

Halbjahresbericht
zum 31. August 2017.

Deka-Stiftungen Balance

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



„Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

September 2017

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Stiftungen Balance für den Zeitraum vom 1. März 2017 bis zum 31. August 2017.

Für die Kapitalmarktteilnehmer verlief das Berichtshalbjahr überwiegend positiv. Sowohl in den USA als auch in Europa nahm die konjunkturelle Erholung Fahrt auf. Die US-Notenbank erhöhte in diesem Umfeld im März und Juni erwartungsgemäß die Leitzinsen um jeweils 25 Basispunkte, während in Euroland Mario Draghi an der sehr expansiven Geldpolitik festhielt. Hohe Auslastungsgrade der Volkswirtschaften, steigende Gewinne der Unternehmen, sinkende Arbeitslosenquoten, die Wahlsiege der europafreundlichen Kräfte in den Niederlanden und Frankreich sowie eine solide Berichtssaison bildeten die Basis für ein freundliches Aktienmarkthalbjahr.

Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen stieg im Berichtszeitraum unter Schwankungen leicht auf zuletzt knapp 0,4 Prozent an. Laufzeitgleiche US-Treasuries erreichten im März zunächst ein Jahreshoch bei 2,6 Prozent, bevor die Rendite sukzessive abbröckelte. Zum 31. August 2017 rentierten 10-jährige US-Treasuries mit 2,1 Prozent.

Während die Aktienmärkte in den USA stichtagsbezogen Wertsteigerungen aufwiesen, tendierten die Börsen in Europa unter Schwankungen seitwärts. So konnten im Berichtszeitraum Aktienindizes wie etwa der DAX oder der Dow Jones Industrial Average zwar neue Rekordmarken setzen, im Gegensatz zum Dow Jones gab der DAX seine Gewinne bis zum Ende der Betrachtungsperiode jedoch fast vollständig wieder ab.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Deka-Stiftungen Balance eine Wertentwicklung von minus 0,2 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 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



Steffen Selbach

Inhalt.

Anlagepolitik. Deka-Stiftungen Balance	5
Vermögensübersicht zum 31. August 2017. Deka-Stiftungen Balance	6
Vermögensaufstellung zum 31. August 2017. Deka-Stiftungen Balance	7
Anhang. Deka-Stiftungen Balance	21
Informationen der Verwaltung.	24
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.	25

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

Deka-Stiftungen Balance

Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Fonds Deka-Stiftungen Balance ist ein mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs insbesondere durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, je nach Marktlage weltweit in verzinsliche Wertpapiere (in der Regel USA, Eurozone, Großbritannien) sowie bis zu 30 Prozent in Aktien zu investieren. Die Auswahl der Vermögenswerte trifft das Fondsmanagement nach einem mathematischen Verfahren, durch welches die Entwicklungen je zulässiger Anlageklasse flexibel genutzt werden. Zur Begrenzung der Anlagerisiken dieses Fonds mit konservativem Verlustprofil erfolgt eine laufende Anpassung der Gewichtung der Anlageklassen. Von ihrem Basiswert abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) können dabei sowohl zu Investitions- als auch zu Absicherungszwecken eingesetzt und auch Währungsrisiken weitgehend reduziert werden. Sollte zu einem Zeitpunkt keine der Investitionsmöglichkeiten den Erwartungen des Fondsmanagements entsprechen, kann zum beträchtlichen Teil in kurzfristige liquide Geldanlagen angelegt werden. Dieser Investmentfonds darf mehr als 35 Prozent des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland investieren.

Die erwirtschafteten Erträge werden quartalsweise ausgeschüttet. Damit erfüllt dieser Fonds die für viele Stiftungen bedeutsame Forderung nach mehrmaligen Ausschüttungen pro Jahr, sodass sie Ihren Stiftungszweck ganzjährig erfüllen können.

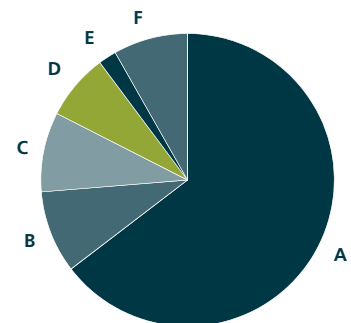
Der Rentenanteil des Fonds (inkl. Rentenfonds, Aktienanleihen und Anleihen mit besonderer Ausstattung) lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 75,7 Prozent. Der wirksame Investitionsgrad verringerte sich auf der Rentenseite durch den Einsatz von Derivaten (Zinsterminkontrakte) um 37,9 Prozentpunkte. Auf Wertpapiersebene entfiel der größte Teil der Investitionen auf Anleihen aus Europa, gefolgt von den USA. Engagements erfolgten vorwiegend in Staatsanleihen, Unternehmensanleihen und Anleihen halbstaatlicher Emittenten (z.B. Länderschatzanweisungen). Der Anteil an Unternehmensanleihen wurde im Laufe des Berichtshalbjahrs zulasten von Staatsanleihen erhöht.

Der Aktienanteil umfasste zum Stichtag 16,1 Prozent des Fondsvermögens (inkl. Aktienfonds und

Wichtige Kennzahlen Deka-Stiftungen Balance

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Performance*	-0,2%	-1,3%	1,1%
ISIN	DE0005896864		
* p.a. / Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.			

Fondsstruktur Deka-Stiftungen Balance



A	Verzinsliche Wertpapiere	64,6%
B	Wertpapiere mit besonderer Ausstattung	9,1%
C	Aktien	8,8%
D	Aktienfonds	7,3%
E	Rentenfonds	2,0%
F	Barreserve, Sonstiges	8,2%

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

aktienartigen Genussscheinen), wobei auf Länderebene die größten Positionen zuletzt auf Deutschland und die USA entfielen. Die Branchengewichtungen ergaben sich implizit aus der Länderallokation und der Einzeltitelselektion. Der wirtschaftliche Investitionsgrad wurde über den Einsatz von Optionen und Futures auf Aktienindizes um 10,3 Prozentpunkte erhöht. Währungsrisiken wurden weitgehend über Devisentermingeschäfte abgesichert.

Das Sondervermögen Deka-Stiftungen Balance umfasste zuletzt ein Fondsvolumen von rund 1,7 Mrd. Euro und verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertminderung um 0,2 Prozent. Der Anteilpreis notierte zum Stichtag bei 56,96 Euro.

Deka-Stiftungen Balance

Vermögensübersicht zum 31. August 2017.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	144.752.673,60	8,57
Belgien	2.473.007,77	0,15
Bermuda	536.675,30	0,03
Deutschland	14.695.661,82	0,88
Finnland	1.919.100,15	0,11
Frankreich	10.309.945,16	0,61
Großbritannien	21.886.161,78	1,31
Irland	309.525,21	0,02
Italien	3.452.886,94	0,20
Japan	13.660.236,70	0,79
Niederlande	4.891.648,86	0,29
Österreich	290.390,87	0,02
Portugal	788.301,36	0,05
Schweiz	21.627.820,05	1,27
Spanien	11.960.260,51	0,71
USA	35.951.051,12	2,13
2. Anleihen	1.210.525.783,29	71,93
Australien	29.778.375,30	1,77
Belgien	2.055.900,00	0,12
Dänemark	7.178.969,35	0,43
Deutschland	552.831.955,25	32,83
Finnland	109.271.035,00	6,49
Frankreich	30.005.836,14	1,79
Großbritannien	68.264.507,19	4,07
Italien	601.754,49	0,04
Japan	9.600.736,78	0,57
Kaiman-Inseln	1.686.412,38	0,10
Kanada	8.985.053,09	0,54
Luxemburg	2.352.496,19	0,14
Mexiko	3.753.274,41	0,22
Neuseeland	9.279.863,73	0,55
Niederlande	126.961.206,49	7,56
Norwegen	3.227.723,83	0,20
Österreich	3.508.849,00	0,21
Schweden	23.717.543,59	1,40
Schweiz	2.114.481,26	0,13
Spanien	7.368.094,96	0,43
Tschechische Republik	2.977.887,50	0,18
USA	205.003.827,36	12,16
3. Investmentanteile	155.777.992,00	9,26
Deutschland	68.364.600,00	4,07
Irland	21.226.125,00	1,26
Luxemburg	66.187.267,00	3,93
4. Sonstige Wertpapiere	3.122.044,14	0,19
Schweiz	3.122.044,14	0,19
5. Derivate	16.734.869,24	0,99
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	152.289.160,29	9,05
7. Sonstige Vermögensgegenstände	27.061.233,22	1,61
II. Verbindlichkeiten	-26.891.937,70	-1,60
III. Rückstellungen	-6.163,20	-0,00
IV. Fondsvermögen	1.683.365.654,88	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	144.752.673,60	8,57
CHF	21.355.562,65	1,25
EUR	50.781.203,44	3,02
GBP	22.695.094,48	1,36
JPY	13.660.236,70	0,79
USD	36.260.576,33	2,15
2. Anleihen	1.210.525.783,29	71,93
EUR	938.073.032,00	55,72
GBP	24.783.726,89	1,47
USD	247.669.024,40	14,74
3. Investmentanteile	155.777.992,00	9,26
EUR	155.777.992,00	9,26
4. Sonstige Wertpapiere	3.122.044,14	0,19
CHF	3.122.044,14	0,19
5. Derivate	16.734.869,24	0,99
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	152.289.160,29	9,05
7. Sonstige Vermögensgegenstände	27.061.233,22	1,61
II. Verbindlichkeiten	-26.891.937,70	-1,60
III. Rückstellungen	-6.163,20	-0,00
IV. Fondsvermögen	1.683.365.654,88	100,00

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

Deka-Stiftungen Balance

Vermögensaufstellung zum 31. August 2017.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								1.144.562.670,23	67,96
Aktien								144.752.673,60	8,57
EUR								50.781.203,44	3,02
IT0001233417	A2A S.p.A. Azioni nom.	STK		1.142.813	930.490	190.811	EUR 1,396	1.595.366,95	0,09
ES0111845014	Abertis Infraestructuras S.A. Acciones Nom.	STK		92.569	47.756	46.108	EUR 16,940	1.568.118,86	0,09
ES0105046009	AENA S.A. Acciones Port.	STK		6.279	9.091	9.101	EUR 162,150	1.018.139,85	0,06
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		5.433	5.433	0	EUR 180,450	980.384,85	0,06
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port.	STK		34.180	24.536	13.509	EUR 51,730	1.768.131,40	0,11
DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien	STK		13.696	16.055	2.359	EUR 81,870	1.121.291,52	0,07
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien	STK		20.089	12.996	3.350	EUR 89,070	1.789.327,23	0,11
BE0974268972	bpost S.A. Actions Nom. Compartm. A	STK		12.642	12.642	0	EUR 23,465	296.644,53	0,02
FR0000121261	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom.	STK		16.082	8.681	2.780	EUR 115,450	1.856.666,90	0,11
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien	STK		10.639	10.639	0	EUR 66,330	705.684,87	0,04
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK		49.587	56.524	6.937	EUR 34,885	1.729.842,50	0,10
FI0009007884	Elisa Oyi Reg.Shares Cl.A	STK		26.495	33.432	34.287	EUR 36,260	960.708,70	0,06
ES0130670112	Endesa S.A. Acciones Port.	STK		77.385	44.281	13.774	EUR 20,370	1.576.332,45	0,09
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom. ¹⁾	STK		365.294	328.339	64.322	EUR 5,085	1.857.519,99	0,11
PTGALOAM0009	Galp Energia SGPS S.A. Açções Nom.	STK		56.876	56.876	0	EUR 13,860	788.301,36	0,05
BE0003797140	Groupe Bruxelles Lambert SA(GBL) Act.au Porteur	STK		18.513	13.230	3.176	EUR 85,380	1.580.639,94	0,09
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK		9.113	2.968	1.686	EUR 102,350	932.715,55	0,06
NL0000008977	Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder	STK		8.087	3.909	0	EUR 82,510	667.258,37	0,04
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien	STK		18.846	12.558	3.196	EUR 112,700	2.123.944,20	0,13
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port. ¹⁾	STK		270.826	318.541	47.715	EUR 6,877	1.862.470,40	0,11
FR0000120859	IMÉRY S.A. Actions Port.	STK		3.383	3.383	0	EUR 73,870	249.902,21	0,01
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. ¹⁾	STK		40.998	29.832	7.496	EUR 32,865	1.347.399,27	0,08
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen aan toonder	STK		10.567.694	10.567.844	0,15	EUR 64,230	678.762,99	0,04
FR0010307819	Legrand S.A. Actions au Porteur ¹⁾	STK		9.565	9.565	0	EUR 59,290	567.108,85	0,03
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port. ¹⁾	STK		15.124	8.188	2.576	EUR 177,300	2.681.485,20	0,16
ES0176252718	Meliá Hotels International Acciones Port.	STK		61.360	61.360	0	EUR 12,410	761.477,60	0,05
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		6.235	14.886	8.651	EUR 92,670	577.797,45	0,03
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		13.308	7.708	2.032	EUR 174,150	2.317.588,20	0,14
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien	STK		6.118	20.721	14.603	EUR 47,465	290.390,87	0,02
FI0009014377	Orion Corp. Reg.Shares Cl.B	STK		5.691	0	5.309	EUR 39,470	224.623,77	0,01
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. Acciones Port.(C.R.) ¹⁾	STK		7.199	19.081	11.882	EUR 113,450	816.762,55	0,05
NL0006144495	Relx N.V. Aandelen op naam	STK		124.046	93.617,1	18.733,1	EUR 17,500	2.170.805,00	0,13
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK		144.131	157.877,029	13.746,029	EUR 14,280	2.058.190,68	0,12
FR0013269123	Rubis S.C.A. Actions Port. Nouv.	STK		286	286	0	EUR 54,660	15.632,76	0,00
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. ¹⁾	STK		21.789	15.022	7.939	EUR 81,250	1.770.356,25	0,11
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK		27.495	20.328	4.876	EUR 87,910	2.417.085,45	0,14
FR0010411983	SCOR SE Actions au Porteur	STK		6.207	6.207	0	EUR 35,365	219.510,56	0,01
FR0000121220	Sodexo S.A. Actions Port.	STK		7.906	9.981	9.912	EUR 98,080	775.420,48	0,05
BE0003470755	Solvay S.A. Actions au Porteur A	STK		4.871	4.871	0	EUR 122,300	595.723,30	0,04
FR0000120271	Total S.A. Actions au Porteur ¹⁾	STK		31.339	7.044,58	5.442,58	EUR 43,305	1.357.135,40	0,08
FI0009005987	UPM Kymmene Corp. Reg.Shares	STK		33.536	33.536	0	EUR 21,880	733.767,68	0,04
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		37.900	24.909	6.491	EUR 36,275	1.374.822,50	0,08
CHF								21.355.562,65	1,25
CH0012221716	ABB Ltd. Namens-Aktien	STK		31.207	31.207	0	CHF 22,210	604.853,32	0,04
CH0012138605	Adecco Group AG Namens-Aktien ¹⁾	STK		6.379	6.379	0	CHF 69,400	386.332,78	0,02
CH0012410517	Bâloise Holding AG Namens-Aktien	STK		11.627	1.462	1.740	CHF 152,900	1.551.403,08	0,09
CH0009002962	Barry Callebaut AG Namens-Aktien	STK		153	0	0	CHF 1.382,000	184.522,34	0,01
CH0001752309	Fischer AG, Georg Namens-Aktien	STK		1.791	430	230	CHF 1.112,000	1.738.000,37	0,10
CH0319416936	Flughafen Zürich AG Namens-Aktien	STK		2.280	2.280	0	CHF 232,600	462.800,74	0,03
CH0030170408	Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.)	STK		5.234	0	959	CHF 437,900	2.000.129,68	0,12
CH0012271687	Helvetia Holding AG Namens-Aktien	STK		1.618	1.161	0	CHF 548,500	774.470,07	0,05
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG Namens-Aktien	STK		10.144	0	8.515	CHF 172,000	1.522.604,74	0,09
CH0012214059	LafargeHolcim Ltd. Namens-Aktien ¹⁾	STK		6.704	6.704	0	CHF 56,550	330.838,55	0,02
CH0013841017	Lonza Group AG Namens-Aktien ¹⁾	STK		2.740	0	4.519	CHF 243,800	582.953,29	0,03
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien ¹⁾	STK		34.063	0	42.299	CHF 81,750	2.430.077,62	0,14
CH0024638196	Schindler Holding AG Inhaber-Partizipationsschein	STK		9.791	2.802	1.615	CHF 205,800	1.758.417,15	0,10
CH0002497458	SGS S.A. Namens-Aktien	STK		473	0	0	CHF 2.142,000	884.158,44	0,05
CH0000587979	Sika AG Inhaber-Aktien	STK		69	0	0	CHF 6.760,000	407.047,67	0,02
CH0012280076	Straumann Holding AG Namens-Aktien ¹⁾	STK		1.117	1.117	0	CHF 617,500	601.921,18	0,04
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien	STK		754	0	0	CHF 345,700	227.467,95	0,01
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien	STK		22.132	0	4.089	CHF 87,000	1.680.309,97	0,10
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien ¹⁾	STK		4.776	0	909	CHF 482,100	2.009.328,48	0,12
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK		4.851	0	871	CHF 287,700	1.217.925,23	0,07
GBP								22.695.094,48	1,36
GB0002162385	Aviva PLC Reg.Shares	STK		51.458	51.458	0	GBP 5,235	292.324,24	0,02
GB0031215220	Carnival PLC Reg.Shares	STK		30.802	0	5.276	GBP 53,750	1.796.605,07	0,11
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien ¹⁾	STK		9.464	0	7.594	GBP 26,510	272.257,40	0,02
GB0002374006	Diageo PLC Reg.Shares	STK		93.992	56.324	15.857	GBP 25,775	2.628.964,97	0,16
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares ¹⁾	STK		147.069	0	0	GBP 3,806	607.414,50	0,04
GB00B19NLV48	Experian PLC Reg.Shares ¹⁾	STK		33.461	0	0	GBP 15,300	555.553,11	0,03
JE00BFNVV485	Ferguson PLC Reg.Shares	STK		11.630	11.630	0	GBP 45,830	578.395,37	0,03
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC Reg.Shares	STK		136.767	0	23.700	GBP 15,270	2.266.290,57	0,13
BMG4593F1389	Hiscox Ltd. Reg.Shares	STK		38.457	20.774	0	GBP 12,860	536.675,30	0,03
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Reg.Shares ¹⁾	STK		61.873	0	0	GBP 7,566	507.998,87	0,03
GB00BMJ6DW54	Informa PLC Reg.Shares	STK		151.913	100.533	26.668	GBP 6,830	1.125.928,67	0,07
GB0031638363	Intertek Group PLC Reg.Shares	STK		8.173	8.173	0	GBP 51,000	452.321,17	0,03

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
GB00B1CRLC47	Mondi PLC Reg.Shares	STK	28.770	28.770	0	0	GBP 20,990	655.311,12	0,04
GB00BDR05C01	National Grid PLC Reg.Shares	STK	144.923	144.923	144.923,166	0,166	GBP 9,695	1.524.685,83	0,09
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares	STK	33.731	33.731	0	5.654	GBP 73,090	2.675.361,13	0,16
GB00B2B0DGG97	Relx PLC Reg.Shares	STK	133.417	133.417	43.379	19.641	GBP 16,730	2.422.157,32	0,14
GB00BKMKMR23	RSA Insurance Group PLC Reg.Shares	STK	184.089	184.089	184.089	0	GBP 6,710	1.340.434,49	0,08
GB0007908733	SSE PLC Shares	STK	60.891	60.891	38.169	10.516	GBP 14,210	938.949,90	0,06
GB0001638955	Wetherspoon (J D) Reg.Shares	STK	8.833	8.833	0	0	GBP 10,880	104.287,52	0,01
GB0006043169	Wm.Morrison Supermarkets PLC Reg.Shares ¹⁾	STK	270.518	270.518	270.518	0	GBP 2,436	715.103,14	0,04
JE00B8KF9B49	WPP PLC Reg.Shares	STK	45.366	45.366	18.965	0	GBP 14,180	698.074,79	0,04
JPY									0,79
JP3429800000	ANA Holdings Inc. Reg.Shares	STK	346.000	346.000	346.000	0	JPY 407,800	1.073.974,73	0,06
JP3937200008	Azbil Corp. Reg.Shares	STK	10.800	10.800	10.800	0	JPY 4.580,000	376.495,66	0,02
JP3475350009	Daiichi Sankyo Co. Ltd. Reg.Shares	STK	46.600	46.600	46.600	0	JPY 2.599,000	921.855,69	0,05
JP3486800000	Daito Trust Construction Co. Ltd. Reg.Shares	STK	6.200	6.200	6.200	0	JPY 19.485,000	919.523,52	0,05
JP3771800004	Hamamatsu Photonics K.K. Reg.Shares	STK	19.500	19.500	19.500	0	JPY 3.405,000	505.385,14	0,03
JP3791200003	Hitachi Transport System Ltd. Reg.Shares	STK	11.500	11.500	11.500	0	JPY 2.657,000	232.573,45	0,01
JP3143600009	ITOCHU Corp. Reg.Shares	STK	33.300	33.300	33.300	0	JPY 1.796,000	455.219,97	0,03
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares	STK	35.900	35.900	35.900	0	JPY 2.967,000	810.742,12	0,05
JP3469000008	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp. Reg.Shares	STK	42.300	42.300	42.300	0	JPY 2.700,000	869.310,40	0,05
JP3165650007	NTT Docomo Inc. Reg.Shares	STK	61.400	71.700	71.700	10.300	JPY 2.553,500	1.193.369,61	0,07
JP3180400008	Osaka Gas Co. Ltd. Reg.Shares	STK	255.000	255.000	255.000	0	JPY 430,100	834.796,01	0,05
JP3421800008	Secom Co. Ltd. Reg.Shares	STK	6.200	6.200	6.200	0	JPY 8.162,000	385.175,83	0,02
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares ¹⁾	STK	28.100	28.100	28.100	0	JPY 1.904,000	407.233,98	0,02
JP3358800005	Shimizu Corp. Reg.Shares	STK	106.000	106.000	106.000	0	JPY 1.136,000	916.547,42	0,05
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	6.000	6.000	6.000	0	JPY 9.724,000	444.085,86	0,03
JP3404600003	Sumitomo Corp. Reg.Shares	STK	36.600	36.600	36.600	0	JPY 1.556,500	433.611,66	0,03
JP3443600006	Taisei Corp. Reg.Shares	STK	139.000	139.000	139.000	0	JPY 1.103,000	1.166.973,66	0,07
JP3597800006	Tobu Railway Co. Ltd. Reg.Shares	STK	143.000	143.000	143.000	0	JPY 608,000	661.775,00	0,04
JP3629000005	Toppan Printing Co. Ltd. Reg.Shares	STK	67.000	67.000	67.000	0	JPY 1.101,000	561.478,15	0,03
JP3621000003	Toray Industries Inc. Reg.Shares	STK	61.500	118.000	118.000	56.500	JPY 1.047,000	490.108,84	0,03
USD									2,15
US88579Y1010	3M Co. Reg.Shares	STK	5.900	5.900	0	1.000	USD 203,690	1.010.783,46	0,06
US00724F1012	Adobe Systems Inc. Reg.Shares	STK	1.800	1.800	0	0	USD 153,670	232.647,29	0,01
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares	STK	20.500	20.500	2.300	3.500	USD 82,060	1.414.887,09	0,08
IE00BFT3W74	Allegion PLC Reg.Shares	STK	4.700	4.700	4.700	0	USD 78,300	309.525,21	0,02
US0236081024	Ameren Corp. Reg.Shares	STK	15.400	15.400	15.400	0	USD 60,300	781.042,10	0,05
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares	STK	20.200	20.200	20.200	0	USD 37,670	640.005,05	0,04
US0536111091	Avery Dennison Corp. Reg.Shares	STK	12.000	12.000	0	0	USD 94,030	949.039,07	0,06
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares	STK	6.200	4.600	4.600	1.000	USD 197,900	1.031.986,21	0,06
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares	STK	19.700	19.700	0	0	USD 31,990	530.050,04	0,03
US1258961002	CMS Energy Corp. Reg.Shares	STK	11.500	11.500	0	0	USD 48,570	469.788,47	0,03
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares	STK	25.600	25.600	0	4.500	USD 70,950	1.527.667,27	0,09
US2091151041	Consolidated Edison Inc. Reg.Shares	STK	1.700	1.700	0	7.400	USD 84,080	120.220,36	0,01
US2283681060	Crown Holdings Inc. Reg.Shares	STK	15.400	15.400	0	0	USD 58,080	752.287,31	0,04
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares	STK	19.600	19.600	0	14.500	USD 82,880	1.366.287,90	0,08
US2333311072	DTE Energy Co. Reg.Shares	STK	17.700	17.700	3.300	3.100	USD 111,970	1.666.906,93	0,10
US26441C2044	Duke Energy Corp. (New) Reg.Shares New	STK	9.515	9.515	0	0	USD 87,280	698.489,59	0,04
US2788651006	Ecolab Inc. Reg.Shares	STK	5.000	5.000	0	0	USD 130,980	550.822,15	0,03
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares ¹⁾	STK	22.400	22.400	0	0	USD 34,890	657.332,94	0,04
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares	STK	21.500	21.500	0	3.600	USD 131,070	2.370.162,75	0,14
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares	STK	9.600	9.600	0	0	USD 77,410	625.035,54	0,04
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK	32.400	32.400	5.900	4.600	USD 63,120	1.720.079,06	0,10
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK	1.755	1.755	0	1.400	USD 598,400	883.293,66	0,05
US65339F1012	Nextera Energy Inc. Reg.Shares	STK	11.700	11.700	2.300	2.000	USD 150,620	1.482.193,53	0,09
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares	STK	20.300	20.300	0	3.500	USD 115,150	1.966.058,29	0,12
US69331C1080	PG & E Corp. Reg.Shares	STK	13.300	13.300	0	0	USD 70,110	784.274,36	0,05
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares	STK	15.800	15.800	0	2.700	USD 107,260	1.425.382,06	0,08
US8718291078	Sysco Corp. Reg.Shares	STK	22.900	22.900	22.900	0	USD 52,710	1.015.231,09	0,06
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK	13.500	13.500	8.800	0	USD 82,310	934.593,55	0,06
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK	18.600	18.600	0	10.000	USD 90,070	1.409.060,10	0,08
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares	STK	3.900	3.900	0	0	USD 104,400	342.453,43	0,02
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK	20.100	20.100	0	3.400	USD 91,870	1.553.124,19	0,09
US8425871071	The Southern Co. Reg.Shares	STK	20.700	20.700	0	0	USD 48,210	839.351,53	0,05
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares	STK	3.700	3.700	0	0	USD 102,870	320.130,37	0,02
US8725401090	TJX Companies Inc. Reg.Shares	STK	10.200	10.200	0	5.600	USD 72,050	618.116,83	0,04
US94106L1098	Waste Management Inc. (Del.) Reg.Shares	STK	26.300	26.300	5.200	3.500	USD 76,950	1.702.161,57	0,10
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares	STK	24.400	24.400	0	32.400	USD 76,020	1.560.105,98	0,09
Verzinsliche Wertpapiere									59,20
EUR									52,06
XS0821175717	3,3750 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 12/19	EUR	3.000.000	3.000.000	0	0	% 106,756	3.202.680,00	0,19
FR0011266527	3,1250 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 12/24	EUR	2.000.000	2.000.000	0	0	% 116,915	2.338.300,00	0,14
FR0013182821	0,5000 % Air Liquide Finance MTN 16/22	EUR	800.000	800.000	0	0	% 101,517	812.132,00	0,05
XS0809847667	2,6250 % Akzo Nobel Sweden Finance AB MTN 12/22	EUR	3.000.000	3.000.000	0	0	% 111,155	3.334.635,00	0,20
DE000A1G0RU9	3,5000 % Allianz Finance II B.V. MTN 12/22 ¹⁾	EUR	4.000.000	4.000.000	0	0	% 115,950	4.637.980,00	0,28
FR0010870949	4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20 ¹⁾	EUR	1.000.000	1.000.000	0	0	% 111,416	1.114.160,00	0,07
XS0604462704	4,6250 % Amcor Ltd. MTN 11/19	EUR	2.400.000	2.400.000	0	0	% 107,636	2.583.252,00	0,15
XS1422919594	0,6250 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) MTN 16/21 ¹⁾	EUR	2.000.000	2.000.000	0	0	% 101,778	2.035.550,00	0,12
XS0896144655	2,5000 % Atlas Copco AB MTN 13/23 ¹⁾	EUR	500.000	500.000	0	2.500.000	% 111,591	557.952,50	0,03

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
FR0010491720	5,6250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 07/22 ¹⁾		EUR	2.150.000	0	0	% 125,929	2.707.462,75	0,16
XS1107731702	1,3750 % Bank of America Corp. MTN 14/21 ¹⁾		EUR	1.500.000	0	0	% 104,168	1.562.512,50	0,09
DE000BLB03H7	1,0000 % Bayerische Landesbank Öff.-Pfe. 13/22		EUR	50.000.000	0	0	% 104,476	52.238.000,00	3,10
XS0526811384	3,6250 % BG Energy Capital PLC MTN 10/19		EUR	900.000	0	0	% 107,048	963.427,50	0,06
XS0787785715	2,1250 % BHP Billiton Finance Ltd. MTN 12/18		EUR	1.600.000	0	0	% 102,840	1.645.432,00	0,10
XS0834386228	2,2500 % BHP Billiton Finance Ltd. MTN 12/20		EUR	1.000.000	0	0	% 107,131	1.071.310,00	0,06
XS1040506112	2,1770 % BP Capital Markets PLC MTN 14/21		EUR	3.000.000	0	0	% 108,401	3.252.030,00	0,19
XS0615238044	4,6250 % Brambles Finance PLC Bonds 11/18		EUR	500.000	0	2.500.000	% 102,946	514.727,50	0,03
DE000A1A6K25	3,5000 % Bundesländer Ländersch. Nr.32 09/19 ¹⁾		EUR	19.000.000	0	0	% 108,265	20.570.350,00	1,22
DE000A1PGZ58	1,7500 % Bundesländer Ländersch. Nr.40 12/22		EUR	61.600.000	0	0	% 108,834	67.041.436,00	3,98
DE000A14J421	0,5000 % Bundesländer Ländersch. Nr.47 15/25		EUR	30.000.000	0	0	% 101,500	30.450.000,00	1,81
DE0001135416	2,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 10/20 ¹⁾		EUR	66.000.000	0	6.000.000	% 108,862	71.848.920,00	4,28
DE0001135424	2,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 10/21 ¹⁾		EUR	10.000.000	0	0	% 110,531	11.053.100,00	0,66
DE0001135465	2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 11/22 ¹⁾		EUR	30.000.000	0	30.000.000	% 110,861	33.258.300,00	1,98
DE0001135044	6,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 97/27 ¹⁾		EUR	30.000.000	30.000.000	0	% 160,476	48.142.800,00	2,86
XS0800572454	2,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 12/19		EUR	2.200.000	0	0	% 105,037	2.310.803,00	0,14
XS0458257796	5,0000 % CEZ AS MTN 09/21		EUR	2.500.000	0	0	% 119,116	2.977.887,50	0,18
XS1128148845	1,3750 % Citigroup Inc. MTN 14/21 ¹⁾		EUR	1.400.000	0	0	% 104,562	1.463.868,00	0,09
XS1377682676	1,8750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 16/24 ¹⁾		EUR	5.000.000	0	0	% 107,679	5.383.925,00	0,32
DE000A1TNJ97	2,0000 % Daimler AG MTN 13/21 ¹⁾		EUR	3.000.000	0	0	% 106,902	3.207.045,00	0,19
DE000A169NB4	0,7500 % Daimler AG MTN 16/23 ¹⁾		EUR	2.350.000	0	2.500.000	% 101,226	2.378.799,25	0,14
FR0010967216	3,6000 % Danone S.A. MTN 10/20		EUR	3.000.000	0	0	% 111,560	3.346.785,00	0,20
XS0795877454	2,9500 % Deutsche Post Finance B.V. MTN 12/22		EUR	3.000.000	0	0	% 113,418	3.402.525,00	0,20
XS0525787874	4,2500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 10/22		EUR	3.000.000	0	0	% 119,082	3.572.460,00	0,21
XS0942094805	2,5000 % Essity AB MTN 13/23		EUR	2.000.000	0	0	% 109,507	2.190.130,00	0,13
XS0482908091	4,7500 % Experian Finance PLC MTN 10/20		EUR	600.000	0	0	% 111,591	669.543,00	0,04
XS0629937409	4,0000 % Fortum Oyj MTN 11/21		EUR	4.000.000	0	0	% 113,984	4.559.360,00	0,27
XS0834382151	2,7500 % Hammerson PLC Bonds 12/19		EUR	3.000.000	0	0	% 105,794	3.173.820,00	0,19
XS0811554962	2,1250 % Heineken N.V. MTN 12/20		EUR	3.000.000	0	0	% 106,344	3.190.320,00	0,19
XS0911691003	2,0000 % Heineken N.V. MTN 13/21		EUR	2.900.000	0	0	% 106,904	3.100.201,50	0,18
XS1019821732	3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. MTN 14/24 ¹⁾		EUR	500.000	0	2.500.000	% 114,293	571.462,50	0,03
XS1379182006	1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22 ¹⁾		EUR	2.600.000	0	0	% 104,971	2.729.233,00	0,16
XS1191116174	1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22		EUR	3.000.000	0	0	% 105,792	3.173.745,00	0,19
XS0466670345	4,8750 % Investor AB MTN 09/21		EUR	3.400.000	0	0	% 120,145	4.084.913,00	0,24
XS0984367077	2,6250 % JPMorgan Chase & Co. MTN 13/21		EUR	500.000	0	0	% 108,805	544.025,00	0,03
BE6286238561	1,0000 % KBC Groep N.V. MTN 16/21		EUR	2.000.000	0	0	% 102,795	2.055.900,00	0,12
FR0012199008	1,3750 % Kering S.A. MTN 14/21 ¹⁾		EUR	2.800.000	0	0	% 105,236	2.946.594,00	0,18
FR0011019397	4,7500 % Klépierre S.A. MTN 11/21		EUR	3.700.000	0	0	% 116,747	4.319.639,00	0,26
XS0752092311	4,2500 % Kon. KPN N.V. MTN 12/22 ¹⁾		EUR	3.000.000	0	0	% 117,051	3.511.530,00	0,21
NL0010060257	2,2500 % Königreich Niederlande Anl. 12/22 ¹⁾		EUR	45.000.000	0	0	% 112,518	50.632.875,00	3,01
NL0010418810	1,7500 % Königreich Niederlande Anl. 13/23 ¹⁾		EUR	35.000.000	0	0	% 111,129	38.894.975,00	2,31
DE000A1R07S9	2,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 13/23		EUR	30.000.000	0	0	% 112,767	33.830.100,00	2,01
DE000A161WS6	0,7500 % Land Berlin Landessch. Ausg.474 15/23 ¹⁾		EUR	20.000.000	0	0	% 103,859	20.771.800,00	1,23
DE000A11QER4	1,6250 % Land Brandenburg MTN Landessch. 14/24		EUR	5.000.000	0	0	% 109,480	5.474.000,00	0,33
DE000A0Z1QS1	2,7500 % Land Hessen Schatzanw. 10/20		EUR	42.500.000	0	0	% 109,472	46.525.600,00	2,76
DE000A1RQB0C	1,7500 % Land Hessen Schatzanw. S.1304 13/23		EUR	15.000.000	0	0	% 109,449	16.417.350,00	0,98
DE000NRW23J9	1,8750 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1295 14/24		EUR	5.000.000	0	0	% 110,929	5.546.450,00	0,33
DE000LB1GYE0	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. BEI 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,840	4.073.600,00	0,24
DE000LB1H537	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. DBK 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 99,900	3.996.000,00	0,24
DE000LB1HH11	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. NOA3 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 102,515	4.100.600,00	0,24
DE000LB1HH94	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. SNW 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,940	4.077.600,00	0,24
DE000LB1H545	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. VVU 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 102,300	4.092.000,00	0,24
XS1109743960	1,0000 % Macquarie Bank Ltd. MTN 14/19		EUR	2.000.000	0	0	% 102,139	2.042.770,00	0,12
XS1169353338	1,1250 % Macquarie Bank Ltd. MTN 15/22		EUR	3.000.000	0	0	% 103,165	3.094.935,00	0,18
XS1237271009	1,1250 % McDonald's Corp. MTN 15/22 ¹⁾		EUR	4.000.000	0	0	% 103,512	4.140.480,00	0,25
XS1403264374	1,0000 % McDonald's Corp. MTN 16/23		EUR	500.000	0	2.500.000	% 102,290	511.450,00	0,03
XS0497186758	4,5000 % Merck Financial Services GmbH MTN 10/20 ¹⁾		EUR	500.000	0	2.500.000	% 111,832	559.160,00	0,03
XS1003251441	2,3750 % Mondelez International Inc. Notes 13/21		EUR	4.500.000	0	2.500.000	% 107,480	4.836.600,00	0,29
XS1050547857	2,3750 % Morgan Stanley MTN 14/21		EUR	4.500.000	0	0	% 107,770	4.849.627,50	0,29
XS1180256528	1,7500 % Morgan Stanley MTN 15/25		EUR	500.000	0	2.500.000	% 103,988	519.940,00	0,03
XS0813400305	2,7500 % National Australia Bank Ltd. MTN 12/22		EUR	3.000.000	0	0	% 112,558	3.376.725,00	0,20
XS1188094673	0,7500 % National Grid North Amer. Inc. MTN 15/22		EUR	2.000.000	0	0	% 101,742	2.034.830,00	0,12
XS1204254715	1,0000 % NN Group N.V. MTN 15/22 ¹⁾		EUR	4.500.000	2.000.000	0	% 103,275	4.647.375,00	0,28
XS0690406243	4,2500 % OMV AG MTN 11/21		EUR	1.100.000	0	0	% 116,869	1.285.559,00	0,08
XS0834367863	2,6250 % OMV AG MTN 12/22 ¹⁾		EUR	2.000.000	0	0	% 111,165	2.223.290,00	0,13
XS0541498837	3,5000 % Optus Finance Pty Ltd. MTN 10/20		EUR	2.000.000	0	0	% 110,253	2.205.060,00	0,13
XS1075312626	1,6250 % PGE Sweden AB (Publ) MTN 14/19		EUR	2.500.000	0	0	% 102,884	2.572.100,00	0,15

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
XS0832466931	3,3750 % Rentokil Initial PLC MTN 12/19		EUR	3.000.000	0	0	% 107,117	3.213.510,00	0,19
FI4000006176	4,0000 % Republik Finnland Bonds 09/25 ¹⁾		EUR	50.000.000	0	0	% 129,385	64.692.500,00	3,84
FI4000020961	3,5000 % Republik Finnland Notes 11/21 ¹⁾		EUR	35.000.000	0	0	% 114,341	40.019.175,00	2,38
XS0863129135	2,0000 % Rio Tinto Finance PLC MTN 12/20		EUR	3.000.000	0	0	% 105,508	3.165.225,00	0,19
XS0969523843	3,2500 % Scentre Group MTN 13/23 Reg.S ¹⁾		EUR	2.500.000	0	2.500.000	% 114,262	2.856.550,00	0,17
FR0011561000	2,5000 % Schneider Electric SE MTN 13/21		EUR	3.000.000	0	0	% 109,407	3.282.195,00	0,19
XS1292484323	1,2500 % Shell International Finance BV MTN 15/22		EUR	1.200.000	0	0	% 105,220	1.262.634,00	0,08
XS1109741246	1,5000 % Sky PLC MTN 14/21 ¹⁾		EUR	3.000.000	0	0	% 104,490	3.134.700,00	0,19
XS1287779208	1,7500 % SSE PLC MTN 15/23 ¹⁾		EUR	700.000	2.000.000	2.500.000	% 106,940	748.576,50	0,04
XS0798790027	2,7500 % Telenor ASA MTN 12/22 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 111,848	1.118.480,00	0,07
XS0545428285	3,8750 % Telia Company AB MTN 10/25		EUR	200.000	0	2.500.000	% 122,420	244.839,00	0,01
XS0706229555	3,7500 % Telstra Corp. Ltd. FLR MTN 11/22		EUR	1.000.000	0	0	% 115,949	1.159.485,00	0,07
XS1032978345	2,5000 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN S.F 14/21		EUR	10.900.000	0	0	% 108,600	11.837.400,00	0,70
XS1375980197	0,6250 % The Toronto-Dominion Bank MTN 16/21		EUR	3.000.000	0	0	% 102,109	3.063.270,00	0,18
XS1107890763	1,0000 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 14/21		EUR	1.100.000	0	0	% 103,756	1.141.310,50	0,07
XS1171489393	0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 15/22 ¹⁾		EUR	2.200.000	0	0	% 102,648	2.258.245,00	0,13
XS0210237011	4,2500 % United Utilities Water Ltd. MTN 05/20		EUR	3.500.000	0	0	% 110,124	3.854.322,50	0,23
FR0011689033	3,2500 % Valéo S.A. MTN 14/24		EUR	1.500.000	2.000.000	2.500.000	% 116,926	1.753.882,50	0,10
FR0010830034	4,8750 % Vivendi S.A. MTN 09/19 ¹⁾		EUR	3.000.000	0	0	% 111,156	3.334.680,00	0,20
XS0304458051	5,3750 % Vodafone Group PLC MTN 07/22 ¹⁾		EUR	2.800.000	0	0	% 123,412	3.455.522,00	0,21
XS0479869744	4,6500 % Vodafone Group PLC MTN 10/22 ¹⁾		EUR	5.000.000	0	0	% 118,880	5.943.975,00	0,35
XS0968433135	2,2500 % Wells Fargo & Co. MTN 13/20		EUR	1.500.000	0	0	% 106,747	1.601.205,00	0,10
GBP								24.783.726,89	1,47
GB00BHFH458	2,7500 % Großbritannien Treasury Stock 14/24		GBP	20.000.000	0	0	% 114,194	24.783.726,89	1,47
USD								95.628.728,60	5,67
US002824AW02	4,1250 % Abbott Laboratories Notes 10/20		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 105,595	888.136,59	0,05
US00287YAU38	2,3000 % AbbVie Inc. Notes 16/21		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 100,524	1.690.962,61	0,10
US02364WAV72	5,0000 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 10/20		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 107,555	2.713.865,18	0,16
US03523TBE73	7,7500 % Anheuser-Busch InBev Ww Inc. Notes 11/19		USD	800.000	800.000	0	% 107,943	726.308,09	0,04
US94973VAV72	3,7000 % Anthem Inc. Notes 11/21		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 104,478	1.757.475,08	0,10
US94973VAX55	3,1250 % Anthem Inc. Notes 12/22		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 102,636	2.589.734,64	0,15
US00182EBC21	2,8750 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. MTN 17/22 144A		USD	1.920.000	1.920.000	0	% 101,641	1.641.370,28	0,10
US00182EAY59	2,2500 % ANZ New Zealand (Intl)(Ldn Br.) MTN 16/19 144A		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 100,602	4.230.686,74	0,25
US05964HAC97	3,5000 % Banco Santander S.A. Notes 17/22		USD	1.600.000	1.600.000	0	% 103,022	1.386.386,31	0,08
US172967FF30	5,3750 % Citigroup Inc. Notes 10/20 ¹⁾		USD	776.000	776.000	0	% 108,869	710.562,63	0,04
US172967KE00	2,0500 % Citigroup Inc. Notes 15/18		USD	1.350.000	1.350.000	0	% 100,393	1.139.912,32	0,07
US172967KB60	2,6500 % Citigroup Inc. Notes 15/20		USD	10.000.000	10.000.000	0	% 101,210	8.512.553,09	0,51
US30161MAF05	5,2000 % Exelon Generation Co. LLC Notes 09/19		USD	8.000.000	8.000.000	0	% 106,506	7.166.390,51	0,43
US30161MAR43	3,4000 % Exelon Generation Co. LLC Notes 17/22		USD	1.800.000	1.800.000	0	% 103,475	1.566.550,32	0,09
US42824CAG42	3,6000 % Hewlett Packard Enterprise Co. Notes 16/20		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 103,651	2.179.465,07	0,13
US428236BM44	4,3000 % HP Inc. Notes 11/21		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 106,531	4.480.045,42	0,27
US404280AK50	5,1000 % HSBC Holdings PLC Notes 11/21		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 109,744	2.307.571,81	0,14
US456837AG88	3,1500 % ING Groep N.V. Notes 17/22		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 102,435	2.153.885,78	0,13
US46625HHS22	4,4000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 10/20		USD	700.000	700.000	0	% 106,673	628.042,39	0,04
US46625HJD35	4,5000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 12/22		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 108,818	915.244,54	0,05
US58013MEL46	3,6250 % McDonald's Corp. MTN 11/21		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 105,375	886.282,01	0,05
US585055AV80	4,1250 % Medtronic Inc. Notes 11/21		USD	2.200.000	2.200.000	0	% 106,613	1.972.728,04	0,12
US61747YCM57	5,5000 % Morgan Stanley MTN S.F 10/20		USD	8.000.000	8.000.000	0	% 108,152	7.277.143,70	0,43
US61744YAH18	2,7500 % Morgan Stanley Notes 17/22		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 100,732	847.230,75	0,05
US65557CAD56	4,8750 % Nordea Bank AB MTN 11/21 144A		USD	1.100.000	1.100.000	0	% 108,635	1.005.075,91	0,06
US655664AP58	4,0000 % Nordstrom Inc. Notes 11/21		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 103,622	2.614.626,35	0,16
US655844BJ66	3,0000 % Norfolk Southern Corp. Notes 12/22		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 102,980	866.138,19	0,05
US674599BY08	4,1000 % Occidental Petroleum Corp. Notes 10/21		USD	2.350.000	2.350.000	0	% 106,452	2.104.059,88	0,12
US75625QAC33	2,3750 % Reckitt Benckiser Treas. Serv. Notes 17/22 144A		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 99,930	2.521.468,52	0,15
US824348AT35	2,2500 % Sherwin-Williams Co. Notes 17/20		USD	1.800.000	1.800.000	0	% 100,446	1.520.693,05	0,09
US834423AA33	3,4000 % Solvay Finance (America) LLC Notes 15/20 144A		USD	550.000	550.000	0	% 103,691	479.667,35	0,03
US84265VAD73	5,3750 % Southern Copper Corp. Notes 10/20		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 108,243	2.276.010,35	0,14
US86959LAE39	5,1250 % Svenska Handelsbanken AB MTN 10/20 144A		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 107,932	2.723.365,15	0,16
US87938WAH60	5,8770 % Telefonica Emisiones S.A.U. Notes 09/19		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 107,117	2.252.333,99	0,13
US87938WAP86	5,4620 % Telefonica Emisiones S.A.U. Notes 11/21		USD	1.700.000	1.700.000	0	% 110,245	1.576.319,44	0,09
US260543BX04	8,5500 % The Dow Chemical Co. Notes 09/19		USD	4.000.000	4.000.000	0	% 111,055	3.736.237,86	0,22
US38141GGS75	5,7500 % The Goldman Sachs Group Inc. Notes 12/22		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 113,140	951.595,95	0,06
US89153VAB53	2,8750 % Total Capital Intl S.A. Notes 12/22		USD	2.550.000	2.550.000	0	% 102,779	2.204.352,16	0,13

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
US911308AA21	8,3750 % Utd Parcel Service of Am. Inc. Debts 89/20		USD	200.000	200.000	0	% 116,041	195.198,28	0,01
US92343VBC72	3,5000 % Verizon Communications Inc. Notes 11/21		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 104,291	4.385.844,65	0,26
US98310WAJ71	4,2500 % Wyndham Worldwide Corp. Notes 12/22		USD	4.500.000	4.500.000	0	% 101,648	3.847.207,62	0,23
Andere Wertpapiere								3.122.044,14	0,19
CHF								3.122.044,14	0,19
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine ¹⁾		STK	14.759	820	2.486	CHF 242,400	3.122.044,14	0,19
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								212.465.574,09	12,65
Verzinsliche Wertpapiere								212.465.574,09	12,65
EUR								61.797.535,00	3,66
DE000CE9HW41	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic BSN 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 100,360	4.014.400,00	0,24
DE000CE8RGW9	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic ENI 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,390	4.055.600,00	0,24
DE000CE8RGX7	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic HEN3 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,570	4.062.800,00	0,24
DE000CV0UL81	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic VOW 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 100,260	4.010.400,00	0,24
DE000DK0K2G8	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. DB1 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 100,820	4.032.800,00	0,24
DE000DK0K0F4	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. FME 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 100,690	4.027.600,00	0,24
DE000DK0K2H6	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. LIN 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 98,600	3.944.000,00	0,23
DE000DK0KQT7	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. PSM 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 87,130	3.485.200,00	0,21
DE000DK0LGJ7	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. TKA 17/19		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,830	4.073.200,00	0,24
DE000DK0K6C8	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. UNI3 17/19		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,690	4.067.600,00	0,24
DE000TD8DXK1	4,0000 % HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Aktienanl. ESL 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 98,030	3.921.200,00	0,23
DE000TD3FBL1	4,0000 % HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Aktienanl. UBL 17/19		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 102,040	4.081.600,00	0,24
DE000LB1HRY0	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev. Conv. CBK 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 102,480	4.099.200,00	0,24
DE000LB1JAB0	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev. Conv. IFX 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,820	4.072.800,00	0,24
DE000LB1JAA2	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev. Conv. ORA 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,420	4.056.800,00	0,24
XS0416848520	5,6250 % Statoil ASA MTN 09/21		EUR	1.500.000	0	0	% 119,489	1.792.335,00	0,11
USD								150.668.039,09	8,99
US05253JAK79	2,7000 % Aus. & N.Z.Bkg Gr.Ltd.(NY.Br.) MTN 15/20		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 102,151	4.295.828,25	0,26
US05253JAS06	2,6250 % Aus. & N.Z.Bkg Gr.Ltd.(NY.Br.) MTN 17/22		USD	900.000	900.000	0	% 100,994	764.490,94	0,05
US05946KAD37	3,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Notes 15/20		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 102,395	2.153.055,22	0,13
US06051GEX34	2,6000 % Bank of America Corp. Notes 13/19		USD	2.250.000	2.250.000	0	% 101,000	1.911.340,89	0,11
US06051GFT13	2,6250 % Bank of America Corp. Notes 15/20		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 101,264	851.709,49	0,05
US06367TYL87	2,1000 % Bank of Montreal MTN 17/20		USD	500.000	500.000	0	% 100,491	422.601,88	0,03
US07274EAD58	2,3750 % Bayer US Finance LLC Notes 14/19 144A		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 100,881	4.242.419,78	0,25
US075887BE86	2,6750 % Becton, Dickinson & Co. Notes 14/19		USD	11.000.000	11.000.000	0	% 101,387	9.380.184,20	0,56
US086516AM34	5,0000 % Best Buy Co. Inc. Notes 13/18 ¹⁾		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 102,900	865.465,33	0,05
US101137AM97	2,6500 % Boston Scientific Corp. Notes 13/18		USD	1.900.000	1.900.000	0	% 100,884	1.612.175,45	0,10
US136069TY74	2,5500 % Canadian Imperial Bk of Comm. Notes 17/22		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 100,830	2.120.137,52	0,13
US14042E5V80	2,3500 % Capital One National Assn Notes 15/18		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 100,495	4.226.186,97	0,25
US191241AG32	2,3750 % Coca-Cola FEMSA S.A.B. de C.V. Notes 13/18		USD	1.230.000	1.230.000	0	% 100,472	1.039.409,23	0,06
US233851BE34	2,8750 % Daimler Finance North Amer.LLC Notes 14/21 144A		USD	1.650.000	1.650.000	0	% 102,058	1.416.339,63	0,08
US23636AAH41	2,0000 % Danske Bank AS MTN 16/21 144A		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 99,009	1.665.486,35	0,10
US23341CAA18	2,3750 % DNB Bank ASA MTN 16/21 144A		USD	375.000	375.000	0	% 100,477	316.908,83	0,02
US278642AR47	2,1500 % eBay Inc. Notes 17/20		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 100,330	843.853,82	0,05
US37045VAD29	3,5000 % General Motors Co. Notes 14/18		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 101,669	2.565.347,58	0,15
US380956AF94	3,6250 % Goldcorp Inc. Notes 14/21		USD	1.400.000	1.400.000	0	% 104,201	1.226.976,74	0,07
US418056AT46	3,1500 % Hasbro Inc. Notes 14/21		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 103,165	867.698,39	0,05
US449786BD37	2,5000 % ING Bank N.V. Notes 14/19 144A		USD	500.000	500.000	0	% 101,064	425.013,67	0,03
US46115HAL15	3,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Notes 13/19		USD	700.000	700.000	0	% 102,208	601.754,49	0,04
US48127HAA77	2,2000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 14/19		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 100,784	847.668,11	0,05
US49327M2N31	2,3500 % Key Bank N.A. Notes 16/19		USD	850.000	850.000	0	% 100,930	721.561,67	0,04
US55608JAB44	7,6250 % Macquarie Group Ltd. MTN 09/19 144A		USD	500.000	500.000	0	% 110,041	462.763,36	0,03
US56585AAK88	2,7000 % Marathon Petroleum Corp. Notes 15/18		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 100,848	848.206,40	0,05

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
US571903AM51	3,1250 % Marriott International Inc. Notes S.N 14/21		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 102,531	1.724.731,91	0,10
US579780AH00	3,9000 % McCormick & Co. Inc. Notes 11/21		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 105,671	1.777.551,62	0,11
US620076BD08	3,5000 % Motorola Solutions Inc. Notes 14/21		USD	850.000	850.000	0	% 103,040	736.649,99	0,04
US63254AAW80	2,5000 % Natl Austr.Bank Ltd. (NY Br.)								
	MTN 17/22		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 100,342	4.219.773,75	0,25
US654740AH26	2,3500 % Nissan Motor Acceptance Corp.								
	Notes 14/19 144A		USD	500.000	500.000	0	% 100,780	423.819,34	0,03
US65535HAG48	2,7500 % Nomura Holdings Inc. MTN 14/19		USD	2.300.000	2.300.000	0	% 101,202	1.957.732,45	0,12
US67066GAD60	2,2000 % NVIDIA Corp. Notes 16/21		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 99,999	841.065,65	0,05
US686330AH40	2,9000 % ORIX Corp. Notes 17/22		USD	5.000.000	5.000.000	0	% 101,025	4.248.496,57	0,25
US714264AA62	5,7500 % Pernod-Ricard S.A. Notes 11/21 144A		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 111,543	938.159,72	0,06
US714264AD02	4,4500 % Pernod-Ricard S.A. Notes 11/22 144A		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 107,897	907.494,01	0,05
US74341DAA28	4,8750 % ProLogis Int.Funding II S.A. Notes								
	12/20 144A		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 105,878	1.781.033,69	0,11
US80282KAK25	3,7000 % Santander Holdings USA Inc.								
	Notes 17/22 144A		USD	4.000.000	4.000.000	0	% 101,800	3.424.870,68	0,20
US80281LAC90	2,8750 % Santander UK Group Hldgs PLC								
	MTN 15/20		USD	1.500.000	1.500.000	0	% 101,650	1.282.434,08	0,08
US80283LAM54	3,0500 % Santander UK PLC Notes 13/18		USD	1.500.000	1.500.000	0	% 101,348	1.278.624,00	0,08
US80283LAH69	2,3500 % Santander UK PLC Notes 14/19		USD	1.500.000	1.500.000	0	% 100,829	1.272.069,89	0,08
US806851AC55	3,0000 % Schlumberger Holdings Corp.								
	Notes 15/20 144A		USD	1.450.000	1.450.000	0	% 102,577	1.250.985,53	0,07
US81180WAP68	3,7500 % Seagate HDD Cayman Notes 13/18		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 101,750	855.797,13	0,05
US81180WAU53	4,2500 % Seagate HDD Cayman Notes 17/22 144A		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 98,756	830.615,25	0,05
US82620KAR41	2,7000 % Siemens Finan.maatschappij NV								
	Notes 17/22 144A		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 102,036	2.145.506,54	0,13
US83051GAC24	2,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken								
	MTN 14/19 144A		USD	266.000	266.000	0	% 100,919	225.782,87	0,01
US830505AR41	2,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken								
	Notes 16/21		USD	1.500.000	1.500.000	0	% 101,571	1.281.437,40	0,08
US830505AW36	2,8000 % Skandinaviska Enskilda Banken								
	Notes 17/22		USD	1.500.000	1.500.000	0	% 102,176	1.289.070,19	0,08
US86960BAQ59	1,8750 % Svenska Handelsbanken AB MTN 16/21		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 98,807	2.493.132,60	0,15
US87020PAH01	2,8000 % Swedbank AB MTN 17/22 144A		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 101,959	1.715.109,97	0,10
US874060AC01	2,4500 % Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.								
	Notes 17/22 144A		USD	4.000.000	4.000.000	0	% 100,898	3.394.507,76	0,20
US064159FL54	2,8000 % The Bank of Nova Scotia Notes 14/21		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 102,348	2.152.066,95	0,13
US38148FAB58	2,5500 % The Goldman Sachs Group Inc.								
	Notes 14/19		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 101,170	850.918,88	0,05
US912828KD17	2,7500 % U.S. Treasury Notes 09/19 ¹⁾		USD	25.000.000	0	75.000.000	% 102,090	21.466.387,15	1,28
US912828XB14	2,1250 % U.S. Treasury Notes 15/25 ¹⁾		USD	40.000.000	0	0	% 100,738	33.891.511,33	2,01
US902674XF24	2,2000 % UBS AG (London Branch) Notes								
	17/20 144A		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 100,561	2.114.481,26	0,13
US92343VCC63	3,4500 % Verizon Communications Inc.								
	Notes 14/21		USD	400.000	400.000	0	% 104,399	351.230,92	0,02
US949746RS22	2,5000 % Wells Fargo & Co. Notes 16/21		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 101,109	850.405,82	0,05
Nichtnotierte Wertpapiere								1.372.256,71	0,08
Verzinsliche Wertpapiere								1.372.256,71	0,08
USD								1.372.256,71	0,08
US05579LAA17	2,3500 % BNZ Inter. Fund. Ltd.(Ldn Br.)								
	Notes 14/19 144A		USD	1.621.000	1.621.000	0	% 100,651	1.372.256,71	0,08
Wertpapier-Investmentanteile								155.777.992,00	9,26
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								68.364.600,00	4,07
EUR								68.364.600,00	4,07
DE000ETFL268	Deka MSCI USA UCITS ETF		ANT	3.480.000	1.059.700	0	EUR 19,645	68.364.600,00	4,07
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								32.878.025,00	1,95
EUR								32.878.025,00	1,95
LU0297135021	Deka-OptiRent 1+y CF		ANT	292.900	248.400	0	EUR 112,250	32.878.025,00	1,95
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								54.535.367,00	3,24
EUR								54.535.367,00	3,24
IE0005042456	iShs Core FTSE 100 UCITS ETF Reg.Shares		ANT	2.645.000	0	941.000	EUR 8,025	21.226.125,00	1,26
LU0629460675	UBS ETF-U.E.-MSCI EMU S.R.U.E. Namens-								
	Ant. A-dis		ANT	375.400	375.400	0	EUR 88,730	33.309.242,00	1,98
Summe Wertpapiervermögen ²⁾								1.514.178.493,03	89,95
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
DJ Euro Stoxx 50 Future (SX5E) Sep. 17		XEUR	EUR	Anzahl	1.180			-1.271.143,03	-0,07
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 17		IFEU	GBP	Anzahl	165			-483.800,00	-0,03
OMX Index Future (O30) Sep. 17		XNDX	SEK	Anzahl	203			8.716,44	0,00
OMXC20 CAP Index Future (ZMO) Sep. 17		XNDX	DKK	Anzahl	1.480			2.395,67	0,00
S&P 500 ST Future (SP) Sep. 17		XIOM	USD	Anzahl	-28			252.766,55	0,02
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 17		XMOD	CAD	Anzahl	442			-172.210,77	-0,01
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 17		XSFE	AUD	Anzahl	422			-697.349,94	-0,04
								-173.038,18	-0,01

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 17		XEUR	CHF	Anzahl 280				51.967,43	0,00
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 17		XOSE	JPY	Anzahl 60				-60.590,23	-0,00
Optionsrechte								104.293,70	0,01
Optionsrechte auf Aktienindices								104.293,70	0,01
S & P 500 Index (S500) Put Sep. 17 2.415 W0809		XCBO		Anzahl 400			USD 3,100	104.293,70	0,01
Summe Aktienindex-Derivate								-1.166.849,33	-0,06
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								-2.569.115,71	-0,17
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 17		XEUR	EUR	-315.000.000				-2.106.500,00	-0,13
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 17		XEUR	EUR	-32.800.000				51.200,00	0,00
EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 17		XEUR	EUR	-165.000.000				-342.645,00	-0,02
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 17		XEUR	EUR	35.800.000				86.090,00	0,01
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Dez. 17		XCBT	USD	-32.100.000				65.387,13	0,00
Long Gilt Future (FLG) Dez. 17		IFEU	GBP	55.000.000				-286.483,20	-0,02
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 17		XEUR	EUR	29.400.000				-34.850,00	-0,00
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Dez. 17		XCBT	USD	-19.000.000				64.920,73	0,00
Two-Year US Treasury Note Future (TU) Dez. 17		XCBT	USD	-108.000.000				56.772,33	0,00
US Treasury Long Bond Future (US) Dez. 17		XCBT	USD	23.400.000				-123.007,70	-0,01
Optionsrechte								-169.000,00	-0,01
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte								-169.000,00	-0,01
EURO Bund Future (FGBL) Put Okt. 17 160		XEUR	EUR	Anzahl -1.300			EUR -0,230	299.000,00	0,02
EURO Bund Future (FGBL) Put Okt. 17 161		XEUR	EUR	Anzahl 1.300			EUR -0,360	-468.000,00	-0,03
Summe Zins-Derivate								-2.738.115,71	-0,18
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)								-360.319,01	-0,02
Offene Positionen									
AUD/EUR 44.800.000,00		OTC						-224.806,57	-0,01
CAD/EUR 300.000,00		OTC						-513,72	-0,00
GBP/EUR 3.000.000,00		OTC						-134.998,72	-0,01
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								21.000.153,29	1,25
Offene Positionen									
CAD/EUR 9.000.000,00		OTC						-40.800,30	-0,00
CHF/EUR 32.000.000,00		OTC						1.282.028,98	0,08
GBP/EUR 65.000.000,00		OTC						3.917.359,83	0,23
JPY/EUR 1.700.000.000,00		OTC						776.109,93	0,04
USD/EUR 450.000.000,00		OTC						15.065.454,85	0,90
Summe Devisen-Derivate								20.639.834,28	1,23
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	78.990.506,00			% 100,000	78.990.506,00	4,69
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	13.006.450,01			% 100,000	1.748.507,79	0,10
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	7.402.935,24			% 100,000	8.033.396,17	0,48
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	9.482.302,96			% 100,000	1.020.513,25	0,06
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	13.165.676,51			% 100,000	1.388.125,52	0,08
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	8.725.326,79			% 100,000	5.794.248,33	0,34
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	9.830.843,85			% 100,000	6.542.337,77	0,39
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	8.811.436,95			% 100,000	7.689.466,84	0,46
DekaBank Deutsche Girozentrale			HKD	887.799,99			% 100,000	95.420,81	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	46.406.711,00			% 100,000	353.225,08	0,02
DekaBank Deutsche Girozentrale			SGD	709.062,95			% 100,000	438.790,15	0,03
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	27.728.243,17			% 100,000	23.321.622,58	1,39
Summe Bankguthaben								EUR 135.416.160,29	8,05
Geldmarktpapiere									
EUR								16.873.000,00	1,00
DE000CE8QGV3	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic AHOG 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 93,910	3.756.400,00	0,22
DE000CE8QGU5	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic ASME 17/18		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,940	4.077.600,00	0,24
DE000DK0KC10	2,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. VNA 17/17		EUR	3.000.000	0	0	% 100,630	3.018.900,00	0,18
DE000LB1F8D0	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. ADS 17/17		EUR	1.000.000	0	0	% 101,140	1.011.400,00	0,06
DE000LB1GQP2	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. LHA 17/17		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 100,110	4.004.400,00	0,24
DE000LB1F8E8	2,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. VNA 17/17		EUR	1.000.000	0	0	% 100,430	1.004.300,00	0,06
Summe Geldmarktpapiere								EUR 16.873.000,00	1,00
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR 152.289.160,29	9,05

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	12.078.848,62				12.078.848,62	0,72
	Dividendenansprüche		EUR	259.613,97				259.613,97	0,02
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	13.709.087,59				13.709.087,59	0,81
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	54.582,41				54.582,41	0,00
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	325.638,36				325.638,36	0,02
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	363.428,37				363.428,37	0,02
	Forderungen aus Ersatzleistung Zinsen/Dividenden		EUR	33,90				33,90	0,00
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	270.000,00				270.000,00	0,02
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	27.061.233,22	1,61
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-26.745,38				-26.745,38	-0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-652.471,41				-652.471,41	-0,04
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-1.662.720,91				-1.662.720,91	-0,10
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-24.550.000,00				-24.550.000,00	-1,46
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-26.891.937,70	-1,60
Rückstellungen									
	Steuerrückstellungen		EUR	-6.163,20				-6.163,20	-0,00
	Summe Rückstellungen						EUR	-6.163,20	-0,00
Fondsvermögen									
	Umlaufende Anteile						EUR	1.683.365.654,88	100,00
	Anteilwert						STK	29.556.018	
							EUR	56,96	

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

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

²⁾ Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR befristet	unbefristet	gesamt
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
Adecco Group AG Namens-Aktien	STK 6.379		386.332,78	
Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien	STK 358		10.298,83	
Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares	STK 1.086		4.485,33	
ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK 221		1.123,79	
Experian PLC Reg.Shares	STK 99		1.643,70	
HSBC Holdings PLC Reg.Shares	STK 20.534		168.591,29	
Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK 340		2.338,18	
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK 1.158		38.057,67	
Intel Corp. Reg.Shares	STK 2.329		68.345,02	
LafargeHolcim Ltd. Namens-Aktien	STK 1.202		59.318,01	
Legrand S.A. Actions au Porteur	STK 392		23.241,68	
Lonza Group AG Namens-Aktien	STK 94		19.999,13	
L'Oréal S.A. Actions Port.	STK 4.931		874.266,30	
Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK 4		285,36	
Pernod-Ricard S.A. Actions Port.(C.R.)	STK 592		67.162,40	
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK 16		3.384,55	
Sanofi S.A. Actions Port.	STK 5		406,25	
Sekisui House Ltd. Reg.Shares	STK 537		7.782,37	
Straumann Holding AG Namens-Aktien	STK 5		2.694,37	
Swisscom AG Namens-Aktien	STK 4.606		1.937.807,16	
Total S.A. Actions au Porteur	STK 417		18.058,19	
Wm.Morrison Supermarkets PLC Reg.Shares	STK 243.906		644.755,42	
3,5000 % Allianz Finance II B.V. MTN 12/22	EUR 3.400.000		3.942.283,00	
4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20	EUR 900.000		1.002.744,00	
0,6250 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) MTN 16/21	EUR 1.900.000		1.933.772,51	
2,5000 % Atlas Copco AB MTN 13/23	EUR 500.000		557.952,50	
5,6250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 07/22	EUR 1.300.000		1.637.070,50	
1,3750 % Bank of America Corp. MTN 14/21	EUR 1.302.000		1.356.260,85	
5,0000 % Best Buy Co. Inc. Notes 13/18	USD 500.000		432.732,66	
3,5000 % Bundesländer Ländersch. Nr.32 09/19	EUR 98.000		106.099,70	
2,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 10/20	EUR 65.978.102		71.825.081,40	
2,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 10/21	EUR 10.000.000		11.053.099,99	
2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 11/22	EUR 30.000.000		33.258.300,01	
6,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 97/27	EUR 11.022.362		17.688.245,64	
1,3750 % Citigroup Inc. MTN 14/21	EUR 753.000		787.351,86	
5,3750 % Citigroup Inc. Notes 10/20	USD 83.000		76.000,90	
1,8750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 16/24	EUR 4.234.000		4.559.107,69	
2,0000 % Daimler AG MTN 13/21	EUR 1.100.000		1.175.916,51	
0,7500 % Daimler AG MTN 16/23	EUR 1.000.000		1.012.255,00	
3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. MTN 14/24	EUR 500.000		571.462,50	
1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22	EUR 150.000		157.455,75	

Deka-Stiftungen Balance

Gattungsbezeichnung		Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR		gesamt
			befristet	unbefristet	
1,3750 % Kering S.A. MTN 14/21		EUR	2.400.000	2.525.652,00	
4,2500 % Kon. KPN N.V. MTN 12/22		EUR	3.000.000	3.511.530,00	
2,2500 % Königreich Niederlande Anl. 12/22		EUR	44.932.372	50.556.781,66	
1,7500 % Königreich Niederlande Anl. 13/23		EUR	35.000.000	38.894.975,00	
0,7500 % Land Berlin Landessch. Ausg.474 15/23		EUR	450.000	467.365,50	
1,1250 % McDonald's Corp. MTN 15/22		EUR	300.000	310.536,00	
4,5000 % Merck Financial Services GmbH MTN 10/20		EUR	500.000	559.160,00	
1,0000 % NN Group N.V. MTN 15/22		EUR	1.500.000	1.549.125,00	
2,6250 % OMV AG MTN 12/22		EUR	1.500.000	1.667.467,50	
4,0000 % Republik Finnland Bonds 09/25		EUR	50.000.000	64.692.500,00	
3,5000 % Republik Finnland Notes 11/21		EUR	30.000.000	34.302.150,00	
3,2500 % Scentre Group MTN 13/23 Reg.S		EUR	2.000.000	2.285.240,00	
1,5000 % Sky PLC MTN 14/21		EUR	300.000	313.470,00	
1,7500 % SSE PLC MTN 15/23		EUR	500.000	534.697,50	
2,7500 % Telenor ASA MTN 12/22		EUR	1.000.000	1.118.480,00	
0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 15/22		EUR	500.000	513.237,50	
2,7500 % U.S. Treasury Notes 09/19		USD	24.500.000	21.037.059,41	
2,1250 % U.S. Treasury Notes 15/25		USD	39.491.100	33.460.326,58	
4,8750 % Vivendi S.A. MTN 09/19		EUR	150.000	166.734,00	
5,3750 % Vodafone Group PLC MTN 07/22		EUR	1.000.000	1.234.115,01	
4,6500 % Vodafone Group PLC MTN 10/22		EUR	670.000	796.492,65	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:		EUR		417.970.666,06	417.970.666,06
Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.08.2017					
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,92152	= 1 Euro (EUR)		
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43860	= 1 Euro (EUR)		
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,29170	= 1 Euro (EUR)		
Schweden, Kronen	(SEK)	9,48450	= 1 Euro (EUR)		
Schweiz, Franken	(CHF)	1,14591	= 1 Euro (EUR)		
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,18895	= 1 Euro (EUR)		
Kanada, Dollar	(CAD)	1,50265	= 1 Euro (EUR)		
Singapur, Dollar	(SGD)	1,61595	= 1 Euro (EUR)		
Japan, Yen	(JPY)	131,38000	= 1 Euro (EUR)		
Hongkong, Dollar	(HKD)	9,30405	= 1 Euro (EUR)		
Australien, Dollar	(AUD)	1,50586	= 1 Euro (EUR)		
Marktschlüssel					
Terminbörsen					
IFEU	London - ICE Futures Europe				
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24				
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)				
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options				
XIOM	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Option Market (IOM)				
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)				
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)				
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options				
XNDX	Stockholm - Nasdaq Stockholm - Derivatives				
OTC					
	Over-the-Counter				

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
CHF				
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK	0	20.760
EUR				
ES0125220311	Acciona S.A. Acciones Port.	STK	9.766	9.766
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK	38.994	38.994
AT0000730007	Andritz AG Inhaber-Aktien	STK	5.820	5.820
IT0003506190	Atlantia S.p.A. Azioni nom.	STK	33.088	33.088
DE0005501357	Axel Springer SE vink.Namens-Aktien	STK	8.353	8.353
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port.	STK	17.628,17	17.628,17
FR0000130650	Dassault Systèmes S.A. Actions Port.	STK	13.760	13.760
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK	68.690	99.629
FR0011950732	Elior Group SCA Actions au Port.	STK	22.347	22.347
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien	STK	14.208	14.208
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG Inhaber-Aktien	STK	7.148	7.148
NL0000009165	Heineken N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	2.926
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK	350.564	350.564
IT0001479374	Luxottica Group S.p.A. Azioni nom.	STK	19.240	19.240
FR0000133308	Orange S.A. Actions Port.	STK	43.965	43.965
BE0003810273	Proximus S.A. Actions au Porteur	STK	22.416	22.416
NL0012169213	Qiagen N.V. Aandelen op naam	STK	30.302	30.302

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK	61.622	61.622
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK	4.347	4.347
FR0000051807	Téléperformance SE Actions Port.	STK	0	4.939
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom.	STK	213.311	213.311
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK	0	16.795
ES0184262212	Viscofan S.A. Acciones Port.	STK	13.311	13.311
GBP				
GB0080744838	Bunzl PLC Reg.Shares	STK	0	27.521
GB008D6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares	STK	44.296,153	44.296,153
GB008RB37M78	Dignity PLC Reg.Shares	STK	0	4.337
GB008Z4BQC70	Johnson, Matthey PLC Reg.Shares	STK	19.104	19.104
GB0081FH8J72	Severn Trent PLC Reg.Shares	STK	10.156	61.621
GB0009223206	Smith & Nephew PLC Reg.Shares	STK	0	128.767
GB00810RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK	0	39.378
GB00839J2M42	United Utilities Group PLC Reg.Shares	STK	0	61.069
JPY				
JP3208200000	Kagome Co. Ltd. Reg.Shares	STK	11.800	11.800
JP3715200006	Nippon Shokubai Co. Ltd. Reg.Shares	STK	7.200	7.200
JP3675600005	Nissin Foods Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	14.400	14.400
JP3188220002	Otsuka Holdings Company Ltd. Reg.Shares	STK	22.900	22.900
USD				
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A	STK	0	3.230
US0091581068	Air Products & Chemicals Inc. Reg.Shares	STK	0	9.200
US1156372096	Brown-Forman Corp. Reg.Shares	STK	0	18.700
US1344291091	Campbell Soup Co. Reg.Shares	STK	0	5.100
US2058871029	ConAgra Brands Inc. Reg.Shares	STK	0	10.500
US26138E1091	Dr. Pepper Snapple Group Inc. Reg.Shares	STK	0	12.882
US30161N1019	Exelon Corp. Reg.Shares	STK	0	10.000
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares	STK	0	11.500
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares	STK	0	10.200
US6200763075	Motorola Solutions Inc. Reg.Shares	STK	0	3.500
US68389X1054	Oracle Corp. Reg.Shares	STK	0	13.900
US74005P1049	Praxair Inc. Reg.Shares	STK	0	14.900
US7445731067	Public Service Ent. Group Inc. Reg.Shares	STK	0	20.100
US74876Y1010	Quintiles IMS Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	3.967
US1890541097	The Clorox Co. Reg.Shares	STK	0	14.500
US2605431038	The Dow Chemical Co. Reg.Shares	STK	0	14.600
US4165151048	The Hartford Finl SvcsGrp Inc. Reg.Shares	STK	0	17.700
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1290850707	1,6250 % Bank of America Corp. MTN 15/22	EUR	0	1.500.000
DE000A1R0XG3	2,0000 % BASF SE MTN 12/22	EUR	0	2.500.000
XS0787786440	3,0000 % BHP Billiton Finance Ltd. MTN 12/24	EUR	0	2.000.000
XS0877622034	2,3750 % BMW Finance N.V. MTN 13/23	EUR	0	2.300.000
FR0011332196	3,6250 % Bouygues S.A. Bonds 12/23	EUR	2.000.000	2.000.000
DE0001135408	3,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 10/20	EUR	0	52.000.000
XS0854746343	2,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 12/22	EUR	0	2.500.000
XS1068874970	2,3750 % Citigroup Inc. MTN 14/24	EUR	0	650.000
XS1173792059	1,7500 % Citigroup Inc. Notes 15/25	EUR	2.000.000	2.000.000
XS1079320203	1,8750 % Compass Group PLC MTN 14/23	EUR	0	2.500.000
XS0307504547	5,3750 % Ericsson MTN 07/17	EUR	0	600.000
XS0222383027	4,0000 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 05/25	EUR	0	2.000.000
XS1147600305	0,6250 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 14/19	EUR	0	500.000
XS1578294081	1,1250 % Italgas S.P.A. MTN 17/24	EUR	2.000.000	2.000.000
XS0883614231	2,7500 % JPMorgan Chase & Co. MTN 13/23	EUR	0	2.500.000
FR0011832039	2,7500 % Kering S.A. MTN 14/24	EUR	0	400.000
XS0632659933	3,8750 % Linde Finance B.V. MTN 11/21	EUR	0	2.000.000
XS0891393414	1,7500 % National Grid North Amer. Inc. MTN 13/18	EUR	0	2.500.000
XS1408317433	1,0000 % Orange S.A. MTN 16/25	EUR	0	1.000.000
DE000A1UDWM7	1,7500 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 13/21	EUR	0	750.000
DE000A1UDWN5	2,8750 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 13/28	EUR	0	2.000.000
XS0944451243	2,0000 % SSE PLC MTN 13/20	EUR	0	800.000
XS0862442331	2,6250 % Telenor ASA MTN 12/24	EUR	0	2.000.000
XS0465576030	4,7500 % Telia Company AB MTN 09/21	EUR	0	4.500.000
XS0592627003	4,2500 % Telia Company AB MTN 11/20	EUR	0	900.000
XS0746010908	3,6250 % Telia Company AB MTN 12/24	EUR	0	1.500.000
XS0760187400	3,5000 % Telstra Corp. Ltd. MTN 12/22	EUR	0	2.000.000
XS0300113254	4,8750 % The Procter & Gamble Co. Bonds 07/27	EUR	0	2.000.000
XS0816704125	2,0000 % The Procter & Gamble Co. Bonds 12/22	EUR	0	2.500.000
XS0830194501	2,1250 % Total Capital Intl S.A. MTN 12/23	EUR	0	2.500.000
FR0011225127	3,3750 % VINCI S.A. MTN 12/20	EUR	0	1.000.000
XS1074382893	2,1250 % Wells Fargo & Co. MTN 14/24	EUR	0	3.700.000
XS0357251726	6,3750 % Wolters Kluwer N.V. Notes 08/18	EUR	0	850.000
XS0907301260	2,8750 % Wolters Kluwer N.V. Notes 13/23	EUR	0	2.150.000
XS1575992596	1,5000 % Wolters Kluwer N.V. Notes 17/27	EUR	1.300.000	1.300.000
USD				
US00772BAR24	3,9500 % AerCap Ire.Cap.DAC/Gl.Av.Tr. Notes 16/22	USD	2.000.000	2.000.000
US824348AU08	2,7500 % Sherwin-Williams Co. Notes 17/22	USD	1.000.000	1.000.000

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06445809E7	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	265.184	265.184
ES06735169A3	Repsol S.A. Anrechte	STK	140.013	140.013
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
GBP				
GB00BLNN3L44	Compass Group PLC Reg.Shares	STK	46.068	46.068
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
BE6291424040	1,8750 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Bonds 12/20	EUR	0	2.500.000
DE000CE9HW33	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic TKA 17/18	EUR	4.000.000	4.000.000
DE000LB1GQQ0	4,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Rev.Conv. ESSI 17/18	EUR	4.000.000	4.000.000
XS1421827269	1,3750 % Swiss Re Admin Re Ltd. Notes 16/23	EUR	0	2.000.000
USD				
US912828TJ95	1,6250 % U.S. Treasury Notes 12/22	USD	0	25.000.000
Neuemissionen				
Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen				
EUR				
DE000DK0KC28	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. AXA 17/18	EUR	0	4.000.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
EUR				
FR0000121253	Rubis S.C.A. Actions Port.	STK	5.021	5.021
GBP				
GB00B085NH34	National Grid PLC Reg.Shares New	STK	0	185.670
Andere Wertpapiere				
CHF				
CH0351063620	Lonza Group AG Anrechte	STK	7.259	7.259
EUR				
NL0012483861	Koninklijke DSM N.V. Anrechte (Div. wahlw.)	STK	10.426	10.426
NL0012191696	Koninklijke DSM N.V. Anrechte (Wahldividende)	STK	4.762	4.762
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
LU0703710904	Deka-Nachhaltigkeit Aktien CF (A)	ANT	0	24.000
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
LU0274211217	db x-tr.EO STOXX 50 ETF DR 1D	ANT	0	194.000
DE0005933964	iShares SLI UCITS ETF (DE)	ANT	0	338.500
Geldmarktpapiere				
EUR				
DE000DK0KC02	4,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. ADS 17/17	EUR	0	3.000.000
Gattungsbezeichnung		Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:		EUR	455.170	
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, OMX Copenhagen 20 Cap Index (OMXC20CAP) (DKK), OMX Stockholm 30 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))				
Verkaufte Kontrakte:		EUR	64.772	
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index, TOPIX Index (Price) (JPY))				

Deka-Stiftungen Balance

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 30 Year US Treasury Bonds (30,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bund (10,0), Long Gilt (10,0))	EUR	508.870
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 10 Year US Treasury Notes (10,0), 2 Year US Treasury Notes (2,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bobl (5,5), Euro Schatz (2,0))	EUR	865.308
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))	EUR	51.375
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	358.570
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))	EUR	149.998
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL))	EUR	1.585.950
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	301.550
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	213.975
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	47.740
CAD/EUR	EUR	13.671
CHF/EUR	EUR	32.939
GBP/EUR	EUR	85.360
JPY/EUR	EUR	13.578
USD/EUR	EUR	307.787
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	30.144
CAD/EUR	EUR	19.012
CHF/EUR	EUR	90.471
GBP/EUR	EUR	167.675
JPY/EUR	EUR	13.004
USD/EUR	EUR	554.039
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet (Basiswert(e): 0,5000 % Air Liquide Finance MTN 16/22, 0,6250 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) MTN 16/21, 0,6250 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 14/19, 0,6250 % The Toronto-Dominion Bank MTN 16/21, 0,7500 % Daimler AG MTN 16/23, 0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 15/22, 1,0000 % KBC Groep N.V. MTN 16/21, 1,0000 % McDonald's Corp. MTN 16/23, 1,0000 % NN Group N.V. MTN 15/22, 1,0000 % Orange S.A. MTN 16/25, 1,0000 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 14/21, 1,1250 % Macquarie Bank Ltd. MTN 15/22, 1,1250 % McDonald's Corp. MTN 15/22, 1,2500 % Shell International Finance BV MTN 15/22, 1,3750 % Bank of America Corp. MTN 14/21, 1,3750 % Citigroup Inc. MTN 14/21, 1,3750 % Swiss Re Admin Re Ltd. Notes 16/23, 1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22, 1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22, 1,5000 % Sky PLC MTN 14/21, 1,6250 % PGE Sweden AB (Publ) MTN 14/19, 1,6250 % U.S. Treasury Notes 12/22, 1,7500 % Citigroup Inc. Notes 15/25, 1,7500 % Königreich Niederlande Anl. 13/23, 1,7500 % Land Hessen Schatzanw. S.1304 13/23, 1,7500 % Morgan Stanley MTN 15/25, 1,7500 % National Grid North Amer. Inc. MTN 13/18, 1,7500 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 13/21, 1,7500 % SSE PLC MTN 15/23, 1,8750 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Bonds 12/20, 1,8750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 16/24, 1,8750 % Compass Group PLC MTN 14/23, 2,0000 % BASF SE MTN 12/22, 2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 11/22, 2,0000 % Daimler AG MTN 13/21, 2,0000 % Heineken N.V. MTN 13/21, 2,0000 % Rio Tinto Finance PLC MTN 12/20, 2,0000 % SSE PLC MTN 13/20, 2,0000 % The Procter & Gamble Co. Bonds 12/22, 2,1250 % BHP Billiton Finance Ltd. MTN 12/18, 2,1250 % Heineken N.V. MTN 12/20, 2,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 13/23, 2,1250 % U.S. Treasury Notes 15/25, 2,1250 % Wells Fargo & Co. MTN 14/24, 2,1770 % BP Capital Markets PLC MTN 14/21, 2,2500 % BHP Billiton Finance Ltd. MTN 12/20, 2,2500 % Königreich Niederlande Anl. 12/22, 2,2500 % Wells Fargo & Co. MTN 13/20, 2,3750 % BMW Finance N.V. MTN 13/23, 2,3750 % Citigroup Inc. MTN 14/24, 2,3750 % Morgan Stanley MTN 14/21, 2,5000 % Atlas Copco AB MTN 13/23, 2,5000 % Essity AB MTN 13/23, 2,5000 % Schneider Electric SE MTN 13/21, 2,5000 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN S.F 14/21, 2,6250 % Akzo Nobel Sweden Finance AB MTN 12/22, 2,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 12/19, 2,6250 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 13/28, 2,8750 % OMV AG MTN 12/22, 2,7500 % Hammerson PLC Bonds 12/19, 2,7500 % JPMorgan Chase & Co. MTN 13/23, 2,7500 % National Australia Bank Ltd. MTN 12/22, 2,7500 % Telenor ASA MTN 12/22, 2,7500 % U.S. Treasury Notes 09/19, 2,8750 % Santander UK Group Hldgs PLC MTN 15/20, 2,8750 % Siemens MTN 11/21, 3,8750 % Telia Company AB MTN 10/25, 4,0000 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 05/25, 4,2500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 10/22, 4,2500 % Kon. KPN N.V. MTN 12/22, 4,2500 % OMV AG MTN 11/21, 4,2500 % Telia Company AB MTN 11/20, 4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20, 4,5000 % Merck Financial Services GmbH MTN 10/20, 4,6250 % Brambles Finance PLC Bonds 11/18, 4,6500 % Vodafone Group	EUR	917.522

Deka-Stiftungen Balance

Gattungsbezeichnung

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

Volumen in 1.000

PLC MTN 10/22, 4,7500 % Experian Finance PLC MTN 10/20, 4,8750 % Investor AB MTN 09/21, 4,8750 % The Procter & Gamble Co. Bonds 07/27, 4,8750 % Vivendi S.A. MTN 09/19, 5,0000 % CEZ AS MTN 09/21, 5,3750 % Vodafone Group PLC MTN 07/22, 5,6250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 07/22, 5,6250 % Statoil ASA MTN 09/21, ABB Ltd. Namens-Aktien, Abertis Infraestructuras S.A. Acciones Nom., Adecco Group AG Namens-Aktien, Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien, Danone S.A. Actions Port., Elisa Oyi Reg.Shares Cl.A, Endesa S.A. Acciones Port., ENEL S.p.A. Azioni nom., Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder, HSBC Holdings PLC Reg.Shares, Iberdrola S.A. Acciones Port., LafargeHolcim Ltd. Namens-Aktien, L'Oréal S.A. Actions Port., Luxottica Group S.p.A. Azioni nom., Nestlé S.A. Namens-Aktien, Pernod-Ricard S.A. Actions Port.(C.R.), Relx N.V. Aandelen op naam, Repsol S.A. Acciones Port., Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine, Sanofi S.A. Actions Port., SGS S.A. Namens-Aktien, Straumann Holding AG Namens-Aktien, Swiss Re AG Namens-Aktien, Swisscom AG Namens-Aktien, Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom., Total S.A. Actions au Porteur, United Utilities Group PLC Reg.Shares, UPM Kymmene Corp. Reg.Shares, Iberdrola S.A. Anrechte)

Deka-Stiftungen Balance

Entwicklung des Sondervermögens

			EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			1.716.244.399,40
1. Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr			-2.965.680,59
2. Zwischenausschüttung(en)			-2.960.785,50
3. Mittelzufluss (netto)			-23.735.173,82
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	+74.896.368,73	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-98.631.542,55	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			+162.179,50
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			-3.379.284,11
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne			-35.307.946,52
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste			-15.203.944,53
II. Wert des Sondervermögens zur Mitte des Geschäftsjahres			1.683.365.654,88

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.03.2017 - 31.08.2017 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller	350.640,24	0,01
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	3.403.902,80	0,12
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	6.060.965,31	0,21
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	4.085.095,81	0,14
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	31.136,92	0,00
davon Negative Einlagezinsen	-174.681,17	-0,01
davon Positive Einlagezinsen	205.818,09	0,01
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	1.389.829,45	0,05
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	407.310,54	0,01
9. Abzug ausländischer Quellensteuer	-612.498,49	-0,02
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-612.498,49	-0,02
10. Sonstige Erträge	4.150.645,31	0,14
davon Kick-Back-Zahlungen	985,22	0,00
davon Kompensationszahlungen	4.048.735,47	0,14
davon Quellensteuerrückvergütung	100.924,62	0,00
Summe der Erträge	19.267.027,89	0,65
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-1.594,69	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-8.526.506,14	-0,29
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-1.582.532,15	-0,05
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-199.582,22	-0,01
davon EMIR-Kosten	-6.736,34	-0,00
davon Kostenpauschale	-1.364.240,95	-0,05
davon Ratinggebühren	-11.972,64	-0,00
Summe der Aufwendungen	-10.110.632,98	-0,34
III. Ordentlicher Nettoertrag	9.156.394,91	0,31
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	66.760.583,40	2,26
2. Realisierte Verluste	-28.784.371,37	-0,97
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	37.976.212,03	1,28
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	47.132.606,94	1,59
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-35.307.946,52	-1,19
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-15.203.944,53	-0,51
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-50.511.891,05	-1,71
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-3.379.284,11	-0,11

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

Deka-Stiftungen Balance

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	29.556.018
Anteilwert	EUR	56,96

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

Verzinsliche Wertpapiere, 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 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)

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Aktien	4.340.377,78	0,26
Verzinsliche Wertpapiere	413.630.288,28	24,57

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	148.531.429,03	Deutschland
Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme	269.439.237,03	Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	417.970.666,06

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

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen an einem geregelten Markt in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder an einer Börse in einem Mitgliedstaat der OECD notiert sein oder gehandelt werden und in einem wichtigen Index enthalten sein.

Von den Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten sowie ggf. nach Restlaufzeit variieren. Die Haircuts fallen für die aufgeführten Wertpapierkategorien wie folgt aus:

- Bankguthaben 0%
- Aktien 5% - 40%
- Renten 0,5% - 30%

Darüber hinaus kann für Sicherheiten in einer anderen Währung als der Fondswährung ein zusätzlicher Wertabschlag von bis zu 10%-Punkten angewandt werden. In besonderen Marktsituationen (z.B. Marktturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindizes (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX 50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder des GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter www.eurexrepo.com entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag in Höhe von 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

Deka-Stiftungen Balance

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR
GBP

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

Restlaufzeit 1-7 Tage
unbefristet

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

279.464.621,90
163.357.124,26

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds
Kostenanteil des Fonds
Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

408.972,91
200.396,67
200.396,67

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00
49,00
49,00

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften gerechnet.

Der Ertragsanteil der KVG entspricht maximal dem Kostenanteil des Fonds. Der Kostenanteil der KVG ist auf Ebene des Sondervermögens im Einzelnen nicht bestimmbar.

Geschäftsbedingt gibt es bei Principalgeschäften keine expliziten Kosten durch Dritte. Sofern diese Geschäfte getätigt werden, sind Ertrags- und Kostenanteile Dritter über die in den Wertpapierleihesätzen enthaltenen Margen abgedeckt und damit bereits im Ertragsanteil des Fonds berücksichtigt. Bei Agencygeschäften werden Erträge und Kosten Dritter über eine Gebührenaufteilung (Fee split) definiert. Hier beträgt der Ertragsanteil des Agenten zwischen 20% und 35% vom Bruttoleihesatz.

Kosten Dritter als Agent der KVG werden nicht auf Ebene des Sondervermögens offengelegt.

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

27,60% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen

FMS Wertmanagement
Apple Inc.
Rheinland-Pfalz, Land
Nordrhein-Westfalen, Land
NRW. Bank
Investitionsbank Schleswig-Holstein
European Financial Stability Facility (EFSF)
LfA Förderbank Bayern
Hessen, Land
Kreditanstalt für Wiederaufbau

absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR

74.739.823,28
21.232.796,71
19.107.632,13
18.780.349,46
16.822.314,15
12.104.040,00
11.441.580,72
11.372.454,95
10.493.448,65
9.229.723,85

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

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

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer
Clearstream Banking Frankfurt
Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus
J.P.Morgan AG Frankfurt

3
112.182.464,09 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
279.464.621,90 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
51.174.660,17 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

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

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

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

Deka-Stiftungen Balance

Frankfurt am Main, den 1. September 2017
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Informationen der Verwaltung.

Das DekaBank Depot – Service rund um Ihre Investmentfonds –

Mit dem DekaBank Depot bieten wir Ihnen die kostengünstige Möglichkeit, verschiedene Investmentfonds Ihrer Wahl in einem einzigen Depot und mit einem Freistellungsauftrag verwahren zu lassen. Hierfür steht Ihnen ein Fondsuniversum von rund 1.000 Fonds der Deka-Gruppe und international renommierter Kooperationspartner zur Verfügung. Das Spektrum eignet sich zur Realisierung der unterschiedlichsten Anlagekonzepte. So können Sie zum Vermögensaufbau aus mehreren Alternativen wählen, unter anderem:

- Für Investmentfonds-Anleger, die regelmäßig sparen möchten, eignet sich der individuell zu gestaltende Deka-FondsSparplan ab einer Mindestanlage von 25,– Euro. Im Rahmen eines auf die eigenen Bedürfnisse abgestimmten Deka-Auszahlplans lässt sich das so aufgebaute Vermögen später gezielt nutzen.
- Für alle, die regelmäßig für ein Kind sparen möchten, ist der Deka-JuniorPlan besonders geeignet. Mit Beträgen ab monatlich 25,– Euro wird für den Vermögensaufbau chancenreich und breit gestreut in Investmentfonds angelegt und dank eines professionellen Anlagemanagements langfristig hohe Ertragsmöglichkeiten genutzt sowie Risiken im Vergleich zu Anlagen in Einzeltiteln spürbar reduziert.

■ Für den systematischen und flexiblen Vermögensaufbau – insbesondere im Rahmen der privaten Altersvorsorge – können Sie zwischen zwei Varianten wählen:

- Deka-ZukunftsPlan: Die individuelle Vorsorgelösung mit intelligentem Anlagekonzept – auch mit Riester-Förderung.
- Deka-BasisRente: Kombiniert als Rürup-Lösung die Vorteile einer staatlich geförderten Investmentanlage mit dem Wachstumspotenzial einer optimierten Vermögensstruktur.

Für die Auftragserteilung können Sie verschiedene Wege nutzen, z.B. Post, Telefon oder Internet über unsere Webpräsenz www.deka.de

Auskünfte rund um das DekaBank Depot und Fondsinformationen erhalten Sie über unser Service-Telefon unter der Nummer (0 69) 7147-652. Sie erreichen uns montags bis freitags von 8.00 Uhr bis 18.00 Uhr.

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 2016)

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
Landesbank Berlin Investment 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
Landesbank Berlin Investment 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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker

Mitglied des Aufsichtsrates der
Augsburger Aktienbank AG,
Augsburg

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der
Ostsächsischen Sparkasse Dresden,
Dresden

und der

Sachsen-Finanzgruppe,
Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse,
Münster

Heinz-Jürgen Schäfer
Offenbach

(Stand 9. Januar 2017)

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)

Thomas Ketter

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

und der

International Fund Management S.A.,
Luxemburg

und der

Dealis Fund Operations 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

Mitglied des Aufsichtsrates der
Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin

Steffen Selbach

Mitglied des Aufsichtsrates der
bevestor GmbH,
Frankfurt am Main

(Stand 1. Januar 2017)

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sonder- vermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squaire
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Eigenkapital

gezeichnetes und eingezahltes

Kapital: EUR 447,9 Mio.

Eigenmittel: EUR 5.366 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2016)

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft
sowie Wertpapiergeschäft

**Zahl- und Informationsstelle in
Österreich**

Vorarlberger Landes- und
Hypothekenbank Aktiengesellschaft
Hypo-Passage 1
6900 Bregenz
Österreich

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



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