | 2.004.263           |
| AUD/NZD                                  | EUR                             | 21.767              |
| AUD/USD                                  | EUR                             | 44.255              |
| CAD/JPY                                  | EUR                             | 1.174.746           |
| EUR/HUF                                  | EUR                             | 17.424.000          |
| EUR/NOK                                  | EUR                             | 330.750             |
| EUR/USD                                  | EUR                             | 61.295              |
| GBP/CHF                                  | EUR                             | 18.419              |
| GBP/JPY                                  | EUR                             | 14.659.249          |
| GBP/NOK                                  | EUR                             | 219.991             |
| GBP/USD                                  | EUR                             | 111.622             |
| NZD/USD                                  | EUR                             | 4.504               |
| USD/CAD                                  | EUR                             | 111.756             |
| USD/CHF                                  | EUR                             | 112.535             |
| USD/JPY                                  | EUR                             | 25.310.321          |
| USD/MXN                                  | EUR                             | 3.693.399           |
| USD/NOK                                  | EUR                             | 1.050.149           |
| USD/SEK                                  | EUR                             | 96.618              |
| USD/TRY                                  | EUR                             | 54.439              |
| <b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b>    |                                 |                     |
| AUD/USD                                  | EUR                             | 7.788               |
| EUR/GBP                                  | EUR                             | 20.250              |
| EUR/HUF                                  | EUR                             | 24.930.500          |
| EUR/USD                                  | EUR                             | 123.378             |
| NOK/SEK                                  | EUR                             | 28.449              |
| USD/CLP                                  | EUR                             | 20.934.183          |
| USD/ILS                                  | EUR                             | 292.234             |
| USD/KRW                                  | EUR                             | 77.814.846          |
| USD/MXN                                  | EUR                             | 714.050             |
| USD/PLN                                  | EUR                             | 62.527              |
| USD/SEK                                  | EUR                             | 226.974             |
| <b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b> |                                 |                     |
| AUD/USD                                  | EUR                             | 44.014              |
| CAD/JPY                                  | EUR                             | 1.151.014           |
| EUR/HUF                                  | EUR                             | 17.424.000          |
| EUR/NOK                                  | EUR                             | 483.750             |
| EUR/USD                                  | EUR                             | 20.300              |
| GBP/CHF                                  | EUR                             | 26.898              |
| GBP/JPY                                  | EUR                             | 16.167.308          |
| GBP/NOK                                  | EUR                             | 216.340             |
| GBP/USD                                  | EUR                             | 111.748             |
| USD/CAD                                  | EUR                             | 95.779              |
| USD/CHF                                  | EUR                             | 104.188             |
| USD/JPY                                  | EUR                             | 21.786.033          |
| USD/MXN                                  | EUR                             | 3.314.382           |
| USD/NOK                                  | EUR                             | 1.203.574           |
| USD/SEK                                  | EUR                             | 142.113             |
| USD/TRY                                  | EUR                             | 59.824              |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>            |                                 |                     |
| <b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>  |                                 |                     |
| <b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>   |                                 |                     |
| AUD/EUR                                  | EUR                             | 4.130               |
| AUD/JPY                                  | EUR                             | 3.176               |
| AUD/NZD                                  | EUR                             | 17.419              |
| AUD/USD                                  | EUR                             | 52.704              |
| CAD/EUR                                  | EUR                             | 4.164               |
| CAD/USD                                  | EUR                             | 30.182              |
| CHF/EUR                                  | EUR                             | 7.733               |
| CHF/USD                                  | EUR                             | 74.262              |
| CZK/EUR                                  | EUR                             | 7.936               |
| DKK/EUR                                  | EUR                             | 12.659              |
| GBP/EUR                                  | EUR                             | 41.602              |
| GBP/JPY                                  | EUR                             | 3.438               |
| GBP/USD                                  | EUR                             | 57.345              |
| HUF/EUR                                  | EUR                             | 16.740              |
| ILS/USD                                  | EUR                             | 45.299              |
| JPY/EUR                                  | EUR                             | 3.642               |
| JPY/USD                                  | EUR                             | 33.231              |
| KRW/USD                                  | EUR                             | 143.253             |
| MXN/EUR                                  | EUR                             | 106                 |
| MXN/USD                                  | EUR                             | 47.160              |
| NOK/EUR                                  | EUR                             | 28.598              |

# Deka-Institutionell Renten Europa

| Gattungsbezeichnung   | Stück bzw.<br>Anteile bzw. Whg. | Volumen<br>in 1.000 |
|---|---------------------------------|---------------------|
| NOK/USD   | EUR                             | 10.482              |
| NZD/EUR   | EUR                             | 165                 |
| PLN/EUR   | EUR                             | 35.933              |
| PLN/HUF   | EUR                             | 4.625               |
| SEK/EUR   | EUR                             | 1.042               |
| SEK/USD   | EUR                             | 6.972               |
| USD/EUR   | EUR                             | 129.976             |
| <b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>  |                                 |                     |
| <b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>   |                                 |                     |
| AUD/EUR   | EUR                             | 3.311               |
| AUD/JPY   | EUR                             | 3.250               |
| AUD/NZD   | EUR                             | 17.443              |
| AUD/USD   | EUR                             | 52.728              |
| CAD/EUR   | EUR                             | 3.113               |
| CAD/USD   | EUR                             | 30.126              |
| CHF/EUR   | EUR                             | 14.363              |
| CHF/GBP   | EUR                             | 16.046              |
| CHF/USD   | EUR                             | 66.831              |
| CZK/EUR   | EUR                             | 10.044              |
| DKK/EUR   | EUR                             | 11.803              |
| GBP/CHF   | EUR                             | 15.804              |
| GBP/EUR   | EUR                             | 34.600              |
| GBP/JPY   | EUR                             | 3.395               |
| GBP/USD   | EUR                             | 57.406              |
| HUF/EUR   | EUR                             | 21.900              |
| ILS/USD   | EUR                             | 45.413              |
| JPY/EUR   | EUR                             | 3.822               |
| JPY/USD   | EUR                             | 34.892              |
| KRW/USD   | EUR                             | 143.320             |
| MXN/USD   | EUR                             | 57.372              |
| NOK/EUR   | EUR                             | 25.228              |
| NOK/USD   | EUR                             | 10.480              |
| NZD/EUR   | EUR                             | 128                 |
| PLN/EUR   | EUR                             | 41.353              |
| PLN/HUF   | EUR                             | 9.257               |
| SEK/EUR   | EUR                             | 774                 |
| SEK/USD   | EUR                             | 7.099               |
| USD/EUR   | EUR                             | 122.480             |
| <b>Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)</b>  |                                 |                     |
| <b>Zinsswaps</b>  | EUR                             | 2.657               |
| (Erhalten/Zahlen)   |                                 |                     |
| (Basiswert(e): IRS WIBORM06 PLN / 7.76% PLN)  |                                 |                     |
| <b>Credit Default Swaps (CDS)</b>   |                                 |                     |
| <b>Protection Buyer:</b>  | EUR                             | 18.000              |
| (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S38 V1 5Y)   |                                 |                     |
| <b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>   |                                 |                     |
| <b>unbefristet</b>  | EUR                             | 107.147             |
| (Basiswert(e): 0,1000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.OAK 20/35, 0,3750 % UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2116 22/33, 0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40, 1,1060 % Barclays PLC FLR MTN 21/32, 1,2500 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 20/30, 1,6250 % Société du Grand Paris MTN 22/42, 1,6500 % Republik Portugal Obr. 22/32, 2,3750 % BPCE S.A. Preferred MTN 22/32, 2,3750 % Stedin Holding N.V. MTN 22/30, 2,7500 % Europäische Union MTN 22/37, 2,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33, 2,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1551 23/32, 2,7500 % RWE AG MTN 22/30, 3,0000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 23/33, 3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43, 3,0000 % Universal Music Group N.V. MTN 22/27, 3,1250 % La Poste MTN 22/33, 3,6250 % RWE AG MTN 23/29, 3,7500 % ESB Finance DAC MTN 23/43, 3,7500 % Slowakei Anl. 23/35, 3,7500 % Universal Music Group N.V. MTN 22/32, 3,8750 % Crédit Agricole S.A. Preferred MTN 22/34, 3,8750 % E.ON SE MTN 23/35, 3,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/30, 3,8750 % Fresenius Medical Care KGaA MTN 22/27, 3,8750 % Republik Lettland MTN 22/27, 4,0000 % Slowakei Anl. 22/32, 4,1250 % Republik Litauen MTN 22/28, 4,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. MTN 22/25, 4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/29, 4,3750 % La Banque Postale Non-Preferred MTN 23/30, 4,5000 % A2A S.p.A. MTN 22/30, 4,5000 % Anglo American Capital PLC MTN 23/28, 4,5000 % BASF SE MTN 23/35, 4,7500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA FLR Pref. MTN 23/28, 4,7870 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 23/32, 5,0000 % Republik Rumänien MTN 22/26 Reg.S, 5,1250 % BPCE S.A. FLR MTN 23/35, 5,1250 % Commerzbank AG MT FLN 23/30, 5,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Non-Preferred MTN 23/33, 5,7630 % NatWest Group PLC FLR MTN 23/34, 6,0000 % Banco BPM S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 22/28, 6,1840 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR MTN 23/34, 6,2500 % Caixabank S.A. FLR MTN 22/33, 6,2500 % ING Groep N.V. FLR MTN 23/33, 6,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Non-Pref.MTN 23/29, 6,6250 % Republik Rumänien MTN 22/29 Reg.S, 7,1250 % Raiffeisenbank a.s. FLR Non-Pref. MTN 23/26, 8,4100 % Barclays PLC FLR MTN 22/32, 9,3750 % Société Générale S.A. FLR Notes 22/Und. Reg.S) |                                 |                     |

# Deka-Institutionell Renten Europa

## Anhang.

|                    |     |           |
|--------------------|-----|-----------|
| Umlaufende Anteile | STK | 4.945.961 |
| Anteilwert         | EUR | 61,15     |

### Angaben zu Bewertungsverfahren

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

#### Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

#### Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Für die Bewertung von Renten, rentenähnlichen Genussscheinen und Zertifikaten, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind, wird grundsätzlich der letzte verfügbare handelbare Kurs zugrunde gelegt. Renten, rentenähnliche Genussscheine und Zertifikate, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mit marktnahen Kursstellungen (in der Regel Brokerquotes, alternativ mit sonstigen Preisquellen) bewertet, welche auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden. Die Bewertung von Schuldscheindarlehen erfolgt in der Regel mit Modellbewertungen, die von externen Dienstleistern bezogen und auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden.

#### Investmentanteile

Investmentanteile werden zum letzten von der Investmentgesellschaft festgestellten Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Börsenkurs bewertet.

#### Derivate

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Futures und Optionen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mit Verkehrswerten bewertet, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Black-Scholes-Merton) ermittelt werden. Die Bewertung von Swaps erfolgt anhand von Fair Values, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Discounted-Cash-Flow-Verfahren) ermittelt werden. Devisentermingeschäfte werden nach der Forward Point Methode bewertet.

#### Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

#### Sonstiges

Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Fonds geführt werden, wird in diese Währung zu den jeweiligen Devisenkursen (i.d.R. Reuters-Fixing) umgerechnet.

### Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

#### (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

#### Verwendete Vermögensgegenstände

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

##### Marktwert in EUR

17.362.443,86

##### in % des Fondsvermögens

5,74

#### 10 größte Gegenparteien

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

##### Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

17.362.443,86

##### Sitzstaat

Deutschland

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

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

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

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

unbefristet

##### absolute Beträge in EUR

17.362.443,86

#### Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

#### Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

##### Wertpapier-Darlehen

EUR

GBP

#### Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

##### Wertpapier-Darlehen

unbefristet

##### absolute Beträge in EUR

19.762.611,08

#### Ertrags- und Kostenanteile

##### Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

Kostenanteil des Fonds

Ertragsanteil der KVG

##### absolute Beträge in EUR

12.647,64

0,00

0,00

##### in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00

0,00

0,00

Der oben ausgewiesene Kostenanteil des Fonds bzw. Ertragsanteil der KVG beinhaltet sowohl den Aufwandsersatz der Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) als auch zusätzliche Kosten Dritter. Damit werden der Infrastrukturaufwand der Kapitalverwaltungsgesellschaft und die Kosten des externen Wertpapierdarlehen-Serviceproviders für die Anbahnung, Durchführung und Abwicklung inklusive der Sicherheitenstellung abgegolten.



# Deka-Institutionell Renten Europa

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

## Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

6,82% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

| Wertpapier-Darlehen   | absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR |
|---|---|
| NatWest Markets PLC   | 8.329.082,34  |
| Berlin Hyp AG   | 3.749.982,94  |
| Citigroup Inc.  | 3.269.511,17  |
| International Business Machines Corp.   | 2.473.336,32  |
| Wirtschafts- und Infrastrukturbank Hessen - rechtlich unselbständige Anstalt in | 1.773.037,00  |
| Vonovia SE  | 167.661,32  |

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

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

|                                  |   |
|----------------------------------|---|
| Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer | 2   |
| J.P.Morgan AG Frankfurt          | 14.071.929,83 EUR (absolut/verwahrter Betrag) |
| Clearstream Banking Frankfurt    | 5.690.681,26 EUR (absolut/verwahrter Betrag)  |

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

## Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

|                             |       |
|-----------------------------|-------|
| gesonderte Konten/Depots    | 0,00% |
| Sammelkonten/Depots         | 0,00% |
| andere Konten/Depots        | 0,00% |
| Verwahrt bestimmt Empfänger | 0,00% |

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

Die Summenangabe der Sicherheiten nach Instrumentenart, Restlaufzeit, Sicherheitenaussteller und Verwahrer kann rundungsbedingt von der Summe der angegebenen Einzelwerte abweichen.

---

Frankfurt am Main, den 2. Mai 2023  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2021

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 93,1 Mio.

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Dr. Matthias Danne  
Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main und der WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf

### Stellvertretende Vorsitzende

Birgit Dietl-Benzin  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;  
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)  
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH, Köln  
und der Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;  
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Thomas Schneider  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A., Luxemburg;  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. April 2023

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



**Deka Investment GmbH**

Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

