

Halbjahresbericht  
zum 30. April 2024.

## **Deka-Institutionell Renten Europa**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. April 2024

## **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 2023 bis zum 30. April 2024.

Der intakte Trend rückläufiger Inflationsraten stabilisierte die Finanzmärkte und verlieh insbesondere den Aktienbörsen kräftigen Auftrieb. Gleichwohl findet die europäische Wirtschaft nur langsam zurück auf den Aufwärtspfad. Die deutsche Volkswirtschaft wies im ersten Quartal 2024 wieder Erholungstendenzen auf, nachdem das größte EWU-Mitglied 2023 noch als Wachstumsstütze ausgefallen war. Während sich in Europa ein moderates Anziehen der wirtschaftlichen Aktivität abzeichnet, präsentierte sich die Wirtschaftslage in den USA hingegen sehr robust. Jedoch sorgten die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken konzentrierte sich weiterhin auf die Inflations-Bekämpfung, wobei sich die Tonlage zum Jahresende 2023 spürbar abmilderte. Die Fed behielt das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei und in Euroland notierte der Hauptrefinanzierungssatz bei 4,50 Prozent. Mit ersten Anzeichen für ein Ende des Zinserhöhungs-Zyklus entfernten sich die Renditen ab November wieder sichtlich von ihren zuvor erreichten Höchstständen, bevor im ersten Quartal 2024 insbesondere die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und wieder ansteigende Renditen sorgten. Die Verzinsung 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende April bei 2,6 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,7 Prozent.

An den Aktienmärkten schlugen sich seit November die Zinssenkungserwartungen in signifikanten Kursanstiegen wider, sodass die wichtigsten Aktienindizes im Berichtszeitraum mehrheitlich erfreuliche Zuwächse verzeichneten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten auf ein neues Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Der chinesische Aktienmarkt litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer weiter schwelenden Immobilienkrise und hinkte trotz leichten Aufschlags der Marktentwicklung hinterher.

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 2024	6
Vermögensaufstellung zum 30. April 2024	7
Anhang	15
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	17

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

Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

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.

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

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.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-Institutionell Renten Europa

Performance*	6 Monate
	5,1%
ISIN	DE0007019416

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

1) Referenzindex: ICE BofA® Euro Broad Market 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 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>240.394.575,79</b>	<b>98,73</b>
Belgien	17.629.386,75	7,24
Dänemark	2.647.175,16	1,09
Deutschland	62.642.253,66	25,74
Finnland	5.517.356,25	2,27
Frankreich	15.382.206,00	6,31
Griechenland	2.958.360,00	1,22
Irland	9.614.036,00	3,95
Italien	34.515.520,75	14,17
Litauen	2.234.846,25	0,92
Luxemburg	1.389.444,00	0,57
Niederlande	10.056.396,50	4,12
Norwegen	2.237.036,25	0,92
Österreich	4.966.793,00	2,05
Polen	14.646.750,59	6,02
Portugal	10.789.023,50	4,44
Slowakei	5.145.187,50	2,11
Slowenien	5.404.761,00	2,22
Sonstige	4.704.869,13	1,92
Spanien	24.914.751,50	10,22
Tschechische Republik	2.998.422,00	1,23
<b>2. Derivate</b>	<b>-146.730,86</b>	<b>-0,05</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>270,25</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>40.306.360,00</b>	<b>16,56</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-37.100.265,01</b>	<b>-15,24</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>243.454.210,17</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>240.394.575,79</b>	<b>98,73</b>
DKK	2.647.175,16	1,09
EUR	230.102.874,01	94,50
HUF	2.068.801,53	0,85
PLN	2.840.810,09	1,17
USD	2.734.915,00	1,12
<b>2. Derivate</b>	<b>-146.730,86</b>	<b>-0,05</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>270,25</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>40.306.360,00</b>	<b>16,56</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-37.100.265,01</b>	<b>-15,24</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>243.454.210,17</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-Institutionell Renten Europa

## Vermögensaufstellung zum 30. April 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>230.575.714,54</b>	<b>94,69</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>230.575.714,54</b>	<b>94,69</b>
<b>EUR</b>								<b>220.284.012,76</b>	<b>90,46</b>
XS2435570895	0,6250 % ABN AMRO Bank N.V. Cov. MTN 22/37 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	0	% 72,888	1.457.760,00	0,60
XS2761358055	3,0000 % Achmea Bank N.V. MT Mortg.Cov.Bds 24/34	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 98,137	981.365,00	0,40
ES0200002097	3,5000 % Adif - Alta Velocidad MTN 23/28	EUR		1.400.000	0	0	% 100,446	1.406.244,00	0,58
FR001400KR43	3,7500 % Agence Française Développement MTN 23/38	EUR		700.000	0	0	% 102,336	716.348,50	0,29
BE6349638187	3,1250 % Argenta Spaarbank N.V. MT Pfe. 24/34	EUR		900.000	900.000	0	% 98,718	888.457,50	0,36
FR001400EZL5	3,2500 % Arkéa Public Sector SCF MT Obl.Fonc.Pu.S. 23/31	EUR		1.300.000	0	0	% 100,225	1.302.925,00	0,54
ES0413900913	3,3750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 23/30 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	0	% 99,835	1.996.700,00	0,82
PTBSPCOM0006	3,7500 % Banco Santander Totta S.A. MT Obr.Hip. 23/26	EUR		2.100.000	0	0	% 100,316	2.106.625,50	0,87
PTBSPAOM0008	3,3750 % Banco Santander Totta S.A. MT Obr.Hip. 23/28	EUR		1.800.000	0	0	% 99,657	1.793.826,00	0,74
PTBSPHOM0027	3,2500 % Banco Santander Totta S.A. MT Obr.Hip. 24/31	EUR		1.500.000	1.500.000	0	% 98,927	1.483.897,50	0,61
XS1829261087	2,0000 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 18/30	EUR		2.500.000	0	0	% 89,850	2.246.250,00	0,92
XS2778272471	4,0000 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 24/32	EUR		1.050.000	1.050.000	0	% 99,679	1.046.624,25	0,43
XS2778274410	4,3750 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 24/39	EUR		3.450.000	3.450.000	0	% 100,080	3.452.760,00	1,42
DE000A383JG8	3,0000 % Bauspark. Schwaebisch Hall AG MTN Pfe. S.10 24/33	EUR		700.000	700.000	0	% 98,949	692.643,00	0,28
DE000BHY0GM2	3,0000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 23/33	EUR		1.225.000	0	0	% 99,290	1.216.302,50	0,50
IT0005571952	3,7500 % BPER Banca S.p.A. Mrtg. Cov .MTN 23/28	EUR		1.875.000	1.875.000	0	% 101,152	1.896.600,00	0,78
FR0014005MV4	0,5000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 21/46	EUR		1.000.000	0	0	% 57,047	570.470,00	0,23
BE0002933142	3,7500 % Communauté française Belgique MTN 23/33	EUR		3.000.000	0	0	% 102,733	3.081.975,00	1,27
XS2577836187	2,8750 % Coöperatieve Rabobank U.A. MT Cov. Bds 23/33	EUR		3.000.000	0	0	% 98,465	2.953.950,00	1,21
IT0005585622	3,5000 % Credit Agr. Italia S.p.A. MT Mortg.Cov.Bds 24/36	EUR		1.300.000	1.300.000	0	% 100,245	1.303.185,00	0,54
IT0005549396	3,5000 % Credit Agricole Italia S.p.A. MT Mtg.Cov.Bds 23/30	EUR		3.000.000	0	0	% 100,143	3.004.290,00	1,23
FR001400FZ32	3,1250 % Crédit Mu. Home Loan SFH SA MT Obl.Fin.Hab. 23/33 <sup>1)</sup>	EUR		1.700.000	0	0	% 99,350	1.688.950,00	0,69
IT0005579294	3,2500 % Credito Emiliano S.p.A. MT Mortg.Cov.Bds 24/29	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 99,072	1.981.430,00	0,81
AT0000A2UXN9	0,5000 % Erste Group Bank AG MT Hyp.-Pfe. 22/37	EUR		1.600.000	0	0	% 70,032	1.120.512,00	0,46
EU000A3K4DM9	2,6250 % Europaeische Union MTN 22/48	EUR		525.000	525.000	0	% 88,797	466.181,63	0,19
EU000A3K4EL9	4,0000 % Europaeische Union MTN 23/44	EUR		650.000	650.000	900.000	% 109,261	710.196,50	0,29
EU000A3K4EU0	3,2500 % Europaeische Union MTN 24/50	EUR		1.100.000	1.100.000	0	% 98,456	1.083.016,00	0,44
EU000A3LT492	3,0000 % European Investment Bank MTN 24/39	EUR		2.500.000	2.500.000	0	% 97,819	2.445.475,00	1,00
BE0002890722	3,0000 % Flaemische Gemeinschaft MTN 22/32 <sup>1)</sup>	EUR		700.000	0	0	% 97,761	684.323,50	0,28
BE0390121847	3,1250 % Flaemische Gemeinschaft MTN 24/34	EUR		1.600.000	1.600.000	0	% 99,487	1.591.792,00	0,65
DE000A2G8W65	1,0000 % Freie Hansestadt Bremen Landessch. Ausg.217 19/39	EUR		2.000.000	0	0	% 73,900	1.478.000,00	0,61
XS0522079911	5,9000 % Generalitat Valenciana MTN 10/32	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 115,598	2.311.960,00	0,95
GR0124040743	3,3750 % Griechenland Notes 24/34	EUR		3.000.000	3.000.000	0	% 98,612	2.958.360,00	1,22
LU2773894873	2,8750 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 24/34	EUR		1.400.000	1.400.000	0	% 99,246	1.389.444,00	0,57
IT0005569964	4,0000 % ICCREA Banca - Ist.C.d.Cred.C. MT Cov. Bds 23/27	EUR		3.000.000	3.000.000	0	% 100,878	3.026.325,00	1,24
IT0005555112	3,8750 % ICCREA Banca - Ist.C.d.Cred.C. MT Cov. Bds 23/29	EUR		2.800.000	0	0	% 101,111	2.831.108,00	1,16
IT0005554578	3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MT Hyp.-Pfe. 23/28 <sup>1)</sup>	EUR		2.550.000	0	0	% 100,576	2.564.688,00	1,05
BE0000356650	2,7500 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 22/39	EUR		3.500.000	3.500.000	0	% 93,811	3.283.367,50	1,35
BE0000355645	1,4000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 22/53	EUR		2.000.000	0	0	% 62,556	1.251.110,00	0,51
BE0000359688	3,4500 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 23/43	EUR		1.500.000	0	1.500.000	% 100,588	1.508.812,50	0,62
BE0000362716	2,7000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 24/29	EUR		1.875.000	1.875.000	0	% 99,339	1.862.606,25	0,77
BE0000360694	2,8500 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 24/34	EUR		1.200.000	1.200.000	0	% 97,990	1.175.880,00	0,48

# Deka-Institutionell Renten Europa

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
NL0015001AM2	2,5000 % Koenigreich Niederlande Bonds 23/33		EUR	3.000.000	0	3.000.000	%	97,683	2.930.475,00	1,20
NL0015001RG8	3,2500 % Koenigreich Niederlande Bonds 23/44		EUR	1.650.000	0	0	%	105,021	1.732.846,50	0,71
ES0000012J07	1,0000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/42		EUR	575.000	0	0	%	64,740	372.255,00	0,15
ES0000012L78	3,5500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33		EUR	2.750.000	0	0	%	102,215	2.810.912,50	1,15
ES0000012L60	3,9000 % Koenigreich Spanien Bonos 23/39		EUR	1.400.000	0	0	%	102,945	1.441.230,00	0,59
ES0000012M85	3,2500 % Koenigreich Spanien Bonos 24/34		EUR	3.000.000	11.775.000	8.775.000	%	99,428	2.982.840,00	1,23
ES0000012G00	1,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/50		EUR	1.500.000	0	1.500.000	%	54,054	810.810,00	0,33
ES0000012K95	3,4500 % Koenigreich Spanien Obligaciones 22/43		EUR	1.500.000	0	0	%	95,657	1.434.855,00	0,59
ES0000012F43	0,6000 % Königreich Spanien Bonos 19/29		EUR	3.000.000	0	0	%	87,989	2.639.670,00	1,08
ES0000012G34	1,2500 % Königreich Spanien Obligaciones 20/30 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	0	0	%	89,544	2.686.320,00	1,10
ES0000012G42	1,2000 % Königreich Spanien Obligaciones 20/40		EUR	500.000	0	0	%	69,684	348.420,00	0,14
DE000A2TSTRO	0,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 19/39		EUR	2.500.000	2.500.000	0	%	73,026	1.825.650,00	0,75
DE000A3MP7J5	0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/25		EUR	5.000.000	0	3.000.000	%	96,317	4.815.850,00	1,98
XS2475954900	1,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/32		EUR	2.275.000	2.275.000	0	%	89,343	2.032.553,25	0,83
DE000A351MM7	2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.000.000	0	%	99,429	1.988.580,00	0,82
XS2626288760	2,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/30		EUR	7.800.000	0	0	%	99,349	7.749.222,00	3,18
XS2698047771	3,2500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/31		EUR	3.000.000	0	0	%	102,334	3.070.020,00	1,26
XS2586942448	2,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33		EUR	4.900.000	0	0	%	98,854	4.843.846,00	1,99
DE000A30V9M4	2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33		EUR	6.500.000	0	2.400.000	%	99,706	6.480.890,00	2,66
DE000A1RQEP6	2,7500 % Land Hessen Schatzanzw. S.2401 24/34 <sup>1)</sup>		EUR	2.500.000	2.500.000	0	%	97,951	2.448.762,50	1,01
DE000A1RQES0	3,1250 % Land Hessen Schatzanzw. S.2404 24/39		EUR	1.650.000	1.650.000	0	%	99,564	1.642.806,00	0,67
DE000A3823L6	2,6250 % Land Niedersachsen Landessch. Ausg.917 24/34		EUR	1.575.000	1.575.000	0	%	96,945	1.526.875,88	0,63
DE000NRW0KMO	1,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1445 17/57		EUR	2.125.000	2.125.000	0	%	69,851	1.484.333,75	0,61
DE000NRW0NW3	2,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1551 23/32		EUR	3.100.000	0	0	%	98,627	3.057.437,00	1,26
DE000NRW0N67	2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1561 23/33		EUR	2.300.000	0	0	%	99,523	2.289.017,50	0,94
DE000NRW0PE6	3,0000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1569 24/54		EUR	1.725.000	1.725.000	0	%	95,367	1.645.080,75	0,68
DE000SLB4360	3,0000 % Landesbank Saar Oeff.-Pfr.Ausg.436 24/34		EUR	1.200.000	1.200.000	0	%	98,487	1.181.838,00	0,49
XS2802191937	3,0000 % Nordea Mortgage Bank PLC MT Cov. Bds 24/34		EUR	1.500.000	1.500.000	0	%	98,804	1.482.060,00	0,61
PTNOBFOM0009	3,2500 % Novo Banco S.A. MT Obr.Hipotec. 24/27		EUR	700.000	700.000	0	%	99,364	695.544,50	0,29
DE000NWB0AK3	0,1000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.0AK 20/35		EUR	1.000.000	0	0	%	71,757	717.570,00	0,29
DE000NWB0AM9	0,5000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.0AM 21/41		EUR	3.100.000	0	0	%	63,628	1.972.452,50	0,81
DE000NWB0AR8	1,6250 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.0AR 22/32		EUR	2.650.000	0	0	%	90,665	2.402.622,50	0,99
AT000A39K79	3,1250 % Raiffeisen-Landesbank Tirol MT Cov. Bds 24/29		EUR	2.000.000	2.000.000	0	%	98,400	1.967.990,00	0,81
FR001400FG43	2,9000 % Région Île de France MTN 23/31		EUR	700.000	0	0	%	97,727	684.085,50	0,28
BE0002877588	2,8750 % Région Wallonne MTN 22/38		EUR	2.500.000	2.500.000	0	%	92,043	2.301.062,50	0,95
FI4000566294	2,9500 % Republik Finnland Bonds 24/55		EUR	2.000.000	2.000.000	0	%	95,824	1.916.480,00	0,79
IE00BH3SQ895	1,1000 % Republik Irland Treasury Bonds 19/29		EUR	6.000.000	6.000.000	0	%	92,253	5.535.180,00	2,27
IE00BKFCV345	0,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 20/35		EUR	900.000	0	0	%	76,318	686.862,00	0,28
IE000GVLBXU6	3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43		EUR	1.350.000	0	0	%	98,454	1.329.129,00	0,55
IE000LQ7YWY4	2,6000 % Republik Irland Treasury Bonds 24/34		EUR	2.125.000	2.125.000	0	%	97,076	2.062.865,00	0,85
IT0005321325	2,9500 % Republik Italien B.T.P. 18/38		EUR	1.500.000	0	0	%	88,060	1.320.892,50	0,54
IT0005416570	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 20/27		EUR	3.000.000	0	0	%	92,564	2.776.920,00	1,14
IT0005437147	0,0000 % Republik Italien B.T.P. 21/26		EUR	2.000.000	0	0	%	93,791	1.875.820,00	0,77
IT0005433195	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/37		EUR	3.000.000	0	0	%	69,949	2.098.470,00	0,86
IT0005530032	4,4500 % Republik Italien B.T.P. 22/43		EUR	2.850.000	0	0	%	102,512	2.921.577,75	1,20

# Deka-Institutionell Renten Europa

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
IT0005534141	4,5000 % Republik Italien B.T.P. 22/53		EUR	1.300.000	0	0	% 102,754	1.335.795,50	0,55
IT0005582421	4,1500 % Republik Italien B.T.P. 23/39		EUR	3.500.000	3.500.000	0	% 99,894	3.496.290,00	1,44
IT0005588881	1,8000 % Republik Italien Infl.Idx Lkd B.T.P. 23/36		EUR	2.100.000	2.100.000	0	% 99,149	2.082.129,00	0,86
XS2765498717	3,5000 % Republik Litauen MTN 24/34		EUR	2.275.000	2.275.000	0	% 98,235	2.234.846,25	0,92
AT0000A335K7	3,1500 % Republik Oesterreich MTN 23/53		EUR	1.000.000	0	0	% 98,762	987.615,00	0,41
AT0000A39UW5	2,9000 % Republik Oesterreich MTN 24/34		EUR	900.000	900.000	0	% 98,964	890.676,00	0,37
XS1346201889	2,3750 % Republik Polen MTN 16/36		EUR	2.000.000	3.850.000	1.850.000	% 86,395	1.727.900,00	0,71
XS2746102479	3,6250 % Republik Polen MTN 24/34		EUR	1.375.000	1.375.000	0	% 98,735	1.357.606,25	0,56
XS2746103014	4,1250 % Republik Polen MTN 24/44		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 98,740	1.974.800,00	0,81
PTOTPEOE0032	1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42		EUR	3.000.000	0	0	% 69,320	2.079.600,00	0,85
PTOTESOE0021	2,8750 % Republik Portugal Obr. 24/34		EUR	2.700.000	2.700.000	0	% 97,390	2.629.530,00	1,08
SI0002104576	3,0000 % Republik Slowenien Bonds 24/34		EUR	2.725.000	2.725.000	0	% 97,976	2.669.846,00	1,10
FR001400M048	3,5000 % SAGESSE-Soc.And.Gest.Std.Sec. MTN 23/29		EUR	1.100.000	1.100.000	0	% 101,176	1.112.930,50	0,46
SK4000023636	3,8750 % Slovenská Sporitelna AS MT Mortg.Cov.Bds 23/27		EUR	3.000.000	0	0	% 100,763	3.022.875,00	1,24
FR001400OR98	3,1250 % SNCF S.A. MTN 24/34		EUR	700.000	700.000	0	% 98,243	687.697,50	0,28
FR0013409612	1,1250 % Société des Grands Projets MTN 19/34		EUR	2.000.000	0	0	% 81,603	1.632.050,00	0,67
FR0014003CJ5	0,8750 % Société des Grands Projets MTN 21/46		EUR	2.800.000	0	0	% 58,410	1.635.480,00	0,67
FR0014009KL1	1,6250 % Société des Grands Projets MTN 22/42		EUR	2.000.000	0	0	% 73,660	1.473.200,00	0,61
XS2524675050	1,6250 % SR-Boligkredit A.S. Mortg. Covered MTN 22/28		EUR	2.375.000	0	0	% 94,191	2.237.036,25	0,92
FR001400LQ50	4,0000 % Stadt Paris MTN 23/37		EUR	800.000	800.000	0	% 104,593	836.744,00	0,34
DE000HV2AYS3	0,3750 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2116 22/33		EUR	3.800.000	0	0	% 79,603	3.024.914,00	1,24
XS2637445276	3,7500 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as Mort. Cov. Bds 23/28		EUR	2.100.000	0	0	% 100,188	2.103.948,00	0,86
XS2585977882	3,6250 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as Mrtg Cov.Bds 23/26		EUR	900.000	0	0	% 99,386	894.474,00	0,37
SK4000023685	3,8750 % Vseobecna MT Mortg.Cov.Bds 23/28		EUR	2.100.000	0	0	% 101,063	2.122.312,50	0,87
<b>DKK</b>								<b>2.647.175,16</b>	<b>1,09</b>
DK0009924888	2,2500 % Koenigreich Daenemark Anl. 24/26		DKK	20.000.000	20.000.000	0	% 98,712	2.647.175,16	1,09
<b>HUF</b>								<b>2.068.801,53</b>	<b>0,85</b>
XS2524813545	11,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/24		HUF	800.000.000	0	0	% 101,145	2.068.801,53	0,85
<b>PLN</b>								<b>2.840.810,09</b>	<b>1,17</b>
PL0000115291	6,0000 % Republik Polen Bonds S.DS1033 22/33		PLN	12.000.000	12.000.000	0	% 102,281	2.840.810,09	1,17
<b>USD</b>								<b>2.734.915,00</b>	<b>1,12</b>
XS2635185437	5,0000 % Republik Slowenien Notes 23/33 Reg.S		USD	3.000.000	3.000.000	2.250.000	% 97,600	2.734.915,00	1,12
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>9.818.861,25</b>	<b>4,04</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>9.818.861,25</b>	<b>4,04</b>
<b>EUR</b>								<b>9.818.861,25</b>	<b>4,04</b>
FR0014009N55	1,3750 % Action Logement Services SAS MTN 22/32		EUR	3.500.000	0	0	% 86,895	3.041.325,00	1,25
ES0200002121	3,5000 % Adif - Alta Velocidad MTN 24/32		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 99,668	1.196.010,00	0,49
ES0200002113	3,6500 % Adif - Alta Velocidad MTN 24/34		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 99,061	2.476.525,00	1,02
FI4000571104	3,0000 % Republik Finnland Bonds 24/34		EUR	2.125.000	2.125.000	0	% 99,709	2.118.816,25	0,87
DE000A3823V5	3,0000 % Sparkasse Pforzheim Calw Hyp.-Pfe. SP26 24/31		EUR	1.000.000	1.600.000	600.000	% 98,619	986.185,00	0,41
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 240.394.575,79</b>	<b>98,73</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>									
	EURO Bobl Future (FGBM) Juni 24		XEUR EUR	16.000.000				<b>522.850,00</b>	<b>0,21</b>
	EURO Bund Future (FGBL) Juni 24		XEUR EUR	-19.500.000				-188.800,00	-0,08
	EURO Schatz Future (FGBS) Juni 24		XEUR EUR	43.500.000				396.650,00	0,16
	EURO-BTP Future (FBTP) Juni 24		XEUR EUR	15.000.000				-226.200,00	-0,09
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Juni 24		XEUR EUR	-25.500.000				72.000,00	0,03
								469.200,00	0,19
<b>Optionsrechte</b>									
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>									
	EURO Bund Future (FGBL) Call Juni 24 131,5		XEUR EUR	Anzahl 190			EUR -0,026	-4.969,26	0,00
<b>Summe Zins-Derivate</b>								<b>EUR 517.880,74</b>	<b>0,21</b>
<b>Devisen-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									

# Deka-Institutionell Renten Europa

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>								<b>-22.961,57</b>	<b>-0,01</b>
<b>Offene Positionen</b>									
	CZK/EUR 37.445.000,00	OTC						885,39	0,00
	DKK/EUR 79.770.000,00	OTC						1.437,92	0,00
	JPY/USD 5.454.000.000,00	OTC						-137.222,46	-0,06
	MXN/EUR 50.690.000,00	OTC						-2.917,97	0,00
	PLN/EUR 8.435.000,00	OTC						-3.192,79	0,00
	SEK/EUR 2.330.000,00	OTC						-2.444,48	0,00
	TRY/USD 107.557.539,12	OTC						115.716,77	0,05
	USD/EUR 21.711.800,00	OTC						4.776,05	0,00
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>33.085,12</b>	<b>0,02</b>
<b>Offene Positionen</b>									
	CZK/EUR 44.163.000,00	OTC						-8.954,62	0,00
	DKK/EUR 92.700.000,00	OTC						15.212,54	0,01
	GBP/EUR 734.400,00	OTC						-6.233,53	0,00
	HUF/EUR 860.000.000,00	OTC						-15.355,17	-0,01
	JPY/EUR 1.795.000.000,00	OTC						154.458,20	0,06
	JPY/USD 4.129.776.180,00	OTC						-1.667,50	0,00
	MXN/USD 51.236.601,00	OTC						2.749,50	0,00
	NOK/EUR 20.960.000,00	OTC						13.109,95	0,01
	TRY/USD 107.725.416,00	OTC						-120.234,25	-0,05
<b>Optionsrechte</b>								<b>125.656,85</b>	<b>0,06</b>
<b>Optionsrechte auf Devisen (Kauf)</b>								<b>931.926,60</b>	<b>0,39</b>
	CALL EUR/USD 1,06950 03.05.2024	OTC	EUR	17.000.000	%	0,502		85.408,00	0,04
	CALL USD/TRY 37,50000 15.07.2024	OTC	USD	14.000.000	%	0,915		119.587,15	0,05
	PUT EUR/USD 1,06950 03.05.2024	OTC	EUR	17.000.000	%	0,189		32.181,00	0,01
	PUT USD/JPY 153,50000 03.05.2024	OTC	USD	22.000.000	%	0,083		17.111,75	0,01
	PUT USD/KRW 1370,00000 21.05.2024	OTC	USD	20.000.000	%	0,499		93.293,48	0,04
	PUT USD/MXN 16,70000 17.06.2024	OTC	USD	15.000.000	%	0,510		71.455,26	0,03
	PUT USD/TRY 34,00000 19.12.2024	OTC	USD	6.000.000	%	0,329		18.443,86	0,01
	PUT USD/TRY 35,82000 15.07.2024	OTC	USD	14.000.000	%	3,781		494.446,10	0,20
<b>Optionsrechte auf Devisen (Verkauf)</b>								<b>-806.269,75</b>	<b>-0,33</b>
	CALL USD/JPY 158,00000 03.05.2024	OTC	USD	-22.000.000	%	0,251		-51.660,75	-0,02
	CALL USD/TRY 36,00000 15.07.2024	OTC	USD	-14.000.000	%	1,655		-216.473,01	-0,09
	CALL USD/TRY 42,50000 19.12.2024	OTC	USD	-6.000.000	%	5,114		-286.622,45	-0,12
	PUT USD/KRW 1350,00000 21.05.2024	OTC	USD	-30.000.000	%	0,150		-42.144,59	-0,02
	PUT USD/MXN 16,20000 17.06.2024	OTC	USD	-15.000.000	%	0,070		-9.843,45	0,00
	PUT USD/TRY 34,50000 15.07.2024	OTC	USD	-14.000.000	%	1,526		-199.525,50	-0,08
<b>Summe Devisen-Derivate</b>								<b>EUR 135.780,40</b>	<b>0,07</b>
<b>Swaps</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Zinsswaps</b>								<b>-124.569,97</b>	<b>-0,05</b>
<b>(Erhalten/Zahlen)</b>									
	IRS 0.331% EUR / EURIBORM06 EUR / MERRILL_LDN 15.08.2025	OTC	EUR	30.000.000				-1.373.144,40	-0,56
	IRS 4,735% CZK / PRIBORM06 CZK / DBK_FRA 04.05.2028	OTC	CZK	250.000.000				332.273,87	0,14
	IRS 4,175% PLN / WIBORM06 PLN / DBK_FRA 12.09.2028	OTC	PLN	60.000.000				-329.872,93	-0,14
	IRS 4,47% GBP / SONIA GBP / BNP_PAR 25.09.2028	OTC	GBP	10.000.000				33.220,29	0,01
	IRS 5,0685% GBP / SONIA GBP / BNP_PAR 25.09.2025	OTC	GBP	18.000.000				19.651,60	0,01
	IRS EURIBORM06 EUR / 0,4765% EUR / JPM_LDN 15.02.2025	OTC	EUR	36.700.000				1.193.301,60	0,49
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>								<b>-741.472,03</b>	<b>-0,31</b>
<b>Protection Buyer</b>								<b>-741.472,03</b>	<b>-0,31</b>
	CDS ECTRVYYCF89VWYS6K36 / CITIGLMD_FRA 20.06.2027	OTC	USD	6.000.000				-143.539,66	-0,06
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S41 V1 5Y / GOLDMANS_FRA 20.06.2029	OTC	EUR	7.000.000				-597.932,37	-0,25
<b>Optionsrechte</b>									
<b>Optionsrechte auf Credit Default Swaps (CDS)</b>								<b>65.650,00</b>	<b>0,03</b>
<b>Payer Swap</b>								<b>65.650,00</b>	<b>0,03</b>
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S41 V1 5Y 19.06.2024	OTC	EUR	25.000.000	%	0,263		65.650,00	0,03
<b>Summe Swaps</b>								<b>EUR -800.392,00</b>	<b>-0,33</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CZK	6.798,52	%	100,000		270,25	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HUF	1,10	%	100,000		0,00	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	0,03	%	100,000		0,00	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		TRY	0,07	%	100,000		0,00	0,00
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR 270,25</b>	<b>0,00</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 270,25</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Zinsansprüche		EUR	2.855.279,09				2.855.279,09	1,17
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	369.131,90				369.131,90	0,15
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	839,18				839,18	0,00
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	31.144,30				31.144,30	0,01

# Deka-Institutionell Renten Europa

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	1.794.244,94				1.794.244,94	0,74
	Forderungen aus Devisenspots		EUR	32.641.345,59				32.641.345,59	13,41
	Forderungen aus Ersatzleistung Zinsen/Dividenden		EUR	14.375,00				14.375,00	0,01
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	2.600.000,00				2.600.000,00	1,07
	<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>40.306.360,00</b>	<b>16,56</b>
	<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>								
	<b>EUR-Kredite bei der Verwahrstelle</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	-142.190,35			% 100,000	-142.190,35	-0,06
	<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		MXN	-0,01			% 100,000	0,00	-0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	-473.235,71			% 100,000	-442.028,50	-0,18
	<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>						<b>EUR</b>	<b>-584.218,85</b>	<b>-0,24</b>
	<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-922.326,75				-922.326,75	-0,38
	Verbindlichkeiten aus Devisenspots		EUR	-33.062.555,14				-33.062.555,14	-13,58
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-151.164,27				-151.164,27	-0,06
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-2.380.000,00				-2.380.000,00	-0,98
	<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-36.516.046,16</b>	<b>-15,00</b>
	<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>243.454.210,17</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile</b>						<b>STK</b>	<b>3.964.287,000</b>	
	<b>Anteilwert</b>						<b>EUR</b>	<b>61,41</b>	

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

†) 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:				
0,6250 % ABN AMRO Bank N.V. Cov. MTN 22/37	EUR 500.000		364.440,00	
3,3750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 23/30	EUR 800.000		798.680,00	
3,1250 % Crédit Mu. Home Loan SFH SA MT Obl.Fin.Hab. 23/33	EUR 1.700.000		1.688.950,00	
3,0000 % Flaemische Gemeinschaft MTN 22/32	EUR 700.000		684.323,50	
3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MT Hyp.-Pfe. 23/28	EUR 1.500.000		1.508.640,00	
1,2500 % Königreich Spanien Obligaciones 20/30	EUR 1.229.000		1.100.495,76	
2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/26	EUR 2.000.000		1.988.580,00	
2,7500 % Land Hessen Schatzanw. S.2401 24/34	EUR 2.000.000		1.959.010,00	
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>	<b>EUR</b>		<b>10.093.119,26</b>	<b>10.093.119,26</b>

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.04.2024

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85368	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45795	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,79525	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,73770	= 1 Euro (EUR)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	34,69805	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,32050	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	25,15650	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	391,12500	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,07060	= 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso	(MXN)	18,22170	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	167,82000	= 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 (Marktzuordnung 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>			
CZ0001007025	5,7500 % Tschechien Bonds 23/29	CZK	0	140.000.000
	<b>DKK</b>			
DK0009924102	0,0000 % Koenigreich Daenemark Anl. 20/31	DKK	0	20.000.000
DK0009924532	2,2500 % Koenigreich Daenemark Anl. 22/33	DKK	0	77.500.000

# Deka-Institutionell Renten Europa

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
DK0009924615	2,2500 % Koenigreich Daenemark Anl. 23/33	DKK	0	18.000.000
DK0009922320	4,5000 % Königreich Dänemark Anl. 07/39	DKK	0	20.000.000
<b>EUR</b>				
ES0200002063	0,5500 % Adif - Alta Velocidad MTN 21/31	EUR	0	1800.000
DE000A3824G4	2,8750 % Bauspark. Schwaebisch Hall AG MTN Pfe. S.9 24/29	EUR	1.100.000	1.100.000
IT0005580276	3,2500 % Bca Pop. di Sondrio S.p.A. MT Mortg.Cov. Nts 24/29	EUR	2.575.000	2.575.000
XS2716887844	4,8750 % Bulgarien MTN 23/36	EUR	1.950.000	1.950.000
DE0001102614	1,8000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/53	EUR	0	1.625.000
DE000BU32005	2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl. Gruene 23/33	EUR	0	3.000.000
DE0001104867	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 21/23	EUR	0	5.000.000
DE0001104875	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 22/24	EUR	0	5.000.000
DE000BU22015	2,8000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 23/25	EUR	0	3.000.000
FR001400LDK9	3,6250 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 23/29	EUR	0	1.100.000
IT0005568123	4,7500 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 23/30	EUR	0	2.500.000
DE000CZ43Z23	3,1250 % Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P63 23/33	EUR	0	3.000.000
EU000A2SCAJ7	3,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 23/30	EUR	0	3.000.000
EU000A2SCAG3	2,8750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 23/33	EUR	0	2.400.000
EU000A2SCAK5	3,3750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 23/38	EUR	0	2.000.000
EU000A3K4DW8	2,7500 % Europaeische Union MTN 22/33	EUR	0	1.500.000
EU000A3K4DV0	3,3750 % Europaeische Union MTN 22/42	EUR	0	1.100.000
EU000A3K4DY4	3,0000 % Europaeische Union MTN 22/53	EUR	775.000	775.000
EU000A3K4EN5	3,1250 % Europaeische Union MTN 23/28	EUR	500.000	500.000
EU000A3LNF05	3,1250 % Europaeische Union MTN 23/30	EUR	0	1.025.000
EU000A3K4D41	3,2500 % Europaeische Union MTN 23/34	EUR	0	2.500.000
EU000A3K4D74	3,3750 % Europaeische Union MTN 23/38	EUR	0	1.550.000
EU000A3K4ES4	3,0000 % Europaeische Union MTN 24/34	EUR	1.650.000	1.650.000
EU000A1299S3	3,0000 % Europaeischer Stabilitaets.(ESM) MTN 23/33	EUR	0	725.000
EU000A3LVAL6	2,7500 % European Investment Bank MTN 24/29	EUR	2.100.000	2.100.000
EU000A3LS460	2,7500 % European Investment Bank MTN 24/34	EUR	2.175.000	2.175.000
DE000HCB0B28	3,6250 % Hamburg Commer. Bank AG Schiffs.-Pfe. S.2765 24/26	EUR	575.000	575.000
XS2719137965	6,0000 % Hungarian Export-Import Bk PLC Bonds 23/29	EUR	1.100.000	1.100.000
BE0000357666	3,0000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 23/33	EUR	0	3.000.000
XS2547290432	2,5000 % Koenigreich Daenemark MTN 22/24	EUR	0	3.000.000
ES0000012115	0,0000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/27	EUR	0	3.000.000
ES0000012K20	0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32	EUR	4.000.000	4.000.000
ES0000012K46	1,9000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/52	EUR	0	2.675.000
ES0000012L52	3,1500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33	EUR	0	1.000.000
ES0000012M93	4,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 24/54	EUR	1.025.000	1.025.000
XS2226280088	0,1250 % KommuneKredit MTN 20/40	EUR	0	3.000.000
ES0000012B88	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 18/28	EUR	0	2.000.000
DE000NRW0NX1	2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1552 23/53	EUR	0	2.125.000
DE000A30VKN0	1,9500 % NRW Staedteanleihe 7 NRW Staedteanl.Nr.7 22/32	EUR	0	1.000.000
PTRAAJOM0008	3,7200 % Região Autónoma Acores Notes 23/28	EUR	0	3.500.000
FR0013515806	0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40	EUR	0	2.100.000
FR001400FTH3	3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/54	EUR	0	1.425.000
FR001400NEF3	3,0000 % Rep. Frankreich OAT 23/49	EUR	1.050.000	1.050.000
XS2740429076	3,2500 % Republik Estland MTN 24/34	EUR	1.775.000	1.775.000
FI4000557525	2,8750 % Republik Finnland Bonds 23/29	EUR	0	3.000.000
FI4000550249	3,0000 % Republik Finnland Bonds 23/33	EUR	0	2.500.000
IE00BMD03L28	0,3500 % Republik Irland Treasury Bonds 22/32	EUR	0	4.000.000
XS2788435050	3,5000 % Republik Island MTN 24/34	EUR	725.000	725.000
IT0005542359	4,0000 % Republik Italien B.T.P. 23/31	EUR	0	2.400.000
IT0005532723	2,0000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 23/28	EUR	0	3.500.000
XS2722876609	3,8750 % Republik Lettland MTN 23/29	EUR	1.450.000	1.450.000
AT0000A2WSC8	0,9000 % Republik Oesterreich MTN 22/32	EUR	0	2.000.000
AT0000A2Y8G4	1,8500 % Republik Oesterreich MTN 22/49	EUR	0	850.000
AT0000A324S8	2,9000 % Republik Oesterreich MTN 23/33	EUR	0	1.075.000
XS2726911931	3,6250 % Republik Polen MTN 23/30	EUR	2.050.000	2.050.000
XS2689949399	5,5000 % Republik Rumaenien MTN 23/28 Reg.S	EUR	0	2.000.000
FR0013420429	1,2000 % Stadt Paris MTN 19/39	EUR	0	1.000.000
XS2753429047	4,0000 % Ungarn Bonds 24/29	EUR	1.575.000	1.575.000
<b>GBP</b>				
XS2318615569	0,3750 % Municipality Finance PLC MTN Tr.3 21/25	GBP	0	1800.000
<b>NOK</b>				
NO0012837642	3,0000 % Koenigreich Norwegen Anl. 23/33	NOK	0	20.000.000
NO0013148338	3,6250 % Koenigreich Norwegen Anl. 24/34	NOK	21.400.000	21.400.000
<b>USD</b>				
XS2756521303	6,3750 % Republik Rumänien MTN 24/34 Reg.S	USD	1.524.000	1.524.000
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES0000106759	3,4000 % Comun. Autónoma del País Vasco Obligaciones 24/34	EUR	1.625.000	1.625.000
XS2689049059	3,5000 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 23/27	EUR	0	1.250.000
<b>NOK</b>				
NO0010705536	3,0000 % Königreich Norwegen Anl. 14/24	NOK	0	40.000.000

Gattungsbezeichnung

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

Volumen in 1.000

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

# Deka-Institutionell Renten Europa

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b> (Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Schatz Future (FGBS), EURO-BTP Future (FBTP), Long Gilt Future (FLG))	EUR	109.696
<b>Verkaufte Kontrakte:</b> (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), Long Term EURO OAT Future (FOAT))	EUR	237.943
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Swaps (Swaptions)</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b> (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S40 V1 5Y)	EUR	104
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b> (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	125.028
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b> (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	41.250
<b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b> (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	25.175
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b> (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	40.650
<b>Währungsderivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen</b>		
<b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
AUD/CHF	EUR	14.873
AUD/NZD	EUR	11.786
AUD/USD	EUR	32.062
EUR/HUF	EUR	10.815.000
EUR/USD	EUR	49.630
GBP/USD	EUR	14.023
NOK/SEK	EUR	35.491
USD/CAD	EUR	69.734
USD/CHF	EUR	20.311
USD/ILS	EUR	129.630
USD/KRW	EUR	18.833.087
USD/MXN	EUR	304.190
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
CHF/JPY	EUR	9.111.546
EUR/AUD	EUR	28.135
EUR/CAD	EUR	38.480
EUR/CZK	EUR	697.200
EUR/JPY	EUR	8.609.500
EUR/NOK	EUR	218.300
EUR/PLN	EUR	418.693
EUR/USD	EUR	167.057
GBP/USD	EUR	35.123
NZD/USD	EUR	15.641
USD/JPY	EUR	15.304.292
USD/MXN	EUR	211.851
<b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
AUD/USD	EUR	32.242
CHF/JPY	EUR	9.358.491
EUR/HUF	EUR	10.815.000
EUR/JPY	EUR	9.009.500
EUR/PLN	EUR	105.960
EUR/USD	EUR	16.275
USD/CHF	EUR	30.813
USD/ILS	EUR	37.243
USD/JPY	EUR	2.518.354
USD/MXN	EUR	310.362
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
EUR/CZK	EUR	1.037.400
EUR/NOK	EUR	211.825
EUR/PLN	EUR	315.013
NOK/SEK	EUR	34.588
USD/JPY	EUR	12.899.135
USD/MXN	EUR	767.618
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/CHF	EUR	5.104
AUD/EUR	EUR	27.475
AUD/NZD	EUR	2.908
CAD/EUR	EUR	35.071
CAD/USD	EUR	30.963
CHF/EUR	EUR	2.168
CHF/JPY	EUR	15.285
CZK/EUR	EUR	22.620
DKK/EUR	EUR	37.743

# Deka-Institutionell Renten Europa

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
GBP/EUR	EUR	18.980
GBP/USD	EUR	8.051
HUF/EUR	EUR	21.542
ILS/EUR	EUR	2.860
ILS/USD	EUR	6.022
JPY/EUR	EUR	62.016
JPY/USD	EUR	18.857
KRW/USD	EUR	34.930
MXN/EUR	EUR	7.696
MXN/USD	EUR	55.952
NOK/EUR	EUR	51.113
NOK/SEK	EUR	38.322
NZD/EUR	EUR	7
NZD/USD	EUR	10.151
PLN/EUR	EUR	45.678
SEK/EUR	EUR	26.429
USD/EUR	EUR	253.054
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/CHF	EUR	10.153
AUD/EUR	EUR	27.613
AUD/NZD	EUR	2.902
CAD/EUR	EUR	35.083
CAD/USD	EUR	31.071
CHF/AUD	EUR	5.089
CHF/EUR	EUR	2.033
CHF/JPY	EUR	15.298
CZK/EUR	EUR	28.390
DKK/EUR	EUR	54.981
GBP/EUR	EUR	11.503
GBP/SEK	EUR	7.120
GBP/USD	EUR	19.155
HUF/EUR	EUR	27.665
ILS/EUR	EUR	2.870
ILS/USD	EUR	6.068
JPY/EUR	EUR	70.113
JPY/USD	EUR	10.746
KRW/USD	EUR	31.512
MXN/EUR	EUR	4.702
MXN/USD	EUR	58.881
NOK/EUR	EUR	78.169
NOK/SEK	EUR	14.221
NZD/USD	EUR	10.118
PLN/EUR	EUR	43.646
SEK/EUR	EUR	2.537
USD/EUR	EUR	242.444
<b>Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)</b>		
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>		
<b>Protection Buyer:</b>	EUR	7.000
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S40 V1 5Y)		
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
<b>befristet</b>	EUR	2.263
(Basiswert(e): 0,6000 % Königreich Spanien Bonos 19/29, 3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43)		
<b>unbefristet</b>	EUR	150.889
(Basiswert(e): 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 21/23, 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 22/24, 0,3750 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2116 22/33, 0,6250 % ABN AMRO Bank N.V. Cov. MTN 22/37, 1,1000 % Republik Irland Treasury Bonds 19/29, 1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42, 1,2500 % Königreich Spanien Obligaciones 20/30, 2,0000 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 18/30, 2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl. Gruene 23/33, 2,3750 % Republik Polen MTN 16/36, 2,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33, 2,7500 % Land Hessen Schatzanw. S.2401 24/34, 2,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1551 23/32, 2,8500 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 24/34, 2,8750 % Coöperatieve Rabobank U.A. MT Cov. Bds 23/33, 2,8750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/33, 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1552 23/53, 2,9000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1561 23/33, 3,0000 % Achmea Bank N.V. MT Mortg.Cov.Bds 24/34, 3,0000 % Flaemische Gemeinschaft MTN 22/32, 3,0000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 23/33, 3,0000 % Landesbank Saar Oeff.-Pfe.Ausg.436 24/34, 3,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 23/43, 3,0000 % Republik Slowenien Bonds 24/34, 3,0000 % Sparkasse Pforzheim Calw Hyp.-Pfe. S.P26 24/31, 3,1250 % Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P63 23/33, 3,2500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 23/31, 3,6250 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 23/29, 3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MT Hyp.-Pfe. 23/28, 3,6250 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as Mrtg Cov.Bds 23/26, 3,7500 % Banco Santander Totta S.A. MT Obr.Hip. 23/26, 3,8750 % ICCREA Banca - Ist.C.d.Cred.C. MT Cov. Bds 23/29, 4,0000 % Ungarn Bonds 24/29, 4,7500 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 23/30, 5,5000 % Republik Rumaenien MTN 23/28 Reg.S)		

# Deka-Institutionell Renten Europa

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	3.964.287
Anteilwert	EUR	61,41

### 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 Umsatzvolumina 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

10.093.119,26

in % des Fondsvermögens

4,15

#### 10 größte Gegenparteien

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

10.093.119,26

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

10.093.119,26

#### 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

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

##### Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

14.460.112,66

#### Ertrags- und Kostenanteile

##### Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

absolute Beträge in EUR

12.024,21

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00

Kostenanteil des Fonds

0,00

0,00

Ertragsanteil der KVG

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.

## Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

4,20% (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
Bayerische Landesbodenkreditanstalt	5.908.631,42
E.ON SE	4.345.158,40
Berlin Hyp AG	1.532.352,54
Orange S.A.	1.204.084,72
European Investment Bank (EIB)	815.711,04
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	483.458,52
ABN AMRO Bank N.V.	170.716,02

## 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	1.469.885,58 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt	12.990.227,08 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.

## Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten/Depots	0,00%
Sammelkonten/Depots	0,00%
andere Konten/Depots	0,00%
Verwahrart bestimmt Empfänger	0,00%

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

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 2024  
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 2022

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

### Alleingeschafterin

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 Munning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)  
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 2024

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)

