

# Halbjahresbericht zum 30. Juni 2022. Frankfurter-Sparinrent Deka

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

Verwaltungsgesellschaft: Deka Investment GmbH

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2022

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Frankfurter-Sparrent Deka für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 30. Juni 2022.

Bis in den Februar 2022 hinein beherrschte die Corona-Pandemie die Schlagzeilen an den Börsen, wobei die Inflationsentwicklung zunehmend an Bedeutung gewann. Die Erholung der globalen Wirtschaft setzte sich zunächst fort, wobei sich das Wachstumstempo in Euroland verlangsamte. Der Überfall-Angriff Russlands auf die Ukraine Ende Februar markierte als exogenes Schockereignis den Wendepunkt und versetzte das Geschehen an den internationalen Kapitalmärkten in den Krisenmodus. Umfangreiche Sanktionsmaßnahmen des Westens wurden gegen den russischen Aggressor auf den Weg gebracht. Russland seinerseits verhängte Gegenmaßnahmen und stoppte die Lieferung von Gas in mehrere europäische Länder oder reduzierte wahlweise die Liefermengen. Signifikante Preissteigerungen für Energie und Rohstoffe, Lieferkettenprobleme sowie Corona-Lockdowns in China belasteten das Marktumfeld.

Die Geld- und Fiskalpolitik wurde in den vergangenen sechs Monaten von der rasanten Inflationsentwicklung dominiert. Sowohl die EZB als auch die Federal Reserve haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet. Darüber hinaus vollzog die US-Notenbank die Leitzinswende und erhöhte diesen im März um 25, Anfang Mai um 50 Basispunkte und Mitte Juni um weitere 75 Basispunkte. Dank einer stark expansiven Finanzpolitik haben sich die USA rascher als Europa von der Pandemie erholt. Zudem trifft der Krieg gegen die Ukraine die europäische Wirtschaft um ein Vielfaches stärker. Für die EZB ist daher eine Zinserhöhung problematischer. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo kräftig an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 1,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,0 Prozent.

Nahezu sämtliche bedeutenderen Aktienmärkte weltweit rangierten per saldo auf negativem Terrain. Die Inflationsentwicklung, hohe Rohstoffpreise, Lieferkettenprobleme sowie der Krieg in der Ukraine setzten die Kurse wiederholt unter Druck. Insbesondere Wachstumstitel – etwa aus dem Technologiebereich – waren hiervon überdurchschnittlich stark betroffen.

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. Juni 2022	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022	7
Anhang	17
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	18

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

# Frankfurter-Sparinvest Deka Anlagepolitik.

Das Anlageziel dieses Investmentfonds ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, überwiegend in verzinsliche Wertpapiere zu investieren. Anleihen europäischer Aussteller bilden den Anlageschwerpunkt. Dabei werden insbesondere Unternehmensanleihen, Anleihen öffentlicher Aussteller (z.B. Staatsanleihen) sowie besicherte verzinsliche Wertpapiere (z.B. Pfandbriefe und Covered Bonds) erworben. Das Fondsmanagement investiert darüber hinaus auch in fremde Währungen und globale Anleihen (auch aus Schwellenländern/Emerging Markets). Es werden auch Anleihen von Ausstellern beigemischt, die eine geringere Schuldnerqualität aufweisen. 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. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden. Dieser Investmentfonds darf mehr als 35% des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland sowie des Landes Hessen investieren.

Die Erträge eines Geschäftsjahres werden grundsätzlich ausgeschüttet.

Die Anleger können börsentäglich die Rücknahme der Anteile verlangen. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Rücknahme aussetzen oder einschränken, wenn außergewöhnliche Umstände dies zur Wahrnehmung der Anlegerinteressen erforderlich erscheinen lassen. Setzt die Verwaltungsgesellschaft die Rücknahme von Anteilen ganz oder teilweise aus und lehnt daher die Rücknahme der Anteile ganz (Rücknahmeaussetzung) oder teilweise (Rücknahmebeschränkung) ab, kann dies dazu führen, dass der Auftrag ganz zu einem späteren Zeitpunkt ausgeführt wird oder dass ein Auftrag in Höhe seines nicht ausgeführten Anteils erlischt.

## Wichtige Kennzahlen

### Frankfurter-Sparinvest Deka

Performance*	6 Monate
	-7,9%
ISIN	DE0008479981
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

# Frankfurter-Sparinrent Deka

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>25.750.295,26</b>	<b>95,62</b>
Andorra	94.300,00	0,35
Australien	87.324,50	0,32
Belgien	71.790,50	0,27
Bulgarien	477.460,50	1,77
Chile	178.340,59	0,66
Deutschland	5.021.429,68	18,63
Finnland	723.888,00	2,69
Frankreich	2.358.407,19	8,75
Großbritannien	183.145,00	0,68
Indonesien	98.317,00	0,37
Irland	1.161.378,88	4,31
Island	263.038,50	0,98
Israel	72.090,00	0,27
Italien	1.483.372,00	5,51
Japan	621.844,13	2,31
Kanada	429.273,38	1,59
Kolumbien	142.143,75	0,53
Korea, Republik	196.739,00	0,73
Kroatien	90.156,50	0,33
Lettland	163.349,38	0,61
Litauen	93.385,00	0,35
Luxemburg	389.803,00	1,45
Mexiko	212.624,25	0,79
Neuseeland	190.352,00	0,71
Niederlande	2.964.005,89	11,02
Norwegen	332.136,50	1,23
Österreich	180.644,00	0,67
Philippinen	75.015,00	0,28
Polen	354.365,40	1,31
Portugal	1.513.455,50	5,62
Rumänien	82.187,50	0,31
Schweden	576.428,00	2,13
Schweiz	420.500,75	1,56
Slowakei	143.399,00	0,54
Sonstige	459.734,49	1,71
Spanien	2.509.529,49	9,32
Tschechische Republik	555.517,38	2,06
Ungarn	98.933,13	0,37
USA	680.490,50	2,53
<b>2. Derivate</b>	<b>342.826,76</b>	<b>1,28</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.336.587,67</b>	<b>4,98</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>192.914,50</b>	<b>0,71</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-695.787,36</b>	<b>-2,59</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>26.926.836,83</b>	<b>100,00</b>

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>25.750.295,26</b>	<b>95,62</b>
CZK	326.242,88	1,21
DEM	64.852,26	0,24
EUR	24.165.129,14	89,74
GBP	793.825,65	2,95
ITL	221.904,74	0,82
USD	178.340,59	0,66
<b>2. Derivate</b>	<b>342.826,76</b>	<b>1,28</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.336.587,67</b>	<b>4,98</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>192.914,50</b>	<b>0,71</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-695.787,36</b>	<b>-2,59</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>26.926.836,83</b>	<b>100,00</b>

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

# Frankfurter-Sparinrent Deka

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>21.659.378,74</b>	<b>80,43</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>21.659.378,74</b>	<b>80,43</b>
<b>EUR</b>								<b>20.252.553,21</b>	<b>75,21</b>
ES0265936023	0,5000 % ABANCA Corporación Bancaria SA FLR MTN 21/27	EUR		100.000	0	100.000	% 85,090	85.089,50	0,32
XS2189592616	1,3750 % ACS, Act.de Constr.y Serv. SA MTN 20/25	EUR		100.000	0	0	% 93,653	93.653,00	0,35
XS2464405229	2,2500 % AIB Group PLC FLR MTN 22/28	EUR		100.000	100.000	0	% 91,836	91.835,50	0,34
XS2228897158	1,0000 % Akelius Resid.Ppty Fincng B.V. MTN 20/28	EUR		150.000	0	0	% 83,778	125.666,25	0,47
XS2462466611	1,5000 % Akzo Nobel N.V. MTN 22/28	EUR		125.000	125.000	0	% 91,307	114.133,13	0,42
XS2451372499	1,2500 % ALD S.A. MTN 22/26 Reg.S	EUR		200.000	200.000	0	% 92,078	184.156,00	0,68
DE000A3KY359	0,5000 % Allianz Finance II B.V. MTN 21/33	EUR		100.000	0	200.000	% 75,833	75.833,00	0,28
XS2063246198	1,3750 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 19/25	EUR		100.000	100.000	0	% 97,660	97.660,00	0,36
XS2206379567	2,2500 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 20/27	EUR		200.000	0	0	% 95,845	191.689,00	0,71
XS2363117321	0,3000 % American Honda Finance Corp. MTN S.A 21/28	EUR		150.000	0	0	% 84,517	126.775,50	0,47
XS2445667236	1,2500 % Andorra MTN 22/27	EUR		100.000	100.000	0	% 94,300	94.300,00	0,35
XS2459053943	0,8950 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) MT Mg.Cov.Bds 22/27	EUR		200.000	200.000	0	% 95,176	190.352,00	0,71
XS2328980979	0,0100 % Asahi Group Holdings Ltd. Notes 21/24	EUR		150.000	150.000	0	% 96,606	144.908,25	0,54
XS2412267358	1,0000 % ASTM S.p.A. MTN 21/26	EUR		100.000	0	0	% 87,626	87.625,50	0,33
XS1558491855	1,6250 % Atlantia S.p.A. MTN 17/25	EUR		100.000	0	0	% 91,375	91.375,00	0,34
XS2485259241	1,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/25	EUR		200.000	200.000	0	% 96,977	193.954,00	0,72
PTBPCPHOM0066	1,1250 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR MT Obl. 21/27	EUR		200.000	0	0	% 83,740	167.480,00	0,62
XS2353366268	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28	EUR		100.000	0	0	% 81,820	81.820,00	0,30
XS1991397545	1,7500 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR		100.000	100.000	0	% 96,745	96.744,50	0,36
XS2028816028	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. Preferred MTN 19/25	EUR		200.000	0	0	% 92,743	185.485,00	0,69
XS2465984289	1,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 22/26	EUR		100.000	100.000	0	% 95,015	95.014,50	0,35
XS2465609191	1,0000 % Bank of Montreal MT Mortg.Cov. Bds 22/26	EUR		175.000	275.000	100.000	% 97,079	169.887,38	0,63
ES0213679HN2	0,8750 % Bankinter S.A. Non-Pref. Obl. 19/26	EUR		200.000	0	0	% 90,252	180.503,00	0,67
XS2456247605	0,7500 % BASF SE MTN 22/26	EUR		200.000	200.000	0	% 93,646	187.292,00	0,70
XS2356569736	1,0000 % Bayerische Landesbank FLR Sub. Anl. 21/31	EUR		100.000	0	0	% 85,475	85.475,00	0,32
XS2411178630	1,3750 % Bayerische Landesbank FLR Sub. Anl. 21/32	EUR		200.000	0	0	% 82,961	165.922,00	0,62
XS2239091080	1,2500 % Black Sea Trade & Developmt Bk MTN 20/30	EUR		200.000	0	0	% 73,223	146.446,00	0,54
XS1839682116	3,5000 % Bulgarian Energy Holding EAD Bonds 18/25	EUR		150.000	0	0	% 93,182	139.773,00	0,52
XS2367164576	2,4500 % Bulgarian Energy Holding EAD Bonds 21/28	EUR		225.000	0	0	% 82,750	186.187,50	0,69
XS2234571425	0,3750 % Bulgarien MTN 20/30	EUR		200.000	200.000	0	% 75,750	151.500,00	0,56
DE0001102481	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 19/50	EUR		300.000	200.000	0	% 63,154	189.462,00	0,70
PTCGDCOM0037	0,3750 % Caixa Geral de Depósitos S.A. FLR Pref. MTN 21/27	EUR		100.000	0	0	% 87,362	87.362,00	0,32
XS2468378059	1,6250 % Caixabank S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26	EUR		100.000	100.000	0	% 95,199	95.198,50	0,35
ES0415306093	0,7500 % Caja Rural de Navarra S.C.d.C. Céd. Hipotec. 22/29	EUR		200.000	200.000	0	% 90,848	181.696,00	0,67
XS2348237871	1,5000 % Cellnex Finance Company S.A. MTN 21/28	EUR		200.000	0	0	% 78,360	156.720,00	0,58
XS2084418339	0,8750 % CEZ AS MTN 19/26	EUR		150.000	0	0	% 90,140	135.210,00	0,50
XS2461786829	2,3750 % CEZ AS MTN 22/27	EUR		100.000	100.000	0	% 94,065	94.064,50	0,35
XS2239845097	0,5000 % Chanel Ceres PLC Notes 20/26	EUR		200.000	0	0	% 91,573	183.145,00	0,68
XS2393742122	1,6250 % Citadele banka FLR Preferred Nts 21/26	EUR		175.000	0	0	% 93,343	163.349,38	0,61
XS1890836296	1,5000 % Cloverie PLC MT LPN Zurich I. 18/28	EUR		100.000	0	0	% 92,423	92.422,50	0,34
FR0014000XY6	0,3750 % CNP Assurances S.A. MTN 20/28	EUR		100.000	0	0	% 81,889	81.888,50	0,30
DE000CZ40LD5	4,0000 % Commerzbank AG Nachr. MTN S.865 16/26	EUR		100.000	0	0	% 97,339	97.338,50	0,36
FR0014009857	1,0000 % Crédit Agricole S.A. MTN 22/25	EUR		100.000	100.000	0	% 95,987	95.986,50	0,36
CH1174335732	2,1250 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 22/26	EUR		100.000	100.000	0	% 93,305	93.305,00	0,35

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS1419674525	1,5540 % DAA Finance PLC Notes 16/28		EUR	125.000	0	0	% 90,414	113.016,88	0,42
XS2475502832	2,3750 % De Volksbank N.V. FLR Non-Pref. MTN 22/27		EUR	200.000	200.000	0	% 95,747	191.494,00	0,71
DE000DL19VR6	1,0000 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/25		EUR	100.000	0	0	% 94,354	94.354,00	0,35
DE000DL19WL7	1,8750 % Deutsche Bank AG FLR MTN 22/28		EUR	100.000	100.000	0	% 90,193	90.192,50	0,33
XS2363244513	2,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN 21/24		EUR	300.000	0	0	% 94,063	282.187,50	1,05
XS2408458730	2,8750 % Deutsche Lufthansa AG MTN 21/27		EUR	100.000	0	100.000	% 79,875	79.875,00	0,30
DE000A3T0X22	0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35408 21/25		EUR	100.000	100.000	0	% 90,365	90.365,00	0,34
XS2466401572	1,8750 % Diageo Capital B.V. MTN 22/34		EUR	100.000	100.000	0	% 87,333	87.333,00	0,32
XS2306601746	1,8750 % easyJet FinCo B.V. MTN 21/28		EUR	100.000	0	0	% 81,400	81.400,00	0,30
XS2459544339	1,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/29		EUR	100.000	100.000	0	% 90,843	90.842,50	0,34
XS0603195370	5,6000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 11/31		EUR	100.000	100.000	0	% 114,762	114.762,00	0,43
AT0000A2RZL4	0,7500 % Erste & Steiermaerkische Bank FLR Pref. MTN 21/28		EUR	100.000	0	100.000	% 90,157	90.156,50	0,33
XS2297177664	0,2500 % Essity AB MTN 21/31		EUR	200.000	0	0	% 77,172	154.344,00	0,57
XS2343114687	0,8750 % Eurofins Scientific S.E. Bonds 21/31		EUR	175.000	0	100.000	% 74,870	131.022,50	0,49
XS2491664137	4,0000 % Eurofins Scientific S.E. Bonds 22/29		EUR	100.000	100.000	0	% 99,539	99.538,50	0,37
XS2180509999	1,5000 % Ferrari N.V. Notes 20/25		EUR	250.000	0	0	% 96,507	241.267,50	0,90
FI4000507132	4,2500 % Finnair Oyj Notes 21/25		EUR	200.000	0	0	% 83,250	166.500,00	0,62
XS2198798659	1,6250 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS 20/24		EUR	100.000	100.000	0	% 96,887	96.886,50	0,36
XS2198879145	2,1250 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS 20/27		EUR	75.000	0	175.000	% 91,117	68.337,38	0,25
XS2324724645	1,8750 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS 21/28		EUR	140.000	0	160.000	% 87,763	122.868,20	0,46
XS2325562697	0,8750 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 21/31		EUR	125.000	0	0	% 74,368	92.960,00	0,35
XS2237447961	1,1250 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 20/33		EUR	100.000	0	0	% 73,133	73.132,50	0,27
XS2482872418	1,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 22/25		EUR	100.000	100.000	0	% 97,268	97.268,00	0,36
PTGALLOM0004	1,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 17/23		EUR	100.000	0	0	% 99,875	99.874,50	0,37
XS2444424639	1,0000 % General Motors Financial Co. MTN 22/25		EUR	100.000	100.000	0	% 94,776	94.775,50	0,35
ES0000095879	4,2200 % Generalitat de Catalunya Obl. 05/35		EUR	150.000	0	0	% 107,880	161.820,00	0,60
DE000A168478	6,0000 % Gothaer Allgem.Versicherung AG Nach.FLR Anl. 15/45		EUR	100.000	0	0	% 101,211	101.211,00	0,38
XS2435603571	0,6250 % Heimstadn Bostad Treasury B.V MTN 22/25		EUR	150.000	150.000	0	% 86,988	130.481,25	0,48
DE000A3E5S00	0,6250 % HOCHTIEF AG MTN 21/29		EUR	150.000	0	100.000	% 69,435	104.152,50	0,39
XS2397538252	1,3750 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. MTN 21/36		EUR	100.000	100.000	0	% 72,505	72.504,50	0,27
FR0014001YE4	0,7500 % Iliad S.A. Obl. 21/24		EUR	100.000	0	0	% 93,750	93.750,00	0,35
PTCPECOM0001	4,0470 % Infraestruturas de Portugal SA Bonds 06/26		EUR	100.000	100.000	0	% 109,436	109.436,00	0,41
XS2022179662	2,0000 % Israel MTN 19/69		EUR	100.000	0	0	% 72,090	72.090,00	0,27
ES0000090797	1,8750 % Junta de Andalucía Bonos 18/28		EUR	200.000	0	0	% 98,092	196.183,00	0,73
ES0000012K61	2,5500 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32		EUR	110.000	210.000	100.000	% 99,598	109.557,25	0,41
XS2463711643	2,0000 % Kojamo Oyj MTN 22/26		EUR	100.000	100.000	0	% 89,389	89.388,50	0,33
DE000A2DAR65	0,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 17/27		EUR	200.000	0	0	% 95,728	191.455,00	0,71
XS1612940558	0,2500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 17/25		EUR	300.000	300.000	0	% 97,242	291.726,00	1,08
DE000A3E5XN1	0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/32		EUR	250.000	250.000	0	% 83,325	208.311,25	0,77
FR00140044X1	0,7500 % La Banque Postale Non-Pref. MTN 21/31		EUR	300.000	0	0	% 76,960	230.878,50	0,86
FR0014001IP3	0,6250 % La Poste MTN 21/36		EUR	100.000	0	0	% 66,656	66.656,00	0,25
DE000A162A83	1,7500 % Landesbank Berlin AG Nachr. IHS S.558 19/29		EUR	300.000	0	0	% 85,934	257.800,50	0,96
XS2489772991	4,5000 % Lb.Hessen-Thueringen GZ FLR MTN S.H354 22/32		EUR	200.000	200.000	0	% 96,900	193.800,00	0,72
XS2384269101	0,2500 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 21/26		EUR	175.000	0	0	% 87,543	153.199,38	0,57
XS2477154871	2,1250 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 22/25		EUR	100.000	100.000	0	% 97,079	97.079,00	0,36
FR0014009EH2	0,4820 % L'Oréal S.A. FLR Notes 22/24		EUR	200.000	200.000	0	% 101,059	202.117,00	0,75

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS1596740453	2,2500 % Madrileña Red de Gas Fin. B.V. MTN 17/29		EUR	100.000	100.000	0	% 87,524	87.523,50	0,33
ES0224244105	2,8750 % Mapfre S.A. Obl. 22/30		EUR	100.000	100.000	0	% 87,984	87.984,00	0,33
XS2388876232	0,9660 % mBank S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/27		EUR	100.000	0	0	% 82,123	82.123,00	0,30
XS1876097715	1,0580 % mBank S.A. MTN 18/22		EUR	100.000	0	0	% 99,953	99.953,40	0,37
XS2491029380	2,3750 % Merck Financial Services GmbH MTN 22/30		EUR	100.000	100.000	0	% 98,098	98.098,00	0,36
XS2407028435	0,8750 % MVM Energetika Zrt. Bonds 21/27		EUR	125.000	0	0	% 79,147	98.933,13	0,37
XS2434710799	0,4100 % National Grid North Amer. Inc. MTN 22/26		EUR	100.000	100.000	0	% 91,420	91.420,00	0,34
XS2411311652	0,3990 % NTT Finance Corp. MTN 21/28		EUR	100.000	0	0	% 86,424	86.423,50	0,32
XS2447987483	1,9190 % ORIX Corp. MTN 22/26		EUR	175.000	175.000	0	% 94,769	165.844,88	0,62
XS2056560571	2,1250 % Permanent TSB Group Hldgs PLC FLR MTN 19/26		EUR	100.000	0	0	% 97,812	97.811,50	0,36
XS2346125573	1,1250 % Polski Koncern Naftowy Orlen MTN 21/28		EUR	100.000	0	0	% 77,856	77.856,00	0,29
FR0014007KL5	0,5000 % RCI Banque S.A. Senior MTN 22/25		EUR	100.000	100.000	0	% 90,053	90.053,00	0,33
PTRAAHOM0000	1,0950 % Região Autónoma Acores Notes 21/36		EUR	100.000	0	0	% 76,012	76.012,00	0,28
PTRAAIOM0009	2,1630 % Região Autónoma Acores Notes 22/32		EUR	200.000	200.000	0	% 92,686	185.372,00	0,69
PTRAMBOM0010	1,1410 % Região Autónoma Madeira Bonds 20/34		EUR	100.000	100.000	0	% 77,066	77.065,50	0,29
FR0013410552	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 19/29		EUR	100.000	0	300.000	% 116,229	116.229,44	0,43
FI4000517677	0,5000 % Republik Finnland Bonds 22/43		EUR	130.000	130.000	0	% 70,295	91.383,50	0,34
XS1432493440	3,7500 % Republik Indonesien MTN 16/28 Reg.S		EUR	100.000	0	0	% 98,317	98.317,00	0,37
IE00BH35Q895	1,1000 % Republik Irland Treasury Bonds 19/29		EUR	300.000	0	0	% 96,651	289.953,00	1,08
XS2293755125	0,0000 % Republik Island MTN 21/28		EUR	300.000	0	0	% 87,680	263.038,50	0,98
IT0005383309	1,3500 % Republik Italien B.T.P. 19/30		EUR	100.000	100.000	0	% 88,586	88.586,00	0,33
IT0005474330	0,0000 % Republik Italien B.T.P. 21/24		EUR	250.000	250.000	0	% 95,805	239.511,25	0,89
IT0005433690	0,2500 % Republik Italien B.T.P. 21/28		EUR	150.000	0	0	% 87,225	130.836,75	0,49
IT0005449969	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/31		EUR	100.000	0	0	% 81,317	81.317,00	0,30
XS2487342649	2,1250 % Republik Litauen MTN 22/32		EUR	100.000	200.000	100.000	% 93,385	93.385,00	0,35
XS2114767457	0,0000 % Republik Polen MTN 20/25		EUR	100.000	100.000	0	% 94,433	94.433,00	0,35
PTOTEKOE0011	2,8750 % Republik Portugal Obr. 15/25		EUR	250.000	250.000	0	% 105,089	262.722,50	0,98
PTOTETOE0012	2,8750 % Republik Portugal Obr. 16/26		EUR	100.000	0	0	% 105,491	105.491,00	0,39
PTOTEKOE0024	1,9500 % Republik Portugal Obr. 19/29		EUR	250.000	250.000	0	% 100,008	250.020,00	0,93
PTOTEYOE0031	1,6500 % Republik Portugal Obr. 22/32		EUR	100.000	350.000	250.000	% 92,620	92.620,00	0,34
XS2178857954	3,6240 % Republik Rumänien MTN 20/30 Reg.S		EUR	100.000	100.000	0	% 82,188	82.187,50	0,31
XS2489287354	2,1250 % Sandvik AB MTN 22/27		EUR	100.000	100.000	0	% 97,165	97.164,50	0,36
FR0014009KQ0	1,2500 % Sanofi S.A. MTN 22/29		EUR	100.000	100.000	0	% 92,746	92.745,50	0,34
FR0013518081	1,3750 % SEB S.A. Notes 20/25		EUR	100.000	0	0	% 95,843	95.843,00	0,36
DE000A3H2UX0	1,7500 % Sixt SE MTN 20/24		EUR	250.000	0	0	% 97,858	244.643,75	0,91
SK4000019857	1,0000 % Slowakei Anl. 21/51		EUR	100.000	100.000	0	% 61,195	61.195,00	0,23
FR0014009KL1	1,6250 % Société du Grand Paris MTN 22/42		EUR	100.000	100.000	0	% 83,427	83.427,00	0,31
FR001400A2T9	1,7500 % Société Générale SFH S.A. MT Obl.Fin.Hab. 22/34		EUR	100.000	100.000	0	% 92,075	92.074,50	0,34
XS2478523108	1,7500 % SpareBank 1 Boligk. AS MT Mortg.Cov. Bds 22/32		EUR	150.000	150.000	0	% 94,079	141.118,50	0,52
XS2472845911	1,7500 % SPAREBANK 1 ØSTLANDET Preferred MTN 22/27		EUR	200.000	200.000	0	% 95,509	191.018,00	0,71
FR001400AFL5	1,8750 % Suez S.A. MTN 22/27		EUR	100.000	100.000	0	% 95,283	95.282,50	0,35
CH1130818847	0,5000 % Swiss Life Finance I Ltd. Bonds 21/31		EUR	175.000	0	0	% 77,193	135.087,75	0,50
SK4000018925	0,5000 % Tatra Banka AS FLR MTN 21/28		EUR	100.000	0	0	% 82,204	82.204,00	0,31
FR0014006TQ7	1,7500 % TDF Infrastructure SAS Obl. 21/29		EUR	200.000	0	0	% 81,592	163.183,00	0,61
XS2345996743	1,0000 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. MTN 21/29		EUR	150.000	0	0	% 75,963	113.944,50	0,42
XS2441574089	1,1250 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. MTN 22/27		EUR	250.000	250.000	0	% 84,390	210.975,00	0,78
XS2477935345	1,6250 % TenneT Holding B.V. MTN 22/26		EUR	100.000	100.000	0	% 97,141	97.140,50	0,36
XS2463934864	2,6250 % Teollisuuden Voima Oyj MTN 22/27		EUR	100.000	100.000	0	% 92,655	92.654,50	0,34
XS2435614693	0,3750 % The Bank of Nova Scotia MT Mortg.Cov. Bds 22/30		EUR	300.000	300.000	0	% 86,462	259.386,00	0,96
XS2484106716	1,3750 % The Export-Import Bk of Korea MTN 22/25		EUR	200.000	200.000	0	% 98,370	196.739,00	0,73
XS2292954893	0,2500 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 21/28		EUR	150.000	0	0	% 83,510	125.264,25	0,47



# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2430284930	0,4400 % Toyota Finance Australia Ltd. MTN 22/28		EUR	100.000	100.000	0	% 87,325	87.324,50	0,32
FR0013332988	1,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 18/25		EUR	100.000	0	0	% 91,778	91.778,00	0,34
ES0380907057	4,5000 % Unicaja Banco S.A. FLR Preferred MTN 22/25		EUR	100.000	100.000	0	% 100,462	100.461,50	0,37
XS2450200824	0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 22/26		EUR	100.000	100.000	0	% 94,900	94.900,00	0,35
XS2478685931	2,2500 % UPM Kymmene Corp. MTN 22/29		EUR	100.000	100.000	0	% 93,352	93.351,50	0,35
AT000B122080	0,8750 % Volksbank Wien AG Non-Preferred MTN 21/26		EUR	200.000	0	0	% 90,322	180.644,00	0,67
XS2438616240	0,8750 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 22/28		EUR	175.000	175.000	0	% 86,578	151.510,63	0,56
XS2491738352	3,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. MTN 22/25		EUR	100.000	100.000	0	% 101,033	101.032,50	0,38
XS2343822503	0,6250 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 21/29		EUR	150.000	0	0	% 79,730	119.595,00	0,44
DE000A3MQS56	1,3750 % Vonovia SE MTN 22/26		EUR	100.000	100.000	0	% 92,620	92.620,00	0,34
FI4000523287	2,3750 % VR-Group Plc Notes 22/29		EUR	200.000	200.000	0	% 95,305	190.610,00	0,71
XS2392462730	0,5000 % Werfenlife S.A. Notes 21/26		EUR	100.000	0	0	% 90,254	90.254,00	0,34
XS2433361719	1,0000 % Wizz Air Finance Company B.V. MTN 22/26		EUR	100.000	100.000	0	% 82,434	82.433,50	0,31
XS2231715322	3,0000 % ZF Finance GmbH MTN 20/25		EUR	200.000	0	0	% 88,150	176.300,00	0,65
CH1170565753	2,0200 % Zuercher Kantonalbank FLR Notes 22/28		EUR	200.000	200.000	0	% 96,054	192.108,00	0,71
<b>DEM</b>								<b>64.852,26</b>	<b>0,24</b>
DE0001345759	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero Bonds 96/26	DEM		150.000	0	0	% 84,560	64.852,26	0,24
<b>CZK</b>								<b>326.242,88</b>	<b>1,21</b>
CZ0003529794	2,7450 % NET4GAS s.r.o. Bonds 21/31	CZK		6.000.000	0	0	% 46,647	113.143,07	0,42
CZ0001004253	2,4000 % Tschechien Anl. S.89 14/25	CZK		5.000.000	0	0	% 90,600	183.126,49	0,68
CZ0001004477	0,9500 % Tschechien Anl. S.94 15/30	CZK		1.000.000	0	0	% 74,145	29.973,32	0,11
<b>GBP</b>								<b>793.825,65</b>	<b>2,95</b>
XS2294319194	0,1250 % Asian Development Bank MTN 21/26	GBP		300.000	0	0	% 89,895	313.288,49	1,17
XS2106542165	1,7500 % Commerzbank AG MTN Anl. S.947 20/25	GBP		200.000	0	0	% 93,121	216.354,17	0,80
XS0096272355	5,2500 % Königreich Spanien MTN 99/29	GBP		200.000	0	0	% 113,707	264.182,99	0,98
<b>ITL</b>								<b>221.904,74</b>	<b>0,82</b>
XS0071094667	0,0000 % Commerzbank AG Zero LI-Anl. Tr.46 96/26	ITL		500.000.000	0	0	% 85,933	221.904,74	0,82
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>4.090.916,52</b>	<b>15,19</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>4.090.916,52</b>	<b>15,19</b>
<b>EUR</b>								<b>3.912.575,93</b>	<b>14,53</b>
XS1953929608	2,8000 % Acquirente Unico S.p.A. Notes 19/26	EUR		100.000	0	0	% 100,374	100.373,50	0,37
XS239323071	0,8000 % AGCO International Holdings BV Notes 21/28	EUR		175.000	0	0	% 80,191	140.334,25	0,52
XS2491963638	3,6250 % AIB Group PLC FLR MTN 22/26	EUR		100.000	100.000	0	% 99,814	99.814,00	0,37
BE6331562817	0,8750 % Aliaxis Finance S.A. Notes 21/28	EUR		100.000	0	0	% 71,791	71.790,50	0,27
XS2452433910	1,3750 % American Medical Syst.Eu. B.V. Notes 22/28	EUR		100.000	100.000	0	% 91,206	91.205,50	0,34
FR001400BDD5	3,3750 % Arval Service Lease S.A. MTN 22/26	EUR		200.000	200.000	0	% 99,790	199.579,00	0,74
XS2407019798	0,3750 % AXA Logistics Euro. Master SCA Notes 21/26 Reg.S	EUR		100.000	0	0	% 86,738	86.737,50	0,32
XS2394063437	0,5000 % Brenntag Finance B.V. MTN 21/29	EUR		100.000	0	0	% 78,364	78.363,50	0,29
XS2468979302	3,1250 % CETIN Group N.V. MTN 22/27	EUR		150.000	150.000	0	% 92,000	138.000,00	0,51
XS2412556461	1,1250 % Credito Emiliano S.p.A. FLR Notes 22/28 Reg.S	EUR		200.000	200.000	0	% 86,690	173.379,00	0,64
XS2356029541	0,5000 % CTP N.V. MTN 21/25	EUR		125.000	0	0	% 85,560	106.950,00	0,40
XS2466172363	1,6250 % Daimler Truck Intl Finance MTN 22/27	EUR		100.000	100.000	0	% 93,921	93.921,00	0,35
XS2451376219	1,3750 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 22/34	EUR		180.000	180.000	0	% 83,476	150.256,80	0,56
XS2459747874	1,8500 % East Japan Railway Co. MTN 22/33	EUR		150.000	150.000	0	% 88,342	132.513,00	0,49
FR0011408657	3,4500 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 13/33	EUR		100.000	0	0	% 96,833	96.832,50	0,36
XS2081491727	0,8150 % FCC Serv.Medio Ambiente Hld.SA Notes 19/23	EUR		150.000	0	0	% 98,816	148.223,25	0,55
DE000A30VGD9	2,6250 % Heraeus Finance GmbH Anl. 22/27	EUR		300.000	300.000	0	% 96,194	288.582,00	1,07

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
XS2385390724	0,6250 % Hldg d'Infra.Métiers Environ. Notes 21/28		EUR	125.000	0	0	% 80,279	100.348,75	0,37	
XS2407010656	0,6250 % JDE Peet's N.V. MTN 21/28		EUR	175.000	0	0	% 84,126	147.219,63	0,55	
DE000HLB1KN5	2,5000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ Nachr. IHS 14/24		EUR	28.000	0	0	% 97,500	27.300,00	0,10	
XS2391865305	1,0000 % Linde PLC MTN 21/51		EUR	200.000	0	0	% 53,977	107.953,00	0,40	
FR0014003Y09	0,6250 % MACIF Notes 21/27		EUR	100.000	0	0	% 85,599	85.598,50	0,32	
IT0005499543	2,3750 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Mortg.Cov.MTN 22/27		EUR	200.000	200.000	0	% 100,510	201.019,00	0,75	
XS2444273168	2,3750 % Mexiko Notes 22/30		EUR	125.000	125.000	0	% 84,825	106.031,25	0,39	
XS2465984107	1,6310 % Mizuho Financial Group Inc. MTN 22/27		EUR	100.000	100.000	0	% 92,155	92.154,50	0,34	
XS2498042584	3,3750 % Niederlandse Gasunie, N.V. MTN 22/34		EUR	100.000	100.000	0	% 99,938	99.937,50	0,37	
XS1824425182	3,6250 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 18/25		EUR	120.000	0	0	% 88,828	106.593,00	0,40	
XS2334361354	1,2000 % Philippinen Bonds 21/33		EUR	100.000	0	0	% 75,015	75.015,00	0,28	
XS2484339499	1,8750 % PPG Industries Inc. Notes 22/25		EUR	100.000	100.000	0	% 98,024	98.023,50	0,36	
XS2494945939	3,8750 % Rentokil Initial Finance B.V. MTN 22/27		EUR	100.000	100.000	0	% 101,554	101.553,50	0,38	
XS1385239006	3,8750 % Republik Kolumbien Bonds 16/26		EUR	150.000	0	0	% 94,763	142.143,75	0,53	
XS2388182573	0,5000 % Smurfit Kappa Treasury PUC Notes 21/29		EUR	100.000	0	0	% 80,598	80.598,00	0,30	
XS2479941572	2,0000 % VISA Inc. Notes 22/29		EUR	150.000	150.000	0	% 96,155	144.231,75	0,54	
<b>USD</b>								<b>178.340,59</b>	<b>0,66</b>	
US168863DX33	2,7500 % Republik Chile Notes 22/27		USD	200.000	200.000	0	% 93,125	178.340,59	0,66	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>25.750.295,26</b>	<b>95,62</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>-21.745,48</b>	<b>-0,08</b>	
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 22		XEUR	EUR	-1.600.000				-11.440,00	-0,04	
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 22		XEUR	EUR	-400.000				-9.430,00	-0,04	
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 22		XCBT	USD	-900.000				-5.109,34	-0,02	
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep.22		XEUR	EUR	-800.000				15.440,00	0,06	
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 22		XCBT	USD	-300.000				-4.982,17	-0,02	
Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB) Sep. 22		XCBT	USD	-200.000				-6.223,97	-0,02	
<b>Summe Zins-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>-21.745,48</b>	<b>-0,08</b>
<b>Devisen-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>										
								<b>18.305,50</b>	<b>0,06</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
AUD/EUR 106.000,00			OTC					370,50	0,00	
AUD/USD 549.225,72			OTC					-410,55	0,00	
CHF/EUR 34.288,00			OTC					595,56	0,00	
GBP/EUR 259.884,00			OTC					1.026,84	0,00	
JPY/AUD 24.000.000,00			OTC					751,44	0,00	
NOK/EUR 9.033.000,00			OTC					14.496,36	0,05	
NZD/EUR 495.000,00			OTC					1.394,50	0,01	
PLN/EUR 46.000,00			OTC					80,85	0,00	
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>-7.305,27</b>	<b>-0,02</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
CHF/USD 286.070,70			OTC					-582,84	0,00	
CZK/EUR 10.756.000,00			OTC					-1.916,23	-0,01	
GBP/EUR 600.000,00			OTC					254,98	0,00	
JPY/USD 24.300.000,00			OTC					105,16	0,00	
NOK/USD 8.310.000,00			OTC					-3.809,46	-0,01	
NZD/USD 937.409,86			OTC					1.874,36	0,01	
PLN/EUR 46.000,00			OTC					-67,36	0,00	
RON/EUR 1.100.000,00			OTC					-396,59	0,00	
USD/EUR 250.000,00			OTC					-2.767,29	-0,01	
<b>Optionsrechte</b>								<b>62.948,57</b>	<b>0,24</b>	
<b>Optionsrechte auf Devisen (Kauf)</b>								<b>172.104,76</b>	<b>0,64</b>	
CALL AUD/USD 0,72500 08.07.2022		OTC	AUD	1.500.000			% 0,007	64,81	0,00	
CALL EUR/CZK 25,00000 08.07.2022		OTC	EUR	1.500.000			% 0,094	1.404,09	0,01	
CALL EUR/GBP 0,86200 08.07.2022		OTC	EUR	1.500.000			% 0,320	4.803,00	0,02	
CALL EUR/USD 1,06250 08.07.2022		OTC	EUR	1.500.000			% 0,059	878,21	0,00	
PUT GBP/CHF 1,16000 28.07.2022		OTC	GBP	1.000.000			% 1,010	11.736,48	0,04	
PUT GBP/CHF 1,18000 01.07.2022		OTC	GBP	2.500.000			% 1,470	42.686,04	0,16	
PUT GBP/CHF 1,20500 01.07.2022		OTC	GBP	1.000.000			% 3,611	41.953,02	0,16	
PUT GBP/JPY 160,00000 13.07.2022		OTC	GBP	1.000.000			% 0,176	2.044,56	0,01	
PUT GBP/USD 1,21500 01.07.2022		OTC	GBP	3.750.000			% 0,367	16.005,09	0,06	
PUT GBP/USD 1,24000 01.07.2022		OTC	GBP	1.500.000			% 2,177	37.933,02	0,14	

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
PUT USD/CHF 0,96000 07.07.2022		OTC	USD	1.500.000			% 0,612	8.785,85	0,03
PUT USD/JPY 127,75000 01.07.2022		OTC	USD	1.500.000			% 0,000	0,00	0,00
PUT USD/JPY 125,50000 19.08.2022		OTC	USD	1.500.000			% 0,257	3.688,42	0,01
PUT USD/NOK 9,40000 08.07.2022		OTC	USD	1.500.000			% 0,009	122,17	0,00
PUT USD/SEK 9,55000 01.07.2022		OTC	USD	1.000.000			% 0,000	0,00	0,00
<b>Optionsrechte auf Devisen (Verkauf)</b>								<b>-109.156,19</b>	<b>-0,40</b>
CALL AUD/USD 0,74500 08.07.2022		OTC	AUD	-2.250.000			% 0,001	-8,03	0,00
CALL EUR/GBP 0,88200 08.07.2022		OTC	EUR	-2.250.000			% 0,018	-410,11	0,00
CALL EUR/USD 1,08250 08.07.2022		OTC	EUR	-1.500.000			% 0,003	-41,27	0,00
PUT GBP/CHF 1,14000 28.07.2022		OTC	GBP	-1.500.000			% 0,472	-8.217,75	-0,03
PUT GBP/CHF 1,18000 01.07.2022		OTC	GBP	-500.000			% 1,470	-8.537,21	-0,03
PUT GBP/CHF 1,20500 01.07.2022		OTC	GBP	-1.000.000			% 3,611	-41.953,02	-0,16
PUT GBP/JPY 156,50000 13.07.2022		OTC	GBP	-1.500.000			% 0,058	-1.003,31	0,00
PUT GBP/USD 1,20000 01.07.2022		OTC	GBP	-2.250.000			% 0,037	-975,70	0,00
PUT GBP/USD 1,24000 01.07.2022		OTC	GBP	-1.500.000			% 2,177	-37.933,02	-0,14
PUT GBP/USD 1,21500 01.07.2022		OTC	GBP	-2.250.000			% 0,367	-9.603,05	-0,04
PUT USD/CHF 0,93000 07.07.2022		OTC	USD	-2.250.000			% 0,021	-448,13	0,00
PUT USD/JPY 124,75000 01.07.2022		OTC	USD	-1.500.000			% 0,000	0,00	0,00
PUT USD/NOK 9,20000 08.07.2022		OTC	USD	-2.250.000			% 0,001	-25,59	0,00
PUT USD/SEK 9,25000 01.07.2022		OTC	USD	-1.500.000			% 0,000	0,00	0,00
<b>Summe Devisen-Derivate</b>								<b>EUR 73.948,80</b>	<b>0,28</b>
<b>Swaps</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Zinsswaps (Erhalten/Zahlen)</b>								<b>258.268,90</b>	<b>0,96</b>
IRS 2.115% USD / LIBUSD03 USD / CITIGMX_LDN 25.11.2026		OTC	USD	1.200.000				-46.808,39	-0,17
IRS EURIBORM03 EUR / 0.383% EUR / DGZ_FRA 30.01.2023		OTC	EUR	2.000.000				-5.280,64	-0,02
IRS EURIBORM06 EUR / 0.019% EUR / DGZ_FRA 21.10.2022		OTC	EUR	2.000.000				-3.766,84	-0,01
IRS EURIBORM06 EUR / 0.225% EUR / BNP_PAR 13.12.2053		OTC	EUR	500.000				203.219,49	0,75
IRS EURIBORM06 EUR / 0.29% EUR / DBK_FRA 21.07.2022		OTC	EUR	2.500.000				-13.840,30	-0,05
IRS EURIBORM06 EUR / 0.473% EUR / GOLDINT_LDN 15.02.2025		OTC	EUR	2.900.000				70.343,47	0,26
IRS LIBUSD03 USD / 2.39% USD / CITIGMX_LDN 25.11.2046		OTC	USD	500.000				54.402,11	0,20
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>								<b>32.354,54</b>	<b>0,12</b>
<b>Protection Buyer</b>								<b>32.354,54</b>	<b>0,12</b>
CDS CDX.EM. S29 V3 5Y / MERRILL_LDN 20.06.2023		OTC	USD	500.000				36.327,20	0,13
CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S30 V8 5Y / MERRILL_LDN 20.12.2023		OTC	EUR	500.000				-3.972,66	-0,01
<b>Summe Swaps</b>								<b>EUR 290.623,44</b>	<b>1,08</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		EUR		1.295.973,14			% 100,000	1.295.973,14	4,83
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		HUF		0,88			% 100,000	0,00	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		GBP		1.432,80			% 100,000	1.664,46	0,01
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		JPY		1,00			% 100,000	0,01	0,00
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		SGD		0,01			% 100,000	0,01	0,00
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		TRY		1,02			% 100,000	0,06	0,00
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		USD		40.677,42			% 100,000	38.949,99	0,14
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR 1.336.587,67</b>	<b>4,98</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 1.336.587,67</b>	<b>4,98</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche		EUR		151.580,52				151.580,52	0,56
Forderungen aus Derivategeschäften		EUR		28.176,62				28.176,62	0,10
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR		3.157,36				3.157,36	0,01
Forderungen aus Cash Collateral		EUR		10.000,00				10.000,00	0,04
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR 192.914,50</b>	<b>0,71</b>
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>									
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		CAD		-0,20			% 100,000	-0,15	0,00
<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>								<b>EUR -0,15</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR		-398.538,66				-398.538,66	-1,48
Verbindlichkeiten aus Derivategeschäften		EUR		-18.703,10				-18.703,10	-0,07
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR		-18.545,45				-18.545,45	-0,07
Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR		-260.000,00				-260.000,00	-0,97

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>						EUR	-695.787,21	-2,59
	<b>Fondsvermögen</b>						EUR	26.926.836,83	100,00
	<b>Umlaufende Anteile</b>						STK	545.181,000	
	<b>Anteilwert</b>						EUR	49,39	
<b>Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 286.581,10</b>									

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

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2022

Deutschland, Mark	(DEM)	1,95583	= 1 Euro (EUR)
Italien, Lira	(ITL)	1.936,27000	= 1 Euro (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,86082	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,35375	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,99767	= 1 Euro (EUR)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	17,43240	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,66335	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	24,73700	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	394,75000	= 1 Euro (EUR)
Rumänien, Leu	(RON)	4,94450	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,04435	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,34831	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,45265	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	142,23000	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,51784	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,67810	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

### 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>EUR</b>				
XS2410368042	0,7500 % A.P.Moeller-Maersk A/S MTN 21/31	EUR	0	100.000
XS2388941077	0,3750 % Acciona Energia Fin. Fil. SA MTN 21/27	EUR	0	200.000
FR0014004AE8	3,0000 % Air France-KLM S.A. Obl. 21/24	EUR	0	100.000
XS2341269970	1,1250 % Aker BP ASA MTN 21/29	EUR	0	100.000
XS2393701284	0,4000 % American Tower Corp. Notes 21/27	EUR	0	100.000
FR0014008FH1	0,8750 % Arval Service Lease S.A. MTN 22/25	EUR	100.000	100.000
FR0014006G24	1,0000 % Atos SE Obl. 21/29	EUR	0	200.000
XS2434701616	1,6250 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN 22/28	EUR	100.000	100.000
XS1664644983	2,2500 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 17/30	EUR	0	100.000
XS2432565005	1,0000 % Balder Finland Oyj MTN 22/27	EUR	125.000	125.000
XS2404651163	1,0000 % Banco Santander S.A. Non-Preferred MTN 21/31	EUR	0	200.000
XS2491542374	3,1250 % BASF SE MTN 22/28	EUR	100.000	100.000
DE000A14J611	2,3750 % Bayer AG FLR Sub. Anl. 15/75	EUR	0	100.000
XS2002496409	3,1250 % BayWa AG Notes 19/24	EUR	0	200.000
XS2383811424	1,7500 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 21/28	EUR	0	100.000
BE6331190973	1,2500 % Belfius Bank S.A. FLR MTN 21/34	EUR	0	100.000
FR0014006KD4	1,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 21/31	EUR	0	100.000
XS2391790610	3,7500 % British American Tobacco PLC FLR Notes 21/Und.	EUR	0	100.000
DE0001030559	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 14/30	EUR	0	150.000
XS2401565630	0,8500 % C.C.Raiff. dell'Alto Adige SpA Preferred MTN 21/26	EUR	0	125.000
PTCCCAOM0000	2,5000 % Caixa Central de Créd.Agr.M FLR Notes 21/26	EUR	0	200.000
XS2346973741	1,5000 % CIMIC Finance Ltd. MTN 21/29	EUR	0	100.000
XS2393323667	1,1250 % Computershare US Inc. MTN 21/31	EUR	0	125.000
ES0000106601	2,5000 % Comun. Autónoma del País Vasco Obligaciones 18/38	EUR	0	150.000
ES0000106734	1,8750 % Comun. Autónoma del País Vasco Obligaciones 22/33	EUR	150.000	150.000
ES0000093452	0,7140 % Comunidad Autónoma de Canarias Obl. 21/31	EUR	0	100.000
IT0005481046	0,3750 % Credit Agricole Italia S.p.A. MT Mtg.Cov.Bds 22/32	EUR	200.000	200.000
XS2381671671	0,2500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 21/28	EUR	0	175.000
XS1772374770	1,6250 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 18/33	EUR	0	120.000
DE000DL19WN3	4,0000 % Deutsche Bank AG Sub. FLR MTN 22/32	EUR	100.000	100.000

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
DE000A3MQXZ2	1,5000 % Deutsche Boerse AG Anl. 22/32	EUR	100.000	100.000
XS0553728709	4,5000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 10/30	EUR	0	130.000
DE000DFKORN3	0,4000 % DZ BANK AG Dt.Zen-Gen. MTN IHS Ausg.1650 21/28	EUR	0	200.000
XS2463518998	1,6250 % E.ON SE MTN 22/31	EUR	100.000	100.000
FR0014006UO0	1,0000 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 21/33	EUR	0	100.000
XS2475919663	2,5000 % Electrolux, AB MTN 22/30	EUR	100.000	100.000
FR0011022474	5,9500 % Engie S.A. MTN 11/11	EUR	0	100.000
XS2062490649	2,0450 % EP Infrastructure a.s. Notes 19/28	EUR	0	200.000
AT0000A2YA29	4,0000 % Erste Group Bank AG FLR MTN 22/33	EUR	100.000	100.000
BE6328904428	1,3750 % Euroclear Investments S.A. FLR Notes 21/51	EUR	0	100.000
EU000A3KTGW6	0,7000 % Europaeische Union MTN 21/51	EUR	100.000	100.000
GR0118020685	2,0000 % Griechenland Notes 20/27	EUR	100.000	100.000
GR0114032577	0,0000 % Griechenland Notes 21/26	EUR	150.000	150.000
GR0124038721	1,7500 % Griechenland Notes 22/32	EUR	300.000	300.000
XS2397252102	1,0000 % Heimstaden Bostad Treasury B.V MTN 21/28	EUR	0	200.000
XS2342058117	0,6250 % Holding d'Infrastr. de Transp. MTN 21/28	EUR	0	100.000
XS2433135543	1,4750 % Holding d'Infrastr. de Transp. MTN 22/31	EUR	100.000	100.000
FR0014001YB0	1,8750 % Iliad S.A. Obl. 21/28	EUR	0	100.000
XS2433136194	0,6250 % Israel MTN 22/32	EUR	250.000	250.000
ES0000012K20	0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32	EUR	250.000	250.000
ES0000012K46	1,9000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/52	EUR	125.000	125.000
XS2406890066	0,8750 % Kon. KPN N.V. MTN 21/33	EUR	0	200.000
ES00000127C8	1,0000 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 14/30	EUR	0	200.000
ES0000012852	0,6500 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 17/27	EUR	200.000	200.000
FR0014005O90	3,0000 % La Banque Postale FLR Notes 21/Und.	EUR	0	200.000
XS2448014808	1,0000 % Mastercard Inc. Notes 22/29	EUR	100.000	100.000
XS2348280707	0,3750 % MFB Magyar Fejlesztési Bk Zrt. Notes 21/26	EUR	0	150.000
XS2393539593	0,7500 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 21/36	EUR	0	125.000
FI4000496286	0,7500 % Neste Oyj Notes 21/28	EUR	0	100.000
XS2441247041	1,3750 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. MTN 22/30	EUR	100.000	100.000
FR0014006ZC4	0,6250 % Orange S.A. MTN 21/33	EUR	0	100.000
FR0014005SC1	0,1250 % Pernod-Ricard S.A. MTN 21/29	EUR	0	200.000
FR0014009L57	1,3750 % Pernod-Ricard S.A. Notes 22/29	EUR	100.000	100.000
BE0002830116	0,7500 % Proximus S.A. MTN 21/36	EUR	0	100.000
FR0013519253	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 20/26	EUR	0	200.000
FR0014008181	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 22/53	EUR	125.000	125.000
FR0014002JM6	0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/44	EUR	0	125.000
IT0005436693	0,6000 % Republik Italien B.T.P. 21/31	EUR	120.000	120.000
IT0005495731	2,8000 % Republik Italien B.T.P. 22/29	EUR	150.000	150.000
IT0005496770	3,2500 % Republik Italien B.T.P. 22/38	EUR	150.000	150.000
IT0005480980	2,1500 % Republik Italien B.T.P. 22/52	EUR	250.000	250.000
IT0005387052	0,4000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 19/30	EUR	0	100.000
IT0005482994	0,1000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 21/33	EUR	240.000	240.000
XS2471549654	2,8750 % Republik Kroatien Notes 22/32	EUR	200.000	200.000
XS2420426038	0,2500 % Republik Lettland MTN 21/30	EUR	0	100.000
XS2447602793	2,7500 % Republik Polen MTN 22/32	EUR	225.000	225.000
PTOTE00E0033	0,3000 % Republik Portugal Obr. 21/31	EUR	150.000	150.000
PTOTE00E0032	1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42	EUR	300.000	300.000
XS2434895558	2,1250 % Republik Rumänien MTN 22/28 Reg.S	EUR	150.000	150.000
XS1892141620	2,8750 % Republik Rumänien MTN 18/29 Reg.S	EUR	0	100.000
SI0002104048	0,4875 % Republik Slowenien Bonds 20/50	EUR	200.000	200.000
SI0002104253	1,1750 % Republik Slowenien Notes 22/62	EUR	150.000	150.000
XS2105095777	0,6250 % Republik Zypern MTN 20/30	EUR	0	200.000
XS2434393968	0,9500 % Republik Zypern MTN 22/32	EUR	150.000	150.000
XS2411720233	0,3750 % Sandvik AB MTN 21/28	EUR	0	100.000
XS2332234413	0,1250 % SGS Nederland Holding B.V. MTN 21/27	EUR	0	200.000
XS2348408514	1,0000 % SPP-Distribucija, A.S. Notes 21/31	EUR	150.000	150.000
XS2314267449	0,7500 % Tele2 AB MTN 21/31	EUR	0	100.000
XS2406569579	0,8750 % TenneT Holding B.V. MTN 21/35	EUR	0	150.000
XS2438026440	0,8750 % Thames Water Utilities Fin.PLC MTN 22/28	EUR	125.000	125.000
FR0014000O87	0,8780 % Ubisoft Entertainment S.A. Bonds 20/27	EUR	0	200.000
FR0014003MJ4	0,7500 % Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 21/28	EUR	0	200.000
XS2418392143	2,3750 % UNIQA Insurance Group AG FLR Bonds 21/41	EUR	0	100.000
FR0014006IX6	2,0000 % Veolia Environnement S.A. FLR Notes 21/Und.	EUR	0	100.000
XS1806457211	0,8750 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 18/23	EUR	0	100.000
XS2282095970	0,5000 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 21/29	EUR	0	100.000
DE000A3E5MH6	0,6250 % Vonovia SE MTN 21/29	EUR	0	100.000
FR0014006VH2	1,3750 % Wendel SE Obl. 22/34	EUR	100.000	100.000
<b>GBP</b>				
XS2403381069	1,8750 % Tesco Corp. Treas. Serv. PLC MTN 21/28	GBP	0	175.000
<b>USD</b>				
GB0005902332	3,1166 % HSBC Bank PLC FLR Notes 85/Und.	USD	0	100.000

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
FR0014009N55	1,3750 % Action Logement Services SAS MTN 22/32	EUR	200.000	200.000
XS2407019871	0,8750 % AXA Logistics Euro. Master SCA Notes 21/29 Reg.S	EUR	0	125.000
XS2356316872	1,7500 % CECONOMY AG Anl. 21/26	EUR	0	200.000
FR0014006IG1	1,0810 % Crédit Logement FLR Notes 21/34	EUR	0	200.000

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2388910270	2,2500 % DIC Asset AG Anl. 21/26	EUR	0	200.000
XS2385121582	0,7730 % East Japan Railway Co. MTN 21/34	EUR	0	150.000
XS2239813301	3,6250 % El Corte Inglés S.A. Notes 20/24 Reg.S	EUR	0	125.000
DE000A3KPTG6	1,0000 % JAB Holdings B.V. Notes 21/31	EUR	0	100.000
XS2384723263	0,2500 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV Notes 20/29 Reg.S	EUR	0	200.000
XS2239061927	3,2500 % Republik San Marino Obbl. 21/24	EUR	0	175.000
BE6332786449	1,6250 % VGP N.V. Notes 22/27	EUR	100.000	100.000
<b>USD</b>				
US9128286N55	0,5000 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 19/24	USD	0	300.000
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
DE000BAY01V7	2,3750 % Bayer AG z.Verk. FLR Sub. Anl. 15/75	EUR	100.000	100.000
XS2421072419	1,3750 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. MTN Tr.2 21/36	EUR	0	100.000

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>869</b>
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY))		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>50.458</b>
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), SHORT EURO-BTP Future (FBTS), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY), US Treasury Long Bond Future (US))		
<b>Währungsderivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen</b>		
<b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
AUD/USD	EUR	708
EUR/CZK	EUR	37.125
EUR/GBP	EUR	6.353
EUR/HUF	EUR	2.202.000
EUR/NOK	EUR	15.300
EUR/USD	EUR	9.334
NZD/USD	EUR	1.596
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
AUD/JPY	EUR	423.012
AUD/USD	EUR	6.014
EUR/CHF	EUR	3.090
EUR/CZK	EUR	150.750
EUR/NOK	EUR	344.750
EUR/PLN	EUR	6.900
EUR/SEK	EUR	75.600
EUR/USD	EUR	12.125
GBP/JPY	EUR	192.049
GBP/USD	EUR	8.555
NOK/SEK	EUR	4.359
NZD/USD	EUR	1.588
USD/CAD	EUR	10.284
USD/CHF	EUR	2.047
USD/JPY	EUR	152.040
USD/MXN	EUR	157.831
USD/NOK	EUR	10.754
USD/SEK	EUR	21.585
<b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
AUD/USD	EUR	1.093
EUR/HUF	EUR	2.202.000
EUR/NOK	EUR	23.625
EUR/USD	EUR	4.140
NZD/USD	EUR	2.438
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
AUD/JPY	EUR	89.355
AUD/USD	EUR	6.390
EUR/CHF	EUR	1.236
EUR/CZK	EUR	186.750
EUR/NOK	EUR	20.200
EUR/PLN	EUR	10.193
EUR/SEK	EUR	46.350
EUR/USD	EUR	11.935
GBP/CHF	EUR	4.096
GBP/JPY	EUR	281.047
GBP/USD	EUR	2.160
NOK/SEK	EUR	5.387
NZD/USD	EUR	1.598

# Frankfurter-Sparinrent Deko

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
USD/CAD	EUR	3.501
USD/JPY	EUR	346.505
USD/MXN	EUR	189.232
USD/NOK	EUR	15.705
USD/SEK	EUR	31.477
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/CAD	EUR	314
AUD/EUR	EUR	1.087
AUD/JPY	EUR	436
AUD/USD	EUR	5.232
CAD/AUD	EUR	313
CAD/EUR	EUR	20
CAD/USD	EUR	4.889
CHF/EUR	EUR	6.529
CZK/EUR	EUR	6.938
DKK/EUR	EUR	7
GBP/EUR	EUR	8.854
GBP/USD	EUR	5.628
JPY/AUD	EUR	893
JPY/EUR	EUR	18
JPY/USD	EUR	911
MXN/EUR	EUR	1
MXN/USD	EUR	3.458
NOK/EUR	EUR	5.403
NOK/SEK	EUR	1.020
NOK/USD	EUR	4.421
NZD/EUR	EUR	1.655
NZD/USD	EUR	4.823
PLN/EUR	EUR	513
RON/EUR	EUR	1.109
SEK/EUR	EUR	1.808
SEK/USD	EUR	1.344
USD/EUR	EUR	13.159
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/CAD	EUR	320
AUD/EUR	EUR	1.032
AUD/JPY	EUR	435
AUD/USD	EUR	5.089
CAD/AUD	EUR	313
CAD/EUR	EUR	0
CAD/USD	EUR	4.919
CHF/EUR	EUR	6.474
CZK/EUR	EUR	7.624
DKK/EUR	EUR	339
GBP/EUR	EUR	9.898
GBP/USD	EUR	5.763
JPY/AUD	EUR	724
JPY/USD	EUR	1.082
MXN/USD	EUR	3.459
NOK/EUR	EUR	4.538
NOK/SEK	EUR	1.013
NOK/USD	EUR	5.218
NZD/EUR	EUR	1.349
NZD/USD	EUR	5.404
PLN/EUR	EUR	10
RON/EUR	EUR	1.331
SEK/EUR	EUR	1.801
SEK/USD	EUR	1.348
USD/EUR	EUR	13.435
<b>Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)</b>		
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>		
<b>Protection Buyer:</b>	EUR	400
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S36 V1 5Y)		

# Frankfurter-Sparinrent Deka Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	545,181
Anteilwert	EUR	49,39

## 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)

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

---

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2022  
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.

### 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 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;  
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale  
Main Tower  
Neue Mainzer Straße 52 - 58  
60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

rechtsfähige Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Erfurt

**Haupttätigkeit**

Geschäftsbank, Retailbank, Verbundbank und öffentliche Förderbank

Stand: 30. Juni 2022

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)

