

# Halbjahresbericht zum 30. Juni 2018 Frankfurter-Sparrent Deka

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

# Bericht der Geschäftsführung.

Juli 2018

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Frankfurter-Sparinrent Deka für den Zeitraum vom 1. Januar 2018 bis zum 30. Juni 2018.

Zu Beginn des Jahres markierten einige wichtige Aktienmärkte neue historische Höchststände, ehe es im Februar 2018 zu einer ausgeprägten Korrekturbewegung kam, die insbesondere in Europa die vorangegangenen Kurssteigerungen aufzehrte. Trotz des Rücksetzers bestimmte der synchron verlaufende Aufschwung in den meisten Volkswirtschaften das Bild. Investoren richteten angesichts zufriedensstellender Konjunkturdaten ihre Aufmerksamkeit verstärkt auf die Signale der großen Notenbanken zur Normalisierung der Geldpolitik. Aufflammende Zinsängste wie auch die sich verschärfende Tonlage im US-Handelsstreit hinterließen deutliche Spuren an den Kapitalmärkten.

Die Qualität deutscher Staatsanleihen war nach einem Renditeanstieg im Januar wieder gefragt. Die Rendite 10-jähriger Bundesanleihen sank von knapp 0,8 Prozent Anfang Februar auf zuletzt 0,3 Prozent. Vor dem Hintergrund der protektionistischen Stimmungslage in den USA und der Irritationen rund um die Regierungsbildung in Italien suchten Anleger vergleichsweise sichere Anlagen. Laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten in einem Umfeld guter Wirtschaftsdaten und moderater Zinserhöhungsschritte der US-Notenbank zuletzt bei knapp 2,9 Prozent.

An den Aktienmärkten setzte sich nach dem Jahreswechsel die kräftige Aufwärtsbewegung des Vorjahres zunächst fort. Befürchtungen vor einer frühzeitigen Straffung der Geldpolitik durch die großen Notenbanken ließen die Börsen jedoch bis Ende März in eine Korrekturphase abtauchen, von der sich die großen Indizes nicht mehr vollständig erholen konnten. Folglich verbuchten im Berichtszeitraum sowohl der Dow Jones Industrial in den USA als auch der Nikkei 225 in Japan sowie der DAX Verluste im einstelligen Prozentbereich.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Frankfurter-Sparinrent Deka im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von minus 0,6 Prozent.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige 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



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik. Frankfurter-Sparinrent Deka	4
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2018. Frankfurter-Sparinrent Deka	5
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2018. Frankfurter-Sparinrent Deka	6
Anhang. Frankfurter-Sparinrent Deka	16
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.**

# Frankfurter-Sparinrent Deka Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Frankfurter-Sparinrent Deka 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. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden. Dieser Fonds darf mehr als 35 Prozent des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland sowie des Landes Hessen investieren.

Das Fondsmanagement hat in der Berichtsperiode die Rentenanlagen etwas erhöht. Das auf verzinsliche Wertpapiere ausgerichtete Sondervermögen war zum Stichtag mit 96,3 Prozent des Fondsvermögens in Wertpapieren investiert. Ein Schwerpunkt lag dabei weiterhin auf Unternehmensanleihen, die teilweise über besondere Ausstattungsmerkmale verfügten (Bonitätsanleihen). Das Engagement in Corporate Bonds wurde im Laufe der Berichtsperiode allerdings etwas zurückgenommen, da sich die Risikoprämien (Spreads) angesichts eines schwächeren Marktumfelds etwas ausgeweitet hatten.

Der Bestand in Staatsanleihen erfuhr hingegen eine Aufstockung auf zuletzt 32,9 Prozent des Fondsvolumens. Daneben befanden sich weiterhin Pfandbriefe und Anleihen halbstaatlicher Emittenten im Bestand. Zur Steuerung des Portfolios kamen zudem Renten- und Zins-Derivate (z.B. Optionen, Zinsterminkontrakte) zum Einsatz.

Über den Einsatz von Devisentermingeschäften wurden Währungskursrisiken partiell abgesichert oder aktive Positionierungen in Fremdwährungen vorgenommen.

Frankfurter-Sparinrent Deka verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von minus 0,6 Prozent. Der Anteilpreis lag zuletzt bei 51,71 Euro.

## Wichtige Kennzahlen

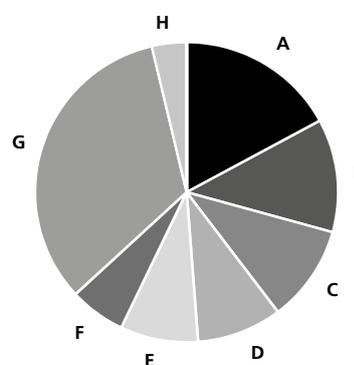
### Frankfurter-Sparinrent Deka

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Performance*	-0,6%	0,4%	1,2%
ISIN	DE0008479981		

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

## Fondsstruktur

### Frankfurter-Sparinrent Deka



A Spanien	17,1%
B Deutschland	12,2%
C Portugal	10,4%
D Frankreich	9,1%
E Niederlande	8,3%
F Italien	6,0%
G Sonstige Länder	33,2%
H Barreserve, Sonstiges	3,7%

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

# Frankfurter-Sparinrent Deka

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2018.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>38.605.579,87</b>	<b>95,57</b>
Belgien	603.401,00	1,50
Bulgarien	200.375,00	0,50
China	249.448,75	0,62
Dänemark	153.154,50	0,38
Deutschland	4.880.828,01	12,07
Estland	213.568,00	0,53
Finnland	210.998,00	0,52
Frankreich	3.660.126,70	9,07
Großbritannien	1.128.334,25	2,80
Indonesien	208.250,00	0,52
Irland	1.293.957,73	3,20
Israel	445.400,00	1,10
Italien	2.395.808,18	5,94
Lettland	1.043.127,50	2,58
Litauen	102.152,00	0,25
Luxemburg	713.266,12	1,76
Niederlande	3.336.823,38	8,27
Norwegen	1.295.159,55	3,21
Polen	284.657,25	0,71
Portugal	4.155.197,25	10,27
Rumänien	1.081.190,45	2,66
Schweiz	550.561,00	1,36
Singapur	126.063,75	0,31
Slowakei	102.317,00	0,25
Spanien	6.874.951,13	17,03
Tschechische Republik	2.155.937,87	5,33
USA	200.468,00	0,50
Zypern	940.057,50	2,33
<b>2. Derivate</b>	<b>-434.698,53</b>	<b>-1,05</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds</b>	<b>2.917.241,83</b>	<b>7,22</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>429.543,81</b>	<b>1,06</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-1.130.539,41</b>	<b>-2,80</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>40.387.127,57</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>38.605.579,87</b>	<b>95,57</b>
CHF	498.556,77	1,23
CZK	1.095.968,62	2,72
EUR	35.468.261,88	87,81
GBP	112.570,10	0,28
NOK	319.252,30	0,79
PLN	183.918,25	0,46
RON	927.051,95	2,28
<b>2. Derivate</b>	<b>-434.698,53</b>	<b>-1,05</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds</b>	<b>2.917.241,83</b>	<b>7,22</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>429.543,81</b>	<b>1,06</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-1.130.539,41</b>	<b>-2,80</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>40.387.127,57</b>	<b>100,00</b>

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

# Frankfurter-Sparrent Deka

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2018.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>27.178.790,11</b>	<b>67,29</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>27.178.790,11</b>	<b>67,29</b>
<b>EUR</b>								<b>24.225.390,37</b>	<b>59,99</b>
XS1757377400	1,6250 % Alliander N.V. FLR Securit. 18/Und.		EUR	100.000	100.000	0	% 98,000	98.000,00	0,24
DE000A180B72	0,0000 % Allianz Finance II B.V. MTN 16/20		EUR	200.000	0	0	% 100,286	200.571,00	0,50
XS1062900912	4,1250 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 14/26		EUR	100.000	100.000	0	% 104,375	104.375,00	0,26
XS1678372472	0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 17/22		EUR	200.000	0	0	% 98,492	196.984,00	0,49
XS1811053641	1,7500 % Banco BPM S.p.A. MTN 18/23		EUR	200.000	700.000	500.000	% 93,678	187.355,00	0,46
XS1829259008	1,3750 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 18/25		EUR	100.000	400.000	300.000	% 100,739	100.739,00	0,25
XS1823502650	0,8750 % BASF SE MTN 18/25		EUR	100.000	300.000	200.000	% 100,330	100.329,50	0,25
XS1840618059	1,5000 % Bayer Capital Corp. B.V. Notes 18/26		EUR	300.000	300.000	0	% 100,307	300.919,50	0,75
XS1823246803	1,1250 % BMW Finance N.V. MTN 18/26		EUR	425.000	425.000	0	% 99,371	422.324,63	1,05
DE0001135176	5,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 00/31		EUR	250.000	250.000	0	% 161,183	402.957,50	1,00
DE0001135226	4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 03/34		EUR	500.000	200.000	0	% 162,267	811.335,00	2,00
DE0001102374	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25		EUR	250.000	0	0	% 103,614	259.035,00	0,64
DE0001102440	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 18/28		EUR	500.000	500.000	0	% 101,668	508.340,00	1,26
DE0001030542	0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 12/23		EUR	500.000	500.000	0	% 115,345	576.724,91	1,43
PTCGH10E0014	1,0000 % Caixa Geral de Depósitos S.A. MT Obr. Hipot. 15/22		EUR	200.000	0	0	% 102,497	204.994,00	0,51
FR0013155868	0,3520 % Carrefour Banque FLR MTN 16/21		EUR	300.000	0	0	% 100,610	301.828,50	0,75
FR0013342128	0,8750 % Carrefour S.A. MTN 18/23		EUR	100.000	100.000	0	% 100,279	100.279,00	0,25
FR0013260379	1,8650 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 17/22		EUR	100.000	300.000	200.000	% 94,004	94.004,00	0,23
XS1415366720	1,8750 % Ceske Drahy AS Notes 16/23		EUR	300.000	0	0	% 103,771	311.311,50	0,77
XS1711173218	0,3750 % China Development Bank MTN 17/21		EUR	250.000	0	0	% 99,780	249.448,75	0,62
DE000CB83CF0	7,7500 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN S.774 11/21		EUR	200.000	100.000	0	% 117,157	234.313,00	0,58
DE000CZ40KGO	0,2500 % Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P6 15/22		EUR	300.000	0	0	% 101,211	303.633,00	0,75
XS1793349926	1,1250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 18/26		EUR	300.000	300.000	0	% 97,789	293.365,50	0,73
ES0000106619	1,4500 % Comun. Autónoma del País Vasco Obl. 18/28		EUR	275.000	275.000	0	% 99,769	274.364,75	0,68
XS0429484891	5,8750 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 09/19		EUR	100.000	0	0	% 105,135	105.135,00	0,26
XS0478074924	4,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 10/20		EUR	250.000	0	0	% 106,459	266.146,25	0,66
FR0011318120	3,5000 % Crédit Agricole S.A. Obligations 12/22		EUR	300.000	300.000	0	% 113,249	339.745,50	0,84
XS1844079738	0,7500 % De Volksbank N.V. MTN 18/23		EUR	300.000	300.000	0	% 100,135	300.403,50	0,74
XS1828032513	0,6250 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 18/22		EUR	300.000	300.000	0	% 100,576	301.726,50	0,75
XS1292352843	2,3840 % Eesti Energia AS Notes 15/23		EUR	200.000	200.000	0	% 106,784	213.568,00	0,53
FR0013344686	1,3750 % Engie S.A. MTN 18/28		EUR	100.000	300.000	200.000	% 100,284	100.283,50	0,25
PTGALLOM0004	1,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 17/23		EUR	500.000	100.000	0	% 98,051	490.255,00	1,21
XS0449850980	4,9000 % Generalitat de Catalunya MTN 09/21		EUR	250.000	0	0	% 109,309	273.272,50	0,68
XS1044496203	2,2500 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 14/19		EUR	200.000	0	0	% 101,589	203.177,00	0,50
XS1488418960	0,0000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 16/21		EUR	150.000	0	0	% 100,080	150.120,00	0,37
FR0013331188	0,6250 % Iliad S.A. Obl. 18/21		EUR	200.000	200.000	0	% 99,148	198.296,00	0,49
FR0013330099	1,6250 % Infra Park S.A.S. Bonds 18/28		EUR	200.000	200.000	0	% 98,627	197.254,00	0,49
PTCPEDOM0000	4,2500 % Infraestruturas de Portugal SA Bonds 06/21		EUR	300.000	300.000	0	% 111,623	334.867,50	0,83
XS1576220484	0,7500 % ING Groep N.V. MTN 17/22		EUR	200.000	0	0	% 100,599	201.197,00	0,50
XS1168003900	1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 15/20		EUR	300.000	0	0	% 100,576	301.726,50	0,75
XS1636000561	0,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 17/22		EUR	100.000	0	0	% 98,015	98.015,00	0,24
XS1649668792	1,3750 % Invitalia S.P.A. Notes 17/22 Reg.S		EUR	200.000	0	0	% 96,571	193.142,00	0,48
XS1023541847	2,8750 % Israel MTN 14/24		EUR	400.000	400.000	0	% 111,350	445.400,00	1,10
XS1330300341	1,1250 % ISS Global A/S MTN 15/21		EUR	150.000	0	0	% 102,103	153.154,50	0,38
BE0002272418	0,7500 % KBC Groep N.V. MTN 17/22		EUR	200.000	0	200.000	% 100,031	200.061,00	0,50
BE0000345547	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.85 18/28		EUR	400.000	540.000	140.000	% 100,835	403.340,00	1,00
ES00000120N0	4,9000 % Königreich Spanien Bonos 07/40		EUR	180.000	180.000	0	% 147,321	265.177,80	0,66
ES0000012B39	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 18/28		EUR	100.000	600.000	500.000	% 100,694	100.694,00	0,25
ES00000127G9	2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25		EUR	100.000	0	200.000	% 108,787	108.786,50	0,27
ES00000128C6	2,9000 % Königreich Spanien Obligaciones 16/46		EUR	140.000	140.000	0	% 109,251	152.950,70	0,38
ES0000012A89	1,4500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/27		EUR	100.000	0	250.000	% 101,738	101.738,00	0,25
ES00000128Q6	2,3500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/33		EUR	200.000	800.000	600.000	% 106,099	212.198,00	0,53
FR0013286838	1,0000 % La Banque Postale Non-Pref. MTN 17/24		EUR	200.000	0	0	% 97,617	195.234,00	0,48
XS0468940068	5,8750 % Landesbank Berlin AG Nachr. MTN IHS 09/19		EUR	400.000	0	0	% 107,519	430.074,00	1,06
XS1820748538	1,1250 % LANXESS AG MTN 18/25		EUR	250.000	500.000	250.000	% 98,161	245.401,25	0,61
XS1646530565	2,0000 % Lietuvos energija UAB MTN 17/27		EUR	100.000	0	0	% 102,152	102.152,00	0,25
XS1749378342	0,6250 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 18/24		EUR	150.000	350.000	200.000	% 97,480	146.219,25	0,36
XS1837997979	1,1250 % NatWest Markets PLC MT Resolut. Nts 18/23		EUR	400.000	400.000	0	% 99,648	398.590,00	0,99
XS1769041192	1,3750 % Novartis Finance S.A. Notes 18/30		EUR	225.000	225.000	0	% 100,388	225.873,00	0,56

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
FR0011427848	0,2500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 13/24		EUR	400.000	650.000	250.000	% 115,305	461.220,05	1,14
XS1432493879	2,6250 % Republik Indonesien MTN 16/23 Reg.S		EUR	200.000	0	100.000	% 104,125	208.250,00	0,52
IE00BFZRP202	1,3000 % Republik Irland Treasury Bonds 18/33		EUR	420.000	420.000	0	% 99,918	419.655,60	1,04
IT0005104473	0,2820 % Republik Italien FLR C.C.T.eu 15/22		EUR	300.000	300.000	0	% 96,280	288.838,50	0,72
IT0004604671	2,1000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 10/21		EUR	300.000	300.000	0	% 118,431	355.293,12	0,88
IT0005246134	1,3000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 16/28		EUR	200.000	400.000	200.000	% 100,441	200.881,81	0,50
IT0003621460	5,1250 % Republik Italien MTN 04/24		EUR	200.000	200.000	0	% 116,015	232.030,00	0,57
XS1566190945	2,2500 % Republik Lettland MTN 17/47		EUR	500.000	500.000	0	% 108,375	541.875,00	1,34
XS1829276275	1,1250 % Republik Lettland MTN 18/28		EUR	500.000	500.000	0	% 100,251	501.252,50	1,24
PTOTEQOE0015	5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24		EUR	500.000	800.000	300.000	% 126,689	633.445,00	1,56
PTOTEROE0014	3,8750 % Republik Portugal Obr. 14/30		EUR	150.000	400.000	450.000	% 119,001	178.500,75	0,44
PTOTEKOE0011	2,8750 % Republik Portugal Obr. 15/25		EUR	200.000	550.000	500.000	% 111,260	222.520,00	0,55
PTOTEBOE0020	4,1000 % Republik Portugal Obr. 15/45		EUR	150.000	1.050.000	1.050.000	% 123,400	185.100,00	0,46
PTOTEUOE0019	4,1250 % Republik Portugal Obr. 17/27		EUR	400.000	500.000	200.000	% 120,510	482.040,00	1,19
PTOTEVOE0018	2,1250 % Republik Portugal Obr. 18/28		EUR	300.000	1.150.000	850.000	% 103,346	310.038,00	0,77
PTOTEWOE0017	2,2500 % Republik Portugal Obr. 18/34		EUR	200.000	430.000	230.000	% 99,224	198.448,00	0,49
XS1313004928	3,8750 % Republik Rumänien MTN 15/35 Reg.S		EUR	150.000	150.000	0	% 102,759	154.138,50	0,38
XS1227247191	3,8750 % Republik Zypern MTN 15/22		EUR	200.000	200.000	200.000	% 109,625	219.250,00	0,54
XS1314321941	4,2500 % Republik Zypern MTN 15/25		EUR	300.000	300.000	0	% 114,250	342.750,00	0,85
XS1457553367	3,7500 % Republik Zypern MTN 16/23		EUR	200.000	200.000	0	% 110,125	220.250,00	0,55
XS1637276848	2,7500 % Republik Zypern MTN 17/24		EUR	150.000	150.000	0	% 105,205	157.807,50	0,39
SK4120014184	2,2500 % Slowakei Anl. 18/68		EUR	100.000	225.000	125.000	% 102,317	102.317,00	0,25
XS1039826422	2,6250 % SNCF Réseau MTN 14/25		EUR	400.000	400.000	0	% 115,667	462.668,00	1,15
XS1516271290	0,3750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA MTN 16/22		EUR	300.000	0	0	% 99,958	299.874,00	0,74
XS1382368113	2,5000 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC MTN 16/23		EUR	250.000	250.000	0	% 105,198	262.993,75	0,65
FR0013332988	1,1250 % Unibail-Rodamco SE MTN 18/25		EUR	400.000	400.000	0	% 100,717	402.866,00	1,00
FR0013332996	1,8750 % Unibail-Rodamco SE MTN 18/31		EUR	100.000	100.000	0	% 100,667	100.667,00	0,25
IT0005212987	0,3750 % UniCredit S.p.A. Mortg.Cov. MTN 16/26		EUR	200.000	200.000	0	% 92,741	185.482,00	0,46
XS1508450688	2,1250 % UniCredit S.p.A. MTN 16/26		EUR	150.000	150.000	0	% 98,993	148.488,75	0,37
XS1806457211	0,8750 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 18/23		EUR	250.000	250.000	0	% 99,039	247.596,25	0,61
XS1830992563	0,3790 % Volkswagen Bank GmbH FLR MTN 18/21		EUR	300.000	300.000	0	% 100,176	300.526,50	0,74
XS1830986326	1,2500 % Volkswagen Bank GmbH MTN 18/24		EUR	200.000	200.000	0	% 98,936	197.872,00	0,49
DE000A18V138	1,6250 % Vonovia Finance B.V. MTN 15/20		EUR	200.000	0	0	% 103,774	207.548,00	0,51
<b>CHF</b>								<b>498.556,77</b>	<b>1,23</b>
CH0028622600	2,7500 % Commerzbank Finance&Covered Bd MT Let.d.G.P. 07/22		CHF	300.000	0	0	% 109,625	284.216,12	0,70
CH0124855328	2,6250 % SNCF Réseau MTN 11/31		CHF	200.000	200.000	0	% 124,010	214.340,65	0,53
<b>CZK</b>								<b>1.095.968,62</b>	<b>2,72</b>
CZ0001001796	4,2000 % Tschechien Anl. S.49 03/36		CZK	6.000.000	6.000.000	0	% 121,800	282.331,12	0,70
CZ0001001945	4,7000 % Tschechien Anl. S.55 07/22		CZK	9.000.000	9.000.000	0	% 113,290	393.907,55	0,98
CZ0001002851	3,8500 % Tschechien Anl. S.61 10/21		CZK	10.000.000	0	0	% 108,645	419.729,95	1,04
<b>GBP</b>								<b>112.570,10</b>	<b>0,28</b>
XS1841745612	1,3750 % BASF SE MTN 18/22		GBP	100.000	100.000	0	% 99,768	112.570,10	0,28
<b>NOK</b>								<b>319.252,30</b>	<b>0,79</b>
NO0010752702	2,3500 % Stadt Oslo Anl. 15/24		NOK	3.000.000	0	0	% 100,838	319.252,30	0,79
<b>RON</b>								<b>927.051,95</b>	<b>2,28</b>
RO1722DBN045	3,4000 % Republik Rumänien Bonds 17/22		RON	3.000.000	3.000.000	0	% 95,586	615.334,11	1,51
RO1823DBN025	4,2500 % Republik Rumänien Bonds 17/23		RON	1.500.000	1.500.000	0	% 96,844	311.717,84	0,77
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>11.426.789,76</b>	<b>28,28</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>11.426.789,76</b>	<b>28,28</b>
<b>EUR</b>								<b>11.242.871,51</b>	<b>27,82</b>
XS1799545329	1,8750 % ACS Servicios Comun.y Ener.SL MTN 18/26		EUR	400.000	400.000	0	% 97,790	391.158,00	0,97
ES0200002006	1,8750 % Adif - Alta Velocidad MTN 15/25		EUR	200.000	0	200.000	% 105,571	211.142,00	0,52
ES0200002030	1,2500 % Adif - Alta Velocidad MTN 18/26		EUR	200.000	200.000	0	% 99,940	199.880,00	0,49
ES0200002022	0,8000 % Adif - Alta Velocidad Obl. 17/23		EUR	200.000	0	0	% 100,912	201.824,00	0,50
XS1849550592	2,2500 % AIB Group PLC MT Non-Pref. Nts 18/25		EUR	250.000	250.000	0	% 99,011	247.526,25	0,61
XS1799975765	1,5000 % AIB Group PLC MTN 18/23		EUR	425.000	425.000	0	% 99,228	421.716,88	1,04
XS1202664386	1,3750 % Allied Irish Banks PLC MTN 15/20		EUR	200.000	0	0	% 102,530	205.059,00	0,51
PTBCPWOM0034	4,5000 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR MT Obl.17/27		EUR	200.000	200.000	200.000	% 93,750	187.500,00	0,46
XS1731105612	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. MTN 17/23		EUR	300.000	400.000	400.000	% 98,554	295.662,00	0,73
XS1557268221	1,3750 % Banco Santander S.A. 2nd Ranking Notes 17/22		EUR	400.000	100.000	0	% 101,754	407.014,00	1,01
XS1767931121	2,1250 % Banco Santander S.A. MTN 18/28		EUR	200.000	400.000	200.000	% 92,246	184.491,00	0,46
XS1751004232	1,1250 % Banco Santander S.A. Non-Pref. MTN 18/25		EUR	100.000	500.000	400.000	% 96,463	96.462,50	0,24
ES0414950644	4,1250 % BANKIA S.A. Cédulas Hip. 06/36		EUR	400.000	400.000	0	% 131,705	526.820,00	1,30
XS1641442246	1,1250 % Bright Food SG Hldgs Pte. Ltd. Notes 17/20		EUR	125.000	0	0	% 100,851	126.063,75	0,31
XS1839682116	3,5000 % Bulgarian Energy Holding EAD Bonds 18/25		EUR	200.000	200.000	0	% 100,188	200.375,00	0,50

# Frankfurter-Sparrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
PTCMGTOM0029	0,8750 % Caixa Económica Montepio Geral MT Obr. Hip. 17/22		EUR	400.000	400.000	0	% 100,891	403.564,00	1,00	
ES0840609012	5,2500 % CaixaBank S.A. FLR Notes 18/Und.		EUR	200.000	200.000	0	% 91,800	183.600,00	0,45	
XS1529934801	1,4230 % CETIN Finance B.V. MTN 16/21		EUR	400.000	0	0	% 102,928	411.712,00	1,02	
ES0000101719	0,7270 % Comunidad Autónoma de Madrid Bonos 16/21		EUR	100.000	0	0	% 101,885	101.885,00	0,25	
XS0981442931	2,7500 % CRH Finland Services Oyj MTN 13/20		EUR	200.000	0	0	% 105,499	210.998,00	0,52	
ES0205045000	1,6250 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 15/22		EUR	400.000	0	0	% 101,492	405.968,00	1,01	
ES0205045018	1,5000 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 17/23		EUR	300.000	0	0	% 99,450	298.348,50	0,74	
XS1589970968	0,8750 % Distribuidora Intl de Alim.SA MTN 17/23		EUR	200.000	200.000	0	% 97,467	194.933,00	0,48	
PTEDPUOM0024	5,3750 % EDP - Energias de Portugal SA FLR Securities 15/75		EUR	300.000	300.000	0	% 107,975	323.925,00	0,80	
XS1846632104	1,6250 % EDP Finance B.V. MTN 18/26		EUR	225.000	225.000	0	% 98,838	222.385,50	0,55	
XS1811024543	1,6590 % EP Infrastructure a.s. Notes 18/24		EUR	775.000	775.000	0	% 96,601	748.657,75	1,84	
XS1720053229	0,2500 % Ferrari N.V. Notes 17/21		EUR	100.000	0	325.000	% 99,216	99.215,50	0,25	
XS1640492648	0,4000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 17/21		EUR	200.000	0	0	% 100,234	200.468,00	0,50	
XS1844997970	3,5000 % International Game Technology Notes 18/24 Reg.S		EUR	125.000	125.000	0	% 99,625	124.531,25	0,31	
DE000A1919G4	1,7500 % JAB Holdings B.V. Bonds 18/26		EUR	200.000	200.000	0	% 99,770	199.539,00	0,49	
XS1551347393	2,2000 % Jaguar Land Rover Automotive Notes 17/24 Reg.S		EUR	200.000	200.000	0	% 98,000	196.000,00	0,49	
ES0000012B88	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 18/28		EUR	360.000	360.000	0	% 100,265	360.954,00	0,89	
ES0000012B70	0,1500 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 18/23		EUR	400.000	400.000	0	% 106,771	427.084,88	1,06	
ES0224244071	1,6250 % Mapfre S.A. Obl. 16/26		EUR	400.000	300.000	0	% 100,153	400.610,00	0,99	
XS1551000364	0,7500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 17/20		EUR	100.000	0	0	% 100,181	100.180,50	0,25	
XS1729879822	1,3750 % Prosegur Cash S.A. MTN 17/26		EUR	100.000	0	500.000	% 96,826	96.826,00	0,24	
XS1496344794	0,2500 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19		EUR	200.000	0	0	% 100,394	200.788,00	0,50	
XS1781346801	0,7500 % Santander Consumer Bank AS MTN 18/23		EUR	200.000	200.000	0	% 100,278	200.556,00	0,50	
XS1413580579	1,0000 % Santander Consumer Finance SA MTN 16/21		EUR	200.000	0	0	% 102,061	204.122,00	0,51	
XS1827891869	0,7500 % SpareBank 1 SMN MTN 18/23		EUR	275.000	275.000	0	% 99,887	274.689,25	0,68	
FR0013346822	0,0000 % Téléperformance SE Obl. 18/25		EUR	200.000	200.000	0	% 99,038	198.075,00	0,49	
XS1673620016	0,1250 % UBS AG (London Branch) MTN 17/21		EUR	200.000	0	0	% 99,584	199.168,00	0,49	
XS1810806635	0,6250 % UBS AG (London Branch) MTN 18/23		EUR	350.000	350.000	0	% 100,398	351.393,00	0,87	
<b>PLN</b>								<b>183.918,25</b>	<b>0,46</b>	
PL0000109492	2,2500 % Republik Polen Bonds S.0422 16/22		PLN	800.000	0	0	% 100,232	183.918,25	0,46	
<b>Summe Wertpapiervermögen <sup>1)</sup></b>								<b>EUR</b>	<b>38.605.579,87</b>	<b>95,57</b>
<b>Derivate</b>										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um <b>verkaufte</b> Positionen.)										
<b>Zins-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Zinsterminkontrakte</b>										
								<b>-134.464,76</b>	<b>-0,33</b>	
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 18		XEUR	EUR	-2.000.000				-17.930,00	-0,04	
EURO Buxl Future (FGBX) Sep. 18		XEUR	EUR	-1.100.000				-34.660,00	-0,09	
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 18		XEUR	EUR	-1.700.000				-20.617,50	-0,05	
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 18		XCBT	USD	400.000				-833,23	-0,00	
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 18		XEUR	EUR	-3.400.000				-60.760,00	-0,15	
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 18		XCBT	USD	500.000				335,97	0,00	
<b>Optionsrechte</b>										
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>										
EURO Bund Future (FGBL) Put Aug. 18 162		XEUR	EUR	Anzahl 10			EUR 0,010	100,00	0,00	
<b>Summe Zins-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>-134.364,76</b>	<b>-0,33</b>
<b>Devisen-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>										
<b>Offene Positionen</b>										
AUD/JPY 400.000,00			OTC					1.854,29	0,00	
CAD/EUR 136.818,00			OTC					719,72	0,00	
CAD/JPY 1.500.040,41			OTC					9.068,11	0,02	
CZK/EUR 12.674.000,00			OTC					-12.821,90	-0,03	
GBP/CHF 250.000,00			OTC					335,47	0,00	
GBP/EUR 375.000,00			OTC					-3.437,24	-0,01	
HUF/EUR 156.719.779,00			OTC					-5.323,75	-0,01	
JPY/CAD 31.089.000,00			OTC					-1.535,58	-0,00	
JPY/EUR 56.169.354,00			OTC					-2.068,96	-0,00	
NOK/EUR 3.022.683,00			OTC					-169,26	-0,00	
USD/EUR 1.170.475,00			OTC					2.380,43	0,01	

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>2.549,74</b>	<b>0,03</b>
<b>Offene Positionen</b>									
	AUD/JPY 400.000,00	OTC						100,56	0,00
	CAD/JPY 375.000,00	OTC						-3.848,15	-0,01
	CHF/EUR 570.332,00	OTC						2.727,65	0,01
	CZK/EUR 34.020.982,80	OTC						2.631,31	0,00
	GBP/USD 470.463,56	OTC						6.262,62	0,02
	JPY/AUD 64.217.841,00	OTC						242,10	0,00
	JPY/EUR 31.863.775,00	OTC						2.372,58	0,01
	JPY/NZD 69.472.998,00	OTC						-7.895,10	-0,02
	JPY/USD 54.249.736,00	OTC						2.098,40	0,01
	NOK/EUR 2.854.020,00	OTC						-599,86	-0,00
	NZD/EUR 221.374,00	OTC						2.108,31	0,01
	PLN/EUR 2.816.165,00	OTC						3.731,06	0,01
	RON/EUR 1.200.912,00	OTC						-610,19	-0,00
	USD/EUR 4.050.939,00	OTC						-6.771,55	-0,01
<b>Optionsrechte</b>								<b>33.709,16</b>	<b>0,07</b>
<b>Optionsrechte auf Devisen (Kauf)</b>								<b>33.709,16</b>	<b>0,07</b>
	PUT AUD/CALL JPY 82,00 06/18	OTC	AUD	2.000.000			% 0,459	5.839,09	0,01
	PUT CAD/CALL JPY 83,50 06/18	OTC	CAD	1.500.000			% 0,008	81,81	0,00
	PUT EUR/CALL JPY 129,00 07/18	OTC	EUR	1.000.000			% 1,009	10.088,10	0,02
	PUT EUR/CALL NZD 1,68 06/18	OTC	EUR	1.500.000			% 0,000	0,00	0,00
	PUT EUR/CALL USD 1,17 07/18	OTC	EUR	2.000.000			% 0,649	12.973,96	0,03
	PUT GBP/CALL CHF 1,31 07/18	OTC	GBP	1.000.000			% 0,419	4.726,20	0,01
<b>Optionsrechte auf Devisen (Verkauf)</b>								<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
	PUT CAD/CALL JPY 80,00 06/18	OTC	CAD	-1.500.000			% 0,000	0,00	0,00
<b>Summe Devisen-Derivate</b>								<b>EUR 25.260,23</b>	<b>0,08</b>
<b>Swaps</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Zinsswaps</b>									
<b>(Erhalten/Zahlen)</b>								<b>-196.021,54</b>	<b>-0,48</b>
	IRS 2.115% USD / LIBUSD03 USD / CITIGMX_LDN 25.11.2026	OTC	USD	1.200.000				-60.532,50	-0,15
	IRS BUBORM06 HUF / 1.555% HUF / JPM_LDN 14.02.2022	OTC	HUF	150.000.000				-1.435,69	-0,00
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.383% EUR / DGZ_FRA 30.01.2023	OTC	EUR	2.000.000				-26.446,61	-0,07
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.019% EUR / DGZ_FRA 21.10.2022	OTC	EUR	2.000.000				11.396,76	0,03
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.166% EUR / DGZ_FRA 11.02.2022	OTC	EUR	4.000.000				-22.044,89	-0,05
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.277% EUR / DGZ_FRA 29.01.2022	OTC	EUR	4.000.000				-41.084,41	-0,10
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.29% EUR / DBK_FRA 21.07.2022	OTC	EUR	2.500.000				-26.362,82	-0,07
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.473% EUR / GOLDINT_LDN 15.02.2025	OTC	EUR	2.900.000				-4.726,16	-0,01
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.685% EUR / DGZ_FRA 23.01.2024	OTC	EUR	3.000.000				-69.092,29	-0,17
	IRS LIBUSD03 USD / 2.39% USD / CITIGMX_LDN 25.11.2046	OTC	USD	500.000				44.307,07	0,11
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>								<b>-136.088,02</b>	<b>-0,34</b>
<b>Protection Buyer</b>								<b>-136.088,02</b>	<b>-0,34</b>
	CDS Barclays Bank PLC682 06DABK / BNP_LDN 20.12.2021	OTC	EUR	500.000				-8.262,31	-0,02
	CDS CDX.EM. S26 V2 5Y / CSFBINT_LDN 20.12.2021	OTC	USD	600.000				6.875,78	0,02
	CDS CDX.EM. S29 V1 5Y / MERRILL_LDN 20.06.2023	OTC	USD	500.000				16.883,55	0,04
	CDS CDX.NA.HY. S29 V1 5Y / GOLDINT_LDN 20.12.2022	OTC	USD	500.000				-27.174,67	-0,07
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S28 V1 5Y / BNP_LDN 20.12.2022	OTC	EUR	500.000				-44.427,30	-0,11
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S29 V1 5Y / CITIGMX_LDN 20.06.2023	OTC	EUR	400.000				-30.643,62	-0,08
	CDS ITRAXX EUROPE S27 V1 5Y / GOLDINT_LDN 20.06.2022	OTC	EUR	1.000.000				-17.677,63	-0,04
	CDS ITRAXX EUROPE SEN FINANCIALS S29 V1 5Y / DBK_LDN 20.06.2023	OTC	EUR	1.000.000				-3.113,72	-0,01
	CDS Lloyds Bank PLC9730 GLA88B / BNP_LDN 20.06.2021	OTC	EUR	600.000				-12.438,08	-0,03
	CDS Statoil ASA MTN / BNP_LDN 20.12.2022	OTC	EUR	500.000				-16.110,02	-0,04
<b>Optionsrechte auf Zinsswaps</b>								<b>6.515,56</b>	<b>0,02</b>
<b>Payer Swap</b>								<b>6.515,56</b>	<b>0,02</b>
	SWP Long Pay 0,35% NOMU_LDN 17.10.2018_35_NOMU_LDN_17.10.2018	OTC	JPY	700.000.000			% 0,120	6.515,56	0,02
<b>Summe Swaps</b>								<b>EUR -325.594,00</b>	<b>-0,80</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		EUR	2.867.703,56			% 100,000	2.867.703,56	7,09

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		DKK	80.659,00			% 100,000	10.823,52	0,03
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		GBP	8.204,05			% 100,000	9.256,83	0,02
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		HUF	0,37			% 100,000	0,00	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		AUD	4.047,76			% 100,000	2.572,30	0,01
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		CAD	0,01			% 100,000	0,01	0,00
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		JPY	26.978,00			% 100,000	209,73	0,00
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		SGD	0,01			% 100,000	0,01	0,00
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		TRY	282,13			% 100,000	53,14	0,00
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		USD	30.902,41			% 100,000	26.579,29	0,07
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		ZAR	693,67			% 100,000	43,44	0,00
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>2.917.241,83</b>	<b>7,22</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahen Fonds</b>							<b>EUR</b>	<b>2.917.241,83</b>	<b>7,22</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Zinsansprüche		EUR	299.669,48				299.669,48	0,74
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	127.152,08				127.152,08	0,31
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	2.722,25				2.722,25	0,01
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>429.543,81</b>	<b>1,06</b>
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>									
<b>Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		NOK	-0,01			% 100,000	-0,00	-0,00
<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-0,00</b>	<b>-0,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften		EUR	-22.916,39				-22.916,39	-0,06
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-1.080.215,53				-1.080.215,53	-2,67
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-27.407,49				-27.407,49	-0,07
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-1.130.539,41</b>	<b>-2,80</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>40.387.127,57</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>781.079</b>	
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>51,71</b>	

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

<sup>1)</sup> Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

**Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 296.185,33**

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.06.2018

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88627	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45220	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,47575	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,15713	= 1 Euro (EUR)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	5,30930	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,35985	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	25,88450	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	328,37500	= 1 Euro (EUR)
Rumänien, Leu	(RON)	4,66020	= 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	15,96885	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,16265	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,53720	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,58540	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	128,63000	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,57360	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,71800	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

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

**OTC** Over-the-Counter

# Frankfurter-Sparinrent Deka

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>CHF</b>				
CH0025185676	3,0000 % EUROFIMA Anl. 06/26	CHF	0	300.000
CH0226274261	2,8500 % Gaz Capital S.A. MT LPN GAZPROM 13/19	CHF	0	300.000
<b>DEM</b>				
DE0001345759	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero Bonds 96/26	DEM	0	450.000
<b>EUR</b>				
XS1789699607	1,7500 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 18/26	EUR	325.000	325.000
DE000A1954V6	0,8750 % Allianz Finance II B.V. MTN 17/27	EUR	0	200.000
XS1762980065	2,5000 % Alpha Bank S.A. Covered MTN 18/23	EUR	125.000	125.000
FR0013295722	1,5000 % APRR MTN 17/33	EUR	0	300.000
XS1730873731	0,9500 % ArcelorMittal S.A. MTN 17/23	EUR	0	275.000
FR0013336229	1,5000 % Arkéa Home Loans SFH S.A. Mortg. Cov. MTN 18/33	EUR	300.000	300.000
XS1577951715	1,1510 % Asahi Group Holdings Ltd. Notes 17/25	EUR	0	200.000
FR0013236312	0,6250 % Auchan Holding S.A. MTN 17/22	EUR	0	200.000
IT0005321663	1,0000 % Banco BPM S.p.A. MT Mortg. Cov. Bds 18/25	EUR	400.000	400.000
XS1403619411	1,7500 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 16/26	EUR	200.000	200.000
XS1385051112	1,8750 % Barclays PLC MTN 16/21	EUR	0	100.000
XS1718418103	0,8750 % BASF SE MTN 17/27	EUR	0	200.000
XS1823502577	1,5000 % BASF SE MTN 18/30	EUR	175.000	175.000
IT0005038283	2,8750 % Bca Monte dei Paschi di Siena Mortg.Cov. MTN 14/24	EUR	200.000	200.000
BE6303010472	1,6250 % Belfius Bank S.A. FLR MTN 18/28	EUR	200.000	200.000
FR0013312493	0,8750 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 18/24	EUR	200.000	200.000
FR0013323664	1,3750 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 18/26	EUR	200.000	200.000
FR0013088432	1,5000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 16/31	EUR	300.000	300.000
FR0013327962	1,0000 % Caggemini SE Notes 18/24	EUR	200.000	200.000
FR0013327988	1,7500 % Caggemini SE Notes 18/28	EUR	100.000	100.000
XS1677902162	0,5000 % Carlsberg Breweries A/S MTN 17/23	EUR	0	300.000
FR0011052661	5,9760 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 11/21	EUR	0	200.000
FR0011765825	4,4980 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 14/24	EUR	200.000	200.000
IT0004960537	3,5000 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 13/19	EUR	0	300.000
IT0005105488	1,5000 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 15/25	EUR	0	200.000
IT0005314544	0,7500 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 17/22	EUR	0	200.000
XS1713474671	1,2500 % Celanese US Holdings LLC Notes 17/25	EUR	0	200.000
XS1806124753	1,2500 % CK Hutchison Eur.Fin.(18) Ltd. Notes 18/25	EUR	350.000	350.000
XS1770927629	1,1250 % Corporación Andina de Fomento MTN 18/25	EUR	400.000	400.000
FR0013262698	1,5000 % Covivio S.A. Obl. 17/27	EUR	100.000	200.000
FR0013312154	2,6250 % Crédit Agricole Assurances SA FLR Notes 18/48	EUR	200.000	200.000
DE000DL19T26	1,7500 % Deutsche Bank AG MTN 18/28	EUR	400.000	400.000
XS1828033834	2,0000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 18/29	EUR	400.000	400.000
XS1719154574	0,5000 % Diageo Finance PLC MTN 17/24	EUR	0	250.000
XS1713464102	0,8750 % Elering A.S. Bonds 18/23	EUR	275.000	275.000
XS1612977717	1,1250 % European Investment Bank MTN 17/33	EUR	375.000	375.000
XS1753042743	1,5000 % European Investment Bank MTN 18/48	EUR	150.000	150.000
XS1139494493	4,1250 % Gas Natural Fenosa Finance BV FLR Securit. 14/Und.	EUR	0	100.000
GR0118017657	3,3750 % Griechenland Notes 18/25	EUR	500.000	500.000
XS1810653540	1,7500 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 18/28	EUR	250.000	250.000
XS1807409450	0,8750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG MTN 18/23	EUR	400.000	400.000
XS1685589027	0,6250 % Hypo Vorarlberg Bank AG MT Bonds 17/22	EUR	0	300.000
FR0013320058	1,6250 % Icade S.A. Obl. 18/28	EUR	400.000	400.000
XS1689540935	1,6250 % ING Groep N.V. FLR MTN 17/29	EUR	0	200.000
XS1829217428	0,7500 % innogy Finance B.V. MTN 18/22	EUR	200.000	200.000
XS1785340172	1,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 18/28	EUR	500.000	500.000
BE0000346552	1,2500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.86 18/33	EUR	300.000	300.000
ES0000012157	4,7000 % Königreich Spanien Bonos 09/41	EUR	200.000	200.000
ES00000123U9	5,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23	EUR	400.000	400.000
ES00000123X3	4,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23	EUR	0	100.000
ES00000128E2	3,4500 % Königreich Spanien Bonos 16/66	EUR	810.000	810.000
ES0000012A97	0,4500 % Königreich Spanien Bonos 17/22	EUR	0	100.000
ES0000012B47	2,7000 % Königreich Spanien Bonos 18/48	EUR	625.000	625.000
ES0000012852	0,6500 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 17/27	EUR	300.000	300.000
ES0000012729	1,9500 % Königreich Spanien Obligaciones 16/26	EUR	0	300.000
DE000A11QTF7	0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 15/30	EUR	200.000	200.000
FR0013321080	1,0000 % Legrand S.A. Obl. 18/26	EUR	300.000	300.000
XS1803247557	1,1250 % Lunar Funding V PLC MT LPN Swisscom 18/26	EUR	250.000	250.000
XS1567173809	0,6250 % McKesson Corp. Notes 17/21	EUR	0	225.000
XS1046272420	2,2500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 14/19	EUR	0	200.000
XS1619643015	1,7500 % Merlin Properties SOCIMI S.A. MTN 17/25	EUR	0	150.000
XS1496343986	1,3980 % mFinance France S.A. MTN 16/20	EUR	0	300.000
XS1813593313	1,6250 % Mondi Finance PLC MTN 18/26	EUR	200.000	200.000
XS1554112281	1,5000 % NIBC Bank N.V. MTN 17/22	EUR	0	300.000
XS0497179035	4,5000 % Nordea Bank AB MTN 10/20	EUR	0	300.000
XS1734689620	1,0000 % OMV AG MTN 17/26	EUR	0	350.000
FR0013322187	2,6250 % Orpea Obligations 18/25	EUR	300.000	300.000
XS1713466578	0,6000 % PerkinElmer Inc. Notes 18/21	EUR	675.000	675.000

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1757843146	1,3750 % Pirelli & C. S.p.A. MTN 18/23	EUR	425.000	425.000
AT0008093273	1,3750 % Raiffeisen-Landesbk Steiermark MTN S.16 18/33	EUR	200.000	200.000
XS1720806774	0,7500 % Raiffeisenlandesbk.Oberösterreich. MTN 17/23	EUR	0	200.000
XS1223842847	1,8750 % Redexis Gas Finance B.V. MTN 15/27	EUR	200.000	200.000
XS1728776219	1,8750 % Redexis Gas Finance B.V. MTN Tr.2 17/27	EUR	0	200.000
FR0013154028	1,7500 % Rep. Frankreich OAT 16/66	EUR	300.000	300.000
FR0013286192	0,7500 % Rep. Frankreich OAT 17/28	EUR	400.000	400.000
FI4000306758	1,1250 % Republik Finnland Bonds 18/34	EUR	400.000	400.000
XS1810775145	1,7500 % Republik Indonesien Notes 18/25	EUR	175.000	175.000
IE00BV8C9418	1,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 16/26	EUR	0	100.000
IE00BDHDP44	0,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 18/28	EUR	400.000	400.000
IT0004286966	5,0000 % Republik Italien B.T.P. 07/39	EUR	0	250.000
IT0004923998	4,7500 % Republik Italien B.T.P. 13/44	EUR	0	100.000
IT0005172322	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 16/23	EUR	0	100.000
IT0005217390	2,8000 % Republik Italien B.T.P. 16/67	EUR	150.000	150.000
IT0005277444	0,9000 % Republik Italien B.T.P. 17/22	EUR	0	150.000
IT0005273013	3,4500 % Republik Italien B.T.P. 17/48	EUR	200.000	200.000
IT0005325946	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	300.000	300.000
IT0005327306	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 18/25	EUR	500.000	500.000
IT0005323032	2,0000 % Republik Italien B.T.P. 18/28	EUR	500.000	500.000
IT0005321325	2,9500 % Republik Italien B.T.P. 18/38	EUR	180.000	180.000
IT0005188120	0,1000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 16/22	EUR	150.000	250.000
XS1028953989	3,8750 % Republik Kroatien Notes 14/22	EUR	300.000	750.000
XS1117298916	3,0000 % Republik Kroatien Notes 15/25	EUR	300.000	300.000
XS1619568139	2,1000 % Republik Litauen MTN 17/47	EUR	150.000	150.000
XS1807201899	3,3750 % Republik Montenegro Notes 18/25 Reg.S	EUR	150.000	150.000
XS1766612672	1,1250 % Republik Polen MTN 18/26	EUR	200.000	200.000
PTOTEAOE0007	4,1000 % Republik Portugal Obl. 06/37	EUR	250.000	250.000
PTOTEAOE0021	4,9500 % Republik Portugal Obr. 08/23	EUR	650.000	1.050.000
XS1060842975	3,6250 % Republik Rumänien MTN 14/24	EUR	100.000	400.000
XS1599193403	2,3750 % Republik Rumänien MTN 17/27 Reg.S	EUR	150.000	150.000
XS1768074319	3,3750 % Republik Rumänien MTN 18/38 Reg.S	EUR	400.000	400.000
SI0002103487	1,5000 % Republik Slowenien Bonds 15/35	EUR	250.000	450.000
SI0002103685	1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27	EUR	300.000	300.000
SI0002103776	1,0000 % Republik Slowenien Bonds 18/28	EUR	750.000	750.000
XS1789751531	1,0000 % Richemont Intl Holding S.A. Notes 18/26	EUR	325.000	325.000
XS1789752182	1,5000 % Richemont Intl Holding S.A. Notes 18/30	EUR	350.000	350.000
XS1819575066	0,8750 % Rolls-Royce PLC MTN 18/24	EUR	200.000	200.000
XS1819574929	1,6250 % Rolls-Royce PLC MTN 18/28	EUR	175.000	175.000
FR0013264884	0,2470 % SAFRAN FLR Obl. 17/21	EUR	0	200.000
XS1775786574	1,6250 % Sampo OYJ MTN 18/28	EUR	275.000	275.000
FR0013324357	1,3750 % Sanofi S.A. MTN 18/30	EUR	200.000	200.000
FR0013324373	1,8750 % Sanofi S.A. MTN 18/38	EUR	400.000	400.000
DE000A2G8VT5	1,0000 % SAP SE MTN 18/26	EUR	200.000	200.000
DE000A2G8VU3	1,3750 % SAP SE MTN 18/30	EUR	100.000	100.000
FR0013302809	0,8750 % Schneider Electric SE MTN 17/26	EUR	0	300.000
DE000A2LQKV2	1,5000 % Sixt Leasing SE MTN 18/22	EUR	250.000	250.000
DE000A2G9HU0	1,5000 % Sixt SE Anl. 18/24	EUR	400.000	400.000
XS1764691611	2,0000 % SNCF Réseau MTN 18/48	EUR	300.000	300.000
XS1718306050	0,5000 % Société Générale S.A. Non-Pref. MTN 17/23	EUR	0	300.000
FR0013311503	1,1250 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 18/25	EUR	300.000	300.000
XS1693281534	0,7500 % Standard Chartered PLC FLR MTN 17/23	EUR	0	200.000
XS1002121454	6,5000 % Stichting AK Rabobank Cert. FLR Cert. 14/Und.	EUR	350.000	350.000
XS1794354628	2,5000 % Stora Enso Oyj MTN 18/28	EUR	125.000	125.000
XS0909773268	6,8750 % Storebrand Livsforsikring AS FLR Notes 13/43	EUR	0	100.000
XS1724873275	1,0000 % Südzucker Intl Finance B.V. Notes 17/25	EUR	0	300.000
XS1811198701	1,7500 % Sydney Airport Fin.Co.Pty Ltd. MTN 18/28	EUR	175.000	175.000
XS1729882024	2,2500 % Talanx AG FLR Nachr. Anl. 17/47	EUR	0	300.000
XS1490960942	3,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 16/Und.	EUR	0	100.000
XS1402235060	0,3720 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN 16/19	EUR	0	200.000
XS1788515606	1,7500 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC FLR MTN 18/26	EUR	400.000	400.000
DE000A2BPET2	1,3750 % thyssenkrupp AG MTN 17/22	EUR	0	150.000
XS0750894577	3,8750 % Tschechien MTN 12/22	EUR	200.000	300.000
FR0013313186	1,2890 % Ubisoft Entertainment S.A. Bonds 18/23	EUR	100.000	100.000
CH0409606354	1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG FLR Notes 18/25	EUR	625.000	625.000
XS1739839998	5,3750 % UniCredit S.p.A. FLR MTN 17/Und.	EUR	0	200.000
XS1769090991	1,1250 % Unilever N.V. MTN 18/27	EUR	325.000	325.000
XS1769091296	1,6250 % Unilever N.V. MTN 18/33	EUR	200.000	200.000
FR0013282571	0,8750 % Vivendi S.A. MTN 17/24	EUR	0	200.000
XS1721422902	2,8750 % Vodafone Group PLC MTN 17/37	EUR	150.000	150.000
AT0000A1Y3P7	1,3750 % voestalpine AG MTN 17/24	EUR	0	300.000
AT000B121967	2,7500 % Volksbank Wien AG FLR Notes 17/27	EUR	0	300.000
XS1823518730	1,0000 % Würth Finance International BV MTN 18/25	EUR	175.000	175.000
XS1793287472	0,8750 % Yorkshire Building Society MTN 18/23	EUR	200.000	200.000
<b>HUF</b>				
HU0000403068	3,0000 % Ungarn Notes S.24/B 15/24	HUF	0	100.000.000
<b>ITL</b>				
DE0001342244	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero Bonds 96/26	ITL	300.000.000	300.000.000

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>NOK</b>				
NO0010572878	3,7500 % Königreich Norwegen Anl. 10/21	NOK	0	3.000.000
NO0010646813	2,0000 % Königreich Norwegen Anl. 12/23	NOK	0	4.500.000
<b>USD</b>				
XS1753594198	4,4500 % ABJA Investment Co. Pte Ltd. Notes 18/23	USD	350.000	350.000
XS1085735899	5,1250 % Republik Portugal MTN 14/24 Reg.S	USD	100.000	600.000
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS1709374497	1,6080 % Zi Rete Gas S.p.A. MTN 17/27	EUR	400.000	400.000
XS1718281808	1,6080 % Zi Rete Gas S.p.A. MTN Tr.2 17/27	EUR	0	400.000
XS1731858392	1,5000 % ADLER Real Estate AG Anl. 17/21	EUR	0	175.000
XS1057481084	2,7500 % Allied Irish Banks PLC MTN 14/19	EUR	0	200.000
XS1405136364	5,6250 % Banco de Sabadell S.A. MTN 16/26	EUR	300.000	300.000
XS1793250041	4,7500 % Banco Santander S.A. FLR Nts 18/Und.	EUR	200.000	200.000
XS1791443440	0,6250 % Bank of Irel.Mortgage Bank PLC MT Cov. Secs 18/25	EUR	375.000	375.000
ES0213307046	3,3750 % BANKIA S.A. FLR Obl. 17/27	EUR	200.000	200.000
ES0413679418	1,2500 % Bankinter S.A. Cédulas Hipotec. 18/28	EUR	200.000	200.000
BE6298043272	0,7500 % Belfius Bank S.A. Non-Preferred MTN 17/22	EUR	0	200.000
ES0440609347	1,6250 % Caixabank S.A. Cédulas Hipotec. 17/32	EUR	300.000	300.000
XS1645495349	2,7500 % Caixabank S.A. FLR MTN 17/28	EUR	100.000	100.000
ES0440609396	1,0000 % Caixabank S.A. Mortg. Cov. MTN 18/28	EUR	300.000	300.000
XS1752476538	0,7500 % Caixabank S.A. MTN 18/23	EUR	400.000	400.000
ES0415306069	0,8750 % Caja Rural de Navarra Cédulas Hipotec. 18/25	EUR	200.000	200.000
XS1468525057	2,3750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 16/24	EUR	100.000	300.000
XS1291367313	2,3750 % Citycon Treasury B.V. Notes 15/22	EUR	0	100.000
ES0000101677	2,0800 % Comunidad Autónoma de Madrid Bonos 15/30	EUR	150.000	150.000
ES0000101875	1,7730 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 18/28	EUR	250.000	250.000
XS1693959931	2,1250 % CPI PROPERTY GROUP S.A. MTN 17/24	EUR	250.000	250.000
XS1731920291	2,1250 % CPI PROPERTY GROUP S.A. MTN Tr.2 17/24	EUR	0	250.000
XS1713463716	2,5000 % ENEL S.p.A. FLR Cap. Secs 18/78	EUR	200.000	200.000
XS1816296062	4,5000 % ENERGO-PRO a.s. Notes 18/24	EUR	250.000	250.000
XS1789623029	1,0000 % Euronext N.V. Notes 18/25	EUR	150.000	150.000
ES0378641239	0,5000 % Fdo de Tit.D.Def.Sist.Elec.FTA MT Bonos 16/20	EUR	0	300.000
XS1380394806	1,5000 % Ferrari N.V. Notes 16/23	EUR	0	100.000
XS1378895954	1,7500 % Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV Notes 16/23	EUR	0	200.000
XS1721244371	1,8750 % Iberdrola International B.V. FLR Notes 17/Und.	EUR	0	100.000
XS1797138960	2,6250 % Iberdrola International B.V. FLR Securit. 18/Und.	EUR	200.000	200.000
XS1509942923	1,4500 % Inmobiliaria Colonial SOCIMI MTN 16/24	EUR	0	200.000
XS1755108344	1,1250 % Íslandsbanki hf. FLR MTN 18/24	EUR	125.000	125.000
XS1812878889	1,0730 % mBank Hipoteczny S.A. MT Hyp.-Pfe.-Br. 18/25	EUR	300.000	300.000
XS1615501837	0,4740 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA FLR MTN 17/22	EUR	0	100.000
XS1689739347	0,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 17/22	EUR	0	225.000
XS1198102052	1,6250 % Mexiko MTN 15/24	EUR	200.000	200.000
XS1369322927	1,8750 % Mexiko MTN 16/22	EUR	0	300.000
XS1751001139	1,7500 % Mexiko MTN 18/28	EUR	750.000	750.000
XS0916766057	2,7500 % Mexiko MTN S.A 13/23	EUR	0	500.000
XS1722898431	1,7500 % NE Property Coöperatief U.A. MTN 17/24	EUR	0	400.000
XS1691349952	2,0650 % NorteGas Energia Distribuc.SAU MTN 17/27	EUR	0	150.000
XS1379158048	5,1250 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 16/23	EUR	100.000	250.000
XS1568874983	3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/24	EUR	400.000	400.000
XS1568875444	2,5000 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN S.C 17/21	EUR	0	300.000
XS1198102052	1,0000 % Prosegur - Cia de Seguridad SA Notes 18/23	EUR	200.000	200.000
XS1679505070	1,6250 % Rail Transit Int.Invst.Co.Ltd. Notes 18/22	EUR	575.000	575.000
XS1753814737	1,7500 % REN Finance B.V. MTN 18/28	EUR	150.000	150.000
XS1503160225	3,8750 % Rep. Argentinien Bonds 16/22	EUR	0	200.000
XS1744744191	2,7500 % Republik Mazedonien Bonds 18/25 Reg.S	EUR	150.000	150.000
XS1636469865	1,2500 % Rikshem AB MTN 17/24	EUR	0	100.000
XS1731882186	1,6250 % Roadster Finance DAC MTN 17/29	EUR	0	225.000
XS1591523755	2,7500 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 17/22	EUR	0	200.000
XS1765875718	1,6250 % Soc. Inziat. Aut. e Serv.SIAS MTN 18/28	EUR	150.000	150.000
XS1211040917	1,2500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 15/23	EUR	100.000	250.000
XS1789456024	4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 18/25 Reg.S	EUR	350.000	350.000
XS1418835002	1,5000 % Transmission Finance DAC MTN 16/23	EUR	0	100.000
XS1748883458	0,8170 % Triceratops Capital Co. Ltd. Notes 18/21	EUR	275.000	275.000
DE000A19UR79	1,5000 % Vonovia Finance B.V. MTN 18/28	EUR	200.000	200.000
XS1716616179	1,1000 % Whirlpool Fin. Luxembourg Sarl Notes 17/27	EUR	0	400.000
XS1782806357	1,7500 % Západoslovenská energetika AS MTN 18/28	EUR	275.000	275.000
<b>PLN</b>				
PL0000108510	1,5000 % Republik Polen Bonds S.0420 15/20	PLN	0	1.000.000
<b>USD</b>				
US91087BAE02	3,7500 % Mexiko Notes 18/28	USD	200.000	200.000
XS1750113406	4,1250 % Sultanat Oman Notes 18/23 Reg.S	USD	300.000	300.000
US912828X398	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 17/22	USD	0	500.000

# Frankfurter-Sparinrent Deko

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>	EUR	11.440
(Basiswert(e): 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Long Gilt (10,0))		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>	EUR	79.497
(Basiswert(e): 10 Year Euro Spanish Bonos (10,0), 10 Year US Treasury Notes (10,0), 2 Year US Treasury Notes (2,0), 30 Year US Treasury Bonds (30,0), Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Euro Buxl Futures (30,0), EuroBTP Italian Gov. (10,0), EuroBTP Italian Gov. (3,0), EuroOAT French Gov. Bond (10,0), Long Gilt (10,0))		
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Swaps (Swaptions)</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	EUR	4
(Basiswert(e): SWP Long Pay ITraxxECr28 CITIGMX_LDN 21.02.2018)		
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	EUR	2
(Basiswert(e): SWP Short Pay ITraxxECr28 CITIGMX_LDN 21.02.2018)		
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	EUR	12.537
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP))		
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	EUR	5.340
(Basiswert(e): EURO-BTP Future (FBTP))		
<b>Währungsderivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen</b>		
<b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
EUR/USD	EUR	24
USD/JPY	EUR	2
USD/KRW	EUR	10
USD/MXN	EUR	10
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
AUD/JPY	EUR	15
AUD/USD	EUR	19
EUR/CAD	EUR	8
EUR/NOK	EUR	13
EUR/USD	EUR	5
GBP/JPY	EUR	21
GBP/USD	EUR	29
NZD/JPY	EUR	8
USD/JPY	EUR	11
<b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
EUR/USD	EUR	3
USD/KRW	EUR	5
USD/MXN	EUR	3
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
AUD/USD	EUR	28
GBP/JPY	EUR	4
GBP/USD	EUR	13
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	EUR	613
AUD/JPY	EUR	2.431
AUD/USD	EUR	4.678
CAD/EUR	EUR	3.513
CAD/JPY	EUR	245
CAD/USD	EUR	4.083
CHF/EUR	EUR	2.196
CZK/EUR	EUR	1.545
GBP/EUR	EUR	2.168
GBP/JPY	EUR	3.467
GBP/USD	EUR	4.767
HUF/EUR	EUR	1.840
JPY/EUR	EUR	3.610
JPY/NZD	EUR	522
JPY/USD	EUR	5.690
KRW/USD	EUR	4.048
NOK/EUR	EUR	8.196
NZD/EUR	EUR	2.563
NZD/JPY	EUR	1.604
NZD/USD	EUR	1.146
PLN/EUR	EUR	2.537
RON/EUR	EUR	844
TRY/EUR	EUR	27
TRY/USD	EUR	324
USD/EUR	EUR	12.929

# Frankfurter-Sparinrent Deka

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	EUR	613
AUD/JPY	EUR	2.941
AUD/USD	EUR	4.634
CAD/EUR	EUR	3.412
CAD/JPY	EUR	733
CAD/USD	EUR	4.185
CHF/EUR	EUR	2.150
CZK/EUR	EUR	1.947
GBP/EUR	EUR	1.735
GBP/JPY	EUR	3.467
GBP/USD	EUR	5.422
HUF/EUR	EUR	1.859
JPY/AUD	EUR	500
JPY/CAD	EUR	483
JPY/EUR	EUR	2.626
JPY/NZD	EUR	1.063
JPY/USD	EUR	6.035
KRW/USD	EUR	4.054
NOK/EUR	EUR	9.051
NZD/EUR	EUR	3.096
NZD/JPY	EUR	1.596
NZD/USD	EUR	1.146
PLN/EUR	EUR	2.756
RON/EUR	EUR	1.034
SEK/EUR	EUR	5
TRY/USD	EUR	324
USD/EUR	EUR	13.999
<b>Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)</b>		
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>		
<b>Protection Buyer:</b>	EUR	1.400
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S28 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S29 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS S29 V1 5Y)		
<b>Protection Seller:</b>	EUR	500
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S28 V1 5Y)		

# Frankfurter-Sparrent Deka

## Anhang.

Umlaufende Anteile  
Anteilwert

STK 781.079  
EUR 51,71

### 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 / Investmentanteile

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, z.B. Broker-Quotes, zugrunde gelegt, welche sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Investmentanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs bewertet.

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

Verzinsliche Wertpapiere, rentenähnliche Genussscheine, Zertifikate und Schuldscheindarlehen, 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 mittels externer Modellkurse, z.B. Broker-Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.

#### Bankguthaben

Der Wert von Bankguthaben, Einlagenzertifikaten und ausstehenden Forderungen, Bardividenden und Zinsansprüchen entspricht grundsätzlich dem jeweiligen nominalen Betrag.

#### 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. Die Bewertung von 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, erfolgt anhand von Fair Values, 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.

#### 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 2. Juli 2018  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt

### 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

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.  
(Stand: 31. Dezember 2017)

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Michael Rüdiger  
Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Berlin  
Mitglied des Aufsichtsrates der Deka Immobilien GmbH,  
Frankfurt am Main

### Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Berlin  
und der  
Deka Immobilien GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf  
und der  
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;

Mitglied des Verwaltungsrates der DekaBank  
Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A., Luxemburg;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,  
Wiesbaden

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsischen Sparkasse Dresden,  
Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

(Stand 10. April 2018)

## Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Berlin

Thomas Ketter

Stellvertretender Vorsitzender des Verwaltungsrates der  
Deka International S.A., Luxemburg  
und der  
International Fund Management S.A., Luxemburg

Dr. Ulrich Neugebauer

Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,  
Köln  
und der  
Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln  
und der  
Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

Michael Schmidt

Thomas Schneider

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,  
Luxemburg  
Mitglied des Aufsichtsrates der International Fund Management S.A.,  
Luxemburg

(Stand 1. Juli 2018)

## **Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen**

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Squaire  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

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

**Überreicht durch:**

Frankfurter Sparkasse  
60255 Frankfurt am Main  
ServiceLine 069 24 1822 24  
frankfurter-sparkasse.de



**Deka Investment GmbH**

Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

