

Halbjahresbericht
zum 31. August 2019.
Deka-Stiftungen Balance

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2019

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 2019 bis zum 31. August 2019.

In den vergangenen sechs Monaten prägten wiederholt sowohl die geldpolitischen Entscheidungsträger als auch die Akteure im Handelskonflikt der USA mit China die Kapitalmärkte. Insgesamt zeigten die Aktienbörsen eine erstaunliche Widerstandskraft gegen exogene Erschütterungen; bei den Marktteilnehmern manifestierte sich jedoch eine gestiegene Risikoaversion und eine höhere Nachfrage nach sicheren Anlagemöglichkeiten.

Das unverändert niedrige bzw. sinkende Zinsniveau äußerte sich bei einer positiven Marktentwicklung in merklich nachgebenden Renditen. Mittlerweile bewegen sich deutsche Bundesanleihen über alle Laufzeiten hinweg im negativen Bereich. Die US-amerikanische Notenbank Fed nahm im Juli zum ersten Mal seit der Finanzkrise eine Leitzinssenkung vor und reagierte damit auf Anzeichen einer sich abschwächenden Konjunktur. Zum Stichtag rentierten 10-jährige US-Treasuries mit lediglich 1,5 Prozent auf einem niedrigen Niveau.

Die weltpolitischen Störfeuer führten nur zu temporären Unsicherheiten an den Märkten und so bewegte sich das Gros der internationalen Börsen im Berichtshalbjahr unter Schwankungen leicht aufwärts. In den USA verzeichneten die Leitindizes Dow Jones Industrial und der marktweite S&P 500 im Juli ein neues Allzeithoch. Auch der deutsche Standardwertindex DAX sowie der EURO STOXX 50 landeten auf Halbjahressicht auf positivem Terrain. Im Zuge des erneut eskalierenden Handelsstreits mit den USA verlor hingegen vor allem der chinesische HangSeng deutlich. Ebenso musste der japanische Nikkei 225 Einbußen hinnehmen. An den Rohstoffmärkten machte Gold seinem Namen als Krisenwährung alle Ehre und verzeichnete im August ein neues Sechsjahreshoch.

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka.de 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)



Dr. Ulrich Neugebauer
(stv. Vorsitzender)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Anteilklassen im Überblick	6
Vermögensübersicht zum 31. August 2019	7
Vermögensaufstellung zum 31. August 2019	8
Anhang	24
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	27

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.

Auf das Rentensegment entfielen zum Ende des Berichtszeitraums 68,0 Prozent des Fondsvermögens. Die Investitionen erfolgten sowohl in fest- als auch variabel verzinslichen Wertpapieren sowie Rentenfonds. Teilweise verfügten die Anleihen über besondere Ausstattungsmerkmale (z.B. Rating Linked Bonds, Aktienanleihen). Im Laufe des Berichtshalbjahres wurde der Anteil an Euroland-Staatsanleihen abgebaut, während deutsche Bundesanleihen eine Erhöhung erfuhren. Den Schwerpunkt im Portfolio bildeten unverändert vorwiegend Unternehmensanleihen. Daneben bestanden weiterhin Beimischungen in Anleihen halbstaatlicher Emittenten. Der wirtschaftliche Investitionsgrad wurde zum Stichtag durch den Einsatz von Renten-Derivaten (Zinsterminkontrakte) um 13,6 Prozentpunkte verringert.

Im Aktiensegment erhöhte sich die Wertpapierquote im Berichtszeitraum leicht. In Aktien und Aktienfonds waren zum Ende des Berichtshalbjahres 15,6 Prozent des Fondsvermögens angelegt. Durch den Einsatz von Aktien-Derivaten (Futures) stieg die Netto-Aktienquote auf 18,7 Prozent, der vergleichbare Wert lag zu Beginn der Berichtsperiode bei 16,6 Prozent. Die Branchengewichtungen ergaben sich dabei implizit aus der Länderallokation und der Einzeltitelselektion.

Wichtige Kennzahlen

Deka-Stiftungen Balance

Performance *	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Anteilklasse CF	2,1%	1,2%	0,0%
Anteilklasse D	2,1%	1,2%	-

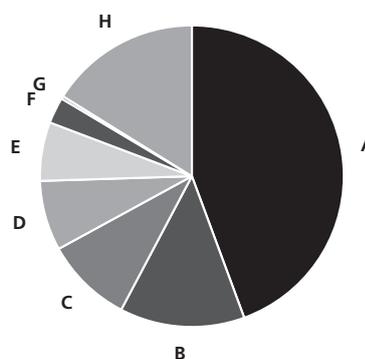
ISIN

Anteilklasse CF	DE0005896864
Anteilklasse D	DE000DK0LKD2

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

Fondsstruktur

Deka-Stiftungen Balance



A	Festverzinsliche Wertpapiere	44,4%
B	Wertpapiere mit besonderer Ausstattung	13,3%
C	Aktien	9,3%
D	Variabel verzinsliche Anleihen	7,5%
E	Aktienfonds	6,3%
F	Rentenfonds	2,8%
G	Gemischter Wertpapierfonds	0,3%
H	Barreserve, Sonstiges	16,1%

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

Die im Portfolio enthaltenen Fremdwährungspositionen waren über den Einsatz von Devisentermingeschäften weitgehend gegen Währungskursschwankungen abgesichert. Daneben kamen Credit Default Swaps (CDS) zum Einsatz.

Der Deka-Stiftungen Balance verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 2,1 Prozent (in den beiden Anteilklassen CF und D).

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds Deka-Stiftungen Balance können Anteilklassen gebildet werden, die sich hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von zwei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich der Höhe des Ausgabeaufschlags unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung CF und D. Die bis zum 31. Dezember 2017 ausgegebenen Anteile werden der Anteilklasse CF zugeordnet. Anteile der Anteilklasse D sind ausschließlich solchen Anlegern vorbehalten, welche die Voraussetzungen der §§ 8 und 10 InvStG in der ab dem 1. Januar 2018 geltenden Fassung erfüllen oder vergleichbaren ausländischen Anlegern mit Sitz und Geschäftsleitung in einem Amts- und Beitreibungshilfe leistenden Staat (sog. steuerbegünstigte Anleger). Die Ausstattungsmerkmale sowie etwaige Erwerbs- und Haltebeschränkungen der Anteilklassen sind im Verkaufsprospekt unter Punkt 10. „Ausgabe- und Rücknahmepreise und Kosten“ sowie unter Punkt 11. „Verwaltungs- und sonstige Kosten“ beschrieben.

Der Erwerb von Vermögensgegenständen ist nur einheitlich für den gesamten Fonds und nicht für eine einzelne Anteilklasse oder eine Gruppe von Anteilklassen zulässig. Die Bildung neuer Anteilklassen ist zulässig, sie liegt im Ermessen der Gesellschaft. Es ist weder notwendig, dass Anteile einer Anteilklasse im Umlauf sind, noch dass Anteile einer neu gebildeten Anteilklasse umgehend auszugeben sind. Bei erstmaliger Ausgabe von Anteilen einer Anteilklasse ist deren Wert auf der Grundlage des für das gesamte Sondervermögen nach § 168 Absatz 1 Satz 1 KAGB ermittelten Wertes zu berechnen.

Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Mindestanlagesumme	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	1,00% p.a.	2,00%	EUR 25.000	Ausschüttung
Anteilklasse D	1,00% p.a.	1,50%	EUR 25.000	Ausschüttung

* Der Verwaltungsvergütungssatz wird auf das durchschnittliche Fondsvermögen berechnet, das sich aus den Tageswerten zusammensetzt. Näheres ist im Verkaufsprospekt geregelt.

Deka-Stiftungen Balance

Vermögensübersicht zum 31. August 2019.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	126.301.336,33	9,08
Deutschland	7.822.699,76	0,55
Frankreich	8.336.627,43	0,60
Großbritannien	10.983.175,69	0,79
Irland	4.306.252,28	0,31
Italien	3.003.196,85	0,22
Japan	16.172.679,52	1,16
Niederlande	3.204.314,34	0,23
Schweiz	9.561.790,61	0,69
Spanien	4.074.614,24	0,29
USA	58.835.985,61	4,24
2. Anleihen	899.943.630,89	64,54
Australien	58.086.149,06	4,15
Belgien	2.042.980,00	0,15
Dänemark	6.508.645,00	0,47
Deutschland	282.470.729,29	20,22
Finnland	7.404.406,48	0,53
Frankreich	41.743.343,57	3,00
Großbritannien	75.803.668,00	5,43
Hongkong	2.240.925,33	0,16
Indien	2.448.312,57	0,18
Irland	4.624.607,50	0,33
Italien	46.344.327,75	3,32
Japan	8.256.878,82	0,59
Kanada	17.684.151,39	1,27
Kolumbien	7.316.625,15	0,52
Luxemburg	9.598.786,25	0,70
Mexiko	6.492.223,22	0,47
Neuseeland	3.803.053,98	0,28
Niederlande	43.096.234,43	3,10
Norwegen	6.469.745,76	0,46
Österreich	7.374.746,90	0,54
Panama	2.505.875,00	0,18
Polen	15.220.800,00	1,09
Schweden	35.428.397,19	2,54
Schweiz	2.275.050,96	0,16
Spanien	17.262.084,08	1,24
Tschechische Republik	2.770.987,50	0,20
USA	184.669.895,71	13,26
3. Investmentanteile	131.308.316,23	9,40
Deutschland	92.784.667,00	6,65
Luxemburg	38.523.649,23	2,75
4. Sonstige Wertpapiere	2.133.777,63	0,15
Schweiz	2.133.777,63	0,15
5. Derivate	-6.083.171,16	-0,41
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	215.778.368,86	15,44
7. Sonstige Vermögensgegenstände	27.084.152,84	1,93
II. Verbindlichkeiten	-1.810.002,57	-0,13
III. Fondsvermögen	1.394.656.409,05	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	126.301.336,33	9,08
CHF	9.561.790,61	0,69
EUR	26.441.452,62	1,89
GBP	10.983.175,69	0,79
JPY	16.172.679,52	1,16
USD	63.142.237,89	4,55
2. Anleihen	899.943.630,89	64,54
EUR	665.500.436,08	47,71
USD	234.443.194,81	16,83
3. Investmentanteile	131.308.316,23	9,40
EUR	131.308.316,23	9,40
4. Sonstige Wertpapiere	2.133.777,63	0,15
CHF	2.133.777,63	0,15
5. Derivate	-6.083.171,16	-0,41
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	215.778.368,86	15,44
7. Sonstige Vermögensgegenstände	27.084.152,84	1,93
II. Verbindlichkeiten	-1.810.002,57	-0,13
III. Fondsvermögen	1.394.656.409,05	100,00

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

Deka-Stiftungen Balance

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								815.998.708,04	58,53
Aktien								126.301.336,33	9,08
EUR								26.441.452,62	1,89
IT0001233417	AZA S.p.A. Azioni nom.	STK		253.764	253.764	0	EUR 1,617	410.209,51	0,03
ES0105046009	Aena SME S.A. Acciones Port.	STK		4.228	0	0	EUR 164,700	696.351,60	0,05
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		36.792	13.192	0	EUR 21,330	784.773,36	0,06
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port.	STK		3.586	3.586	0	EUR 126,600	453.987,60	0,03
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		7.256	1.383	2.062	EUR 200,850	1.457.367,60	0,10
FR0010220475	Alstom S.A. Actions Porteur	STK		10.807	10.807	0	EUR 38,680	418.014,76	0,03
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK		46.688	13.025	0	EUR 16,490	769.885,12	0,06
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		94.948	17.425	0	EUR 15,208	1.443.969,18	0,10
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		119.197	104.790	31.808	EUR 8,444	1.006.499,47	0,07
ES0130670112	Endesa S.A. Acciones Port.	STK		18.772	18.772	0	EUR 23,520	441.517,44	0,03
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK		89.545	161.616	72.071	EUR 6,679	598.071,06	0,04
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port.	STK		54.853	54.853	0	EUR 13,885	761.633,91	0,05
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom.	STK		22.600	22.600	0	EUR 13,728	310.252,80	0,02
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK		5.376	1.279	3.102	EUR 145,800	783.820,80	0,06
NL0000008977	Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder	STK		5.130	0	6.314	EUR 90,550	464.521,50	0,03
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK		57.356	57.357	1	EUR 9,412	539.834,67	0,04
DE000LEG1110	LEG Immobilien AG Namens-Aktien	STK		11.035	0	0	EUR 106,950	1.180.193,25	0,08
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		2.560	0	0	EUR 250,100	640.256,00	0,05
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		7.307	7.307	0	EUR 97,180	710.094,26	0,05
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		5.702	1.748	2.658	EUR 217,600	1.240.755,20	0,09
FR0000133308	Orange S.A. Acciones Port.	STK		93.143	0	20.693	EUR 13,845	1.289.564,84	0,09
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. Actions Port.(C.R.)	STK		8.837	4.451	0	EUR 173,700	1.534.986,90	0,11
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		60.635	0	39.901	EUR 18,065	1.095.371,28	0,08
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK		29.830	29.831	1	EUR 13,330	397.633,90	0,03
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		12.158	0	0	EUR 78,490	954.281,42	0,07
FR0000121220	Sodexo S.A. Actions Port.	STK		4.774	4.774	0	EUR 103,300	493.154,20	0,04
ES0178430E18	Telefónica S.A. Acciones Port.	STK		143.591	143.591	0	EUR 6,295	903.905,35	0,06
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom.	STK		156.855	45.319	0	EUR 5,832	914.778,36	0,07
FR0000120271	Total S.A. Actions au Porteur	STK		11.952	153	0	EUR 45,530	544.174,56	0,04
NL0000388619	Unilever N.V. Aandelen op naam	STK		25.644	25.644	0	EUR 56,390	1.446.065,16	0,10
FR0000124141	Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur	STK		23.573	23.573	0	EUR 21,720	512.005,56	0,04
FR0000127771	Vivendi S.A. Actions Porteur	STK		28.784	28.784	0	EUR 25,520	734.567,68	0,05
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		7.749	0	0	EUR 65,680	508.954,32	0,04
CHF								9.561.790,61	0,69
CH0466642201	Helvetia Holding AG Namens-Aktien	STK		9.855	9.855	0	CHF 128,100	1.156.072,60	0,08
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK		19.934	0	0	CHF 111,140	2.028.823,17	0,15
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien	STK		2.867	0	0	CHF 469,700	1.233.183,21	0,09
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien	STK		12.464	5.558	2.972	CHF 95,920	1.094.828,16	0,08
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien	STK		5.369	0	0	CHF 494,600	2.431.794,47	0,17
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK		5.001	0	0	CHF 353,100	1.617.089,00	0,12
GBP								10.983.175,69	0,79
GB0002162385	Aviva PLC Reg.Shares	STK		300.708	0	0	GBP 3,547	1.176.437,61	0,08
GB00BHOP3Z91	BHP Group PLC Reg.Shares	STK		20.222	20.222	0	GBP 17,544	391.305,05	0,03
GB00BD6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares	STK		43.245	0	0	GBP 20,880	995.930,71	0,07
GB0002374006	Diageo PLC Reg.Shares	STK		38.624	0	0	GBP 35,245	1.501.472,88	0,11
GB00B19NLV48	Experian PLC Reg.Shares	STK		13.145	0	28.975	GBP 25,250	366.087,33	0,03
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC Reg.Shares	STK		114.224	72.059	0	GBP 17,170	2.163.168,69	0,16
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK		16.850	0	16.831	GBP 19,835	368.633,53	0,03
GB00B03MLX29	Royal Dutch Shell Reg.Shares Cl.A	STK		39.355	0	0	GBP 22,900	994.026,88	0,07
GB0009223206	Smith & Nephew PLC Reg.Shares	STK		92.803	0	0	GBP 19,630	2.009.301,20	0,14
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK		17.681	0	0	GBP 52,140	1.016.811,81	0,07
JPY								16.172.679,52	1,16
JP3429800000	ANA Holdings Inc. Reg.Shares	STK		48.000	19.100	0	JPY 3.632,000	1.483.016,46	0,11
JP3830800003	Bridgestone Corp. Reg.Shares	STK		32.400	32.400	0	JPY 4.053,000	1.117.070,31	0,08
JP3837800006	Hoya Corp. Reg.Shares	STK		23.000	0	11.900	JPY 8.649,000	1.692.203,65	0,12
JP3143600009	ITOCHU Corp. Reg.Shares	STK		96.300	16.100	0	JPY 2.118,500	1.735.456,17	0,12
JP3705200008	Japan Airlines Co. Ltd. Reg.Shares	STK		45.700	21.300	0	JPY 3.319,000	1.290.275,19	0,09
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares	STK		63.700	0	0	JPY 2.835,000	1.536.212,84	0,11
JP3898400001	Mitsubishi Corp. Reg.Shares	STK		58.200	0	0	JPY 2.585,000	1.279.800,94	0,09
JP3885780001	Mizuho Financial Group Inc. Reg.Shares	STK		324.700	0	0	JPY 154,700	427.298,63	0,03
JP3165650007	NTT Docomo Inc. Reg.Shares	STK		77.000	0	0	JPY 2.682,000	1.756.743,65	0,13
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares	STK		123.200	0	0	JPY 1.569,000	1.644.343,50	0,12
JP3421800008	Secom Co. Ltd. Reg.Shares	STK		5.600	5.600	0	JPY 9.064,000	431.784,27	0,03
JP3347200002	Shionogi & Co. Ltd. Reg.Shares	STK		7.400	0	0	JPY 5.695,000	358.496,02	0,03
JP3404600003	Sumitomo Corp. Reg.Shares	STK		36.600	0	0	JPY 1.592,500	495.814,73	0,04
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group Reg.Shares	STK		16.000	16.000	0	JPY 3.484,000	474.195,06	0,03
JP3633400001	Toyota Motor Corp. Reg.Shares	STK		7.600	7.600	0	JPY 6.960,000	449.968,10	0,03
USD								63.142.237,89	4,55
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares	STK		22.800	0	0	USD 84,820	1.752.114,16	0,13

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A		STK	8.700	0	4.500	USD 198,740	1.566.512,34	0,11
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares		STK	1.800	0	0	USD 286,630	467.437,37	0,03
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares		STK	39.136	0	20.264	USD 49,600	1.758.682,31	0,13
US0091581068	Air Products & Chemicals Inc. Reg.Shares		STK	6.020	0	9.780	USD 224,440	1.224.125,75	0,09
IE00BFRT3W74	Allegion PLC Reg.Shares		STK	8.300	0	0	USD 95,800	720.398,64	0,05
US0236081024	Ameren Corp. Reg.Shares		STK	16.900	6.300	0	USD 77,150	1.181.277,46	0,08
US0255371017	American Electric Power Co.Inc Reg.Shares		STK	9.400	9.400	0	USD 90,720	772.609,74	0,06
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	7.000	0	0	USD 206,980	1.312.670,44	0,09
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares		STK	8.700	0	0	USD 117,520	926.318,46	0,07
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	17.262	0	15.038	USD 47,270	739.274,96	0,05
US1258961002	CMS Energy Corp. Reg.Shares		STK	25.500	14.000	0	USD 63,030	1.456.185,73	0,10
US20825C1045	ConocoPhillips Reg.Shares		STK	15.500	0	0	USD 52,290	734.310,31	0,05
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares		STK	7.100	0	0	USD 121,840	783.749,94	0,06
US25746U1097	Dominion Energy Inc. Reg.Shares		STK	3.600	3.600	0	USD 77,760	253.622,65	0,02
US2333311072	DTE Energy Co. Reg.Shares		STK	19.600	0	0	USD 129,980	2.308.138,62	0,17
US26441C2044	Duke Energy Corp. (New) Reg.Shares New		STK	7.900	7.900	0	USD 92,760	663.922,08	0,05
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares		STK	13.900	0	0	USD 112,250	1.413.612,68	0,10
US29364G1031	Entergy Corp. Reg.Shares		STK	8.300	8.300	0	USD 113,020	849.889,92	0,06
US30161N1019	Exelon Corp. Reg.Shares		STK	50.300	0	0	USD 46,750	2.130.486,98	0,15
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares		STK	21.400	0	0	USD 68,430	1.326.751,53	0,10
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares		STK	37.400	0	0	USD 18,090	612.970,33	0,04
IE00B6330302	Ingersoll-Rand PLC Reg.Shares		STK	4.822	0	5.078	USD 120,180	525.035,52	0,04
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares		STK	6.980	6.980	0	USD 134,880	852.967,07	0,06
US46266C1053	IQVIA Holdings Inc. Reg.Shares		STK	7.122	0	6.278	USD 155,980	1.006.468,46	0,07
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	13.851	0	3.400	USD 128,240	1.609.288,55	0,12
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	13.800	0	4.200	USD 109,220	1.365.559,23	0,10
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	16.700	0	8.200	USD 99,200	1.500.919,59	0,11
US5797802064	McCormick & Co. Inc. Reg.Shares (non voting)		STK	4.200	0	8.200	USD 163,130	620.743,83	0,04
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares		STK	9.600	0	0	USD 220,540	1.918.173,50	0,14
US5526901096	MDU Resources Group Inc. Reg.Shares		STK	62.900	0	11.200	USD 26,810	1.527.836,01	0,11
IE00BTN1Y115	Medtronic PLC Reg.Shares		STK	15.300	0	0	USD 107,800	1.494.305,78	0,11
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	30.600	0	0	USD 86,720	2.404.196,60	0,17
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	4.900	0	0	USD 138,120	613.171,46	0,04
US6200763075	Motorola Solutions Inc. Reg.Shares		STK	3.051	0	6.149	USD 181,160	500.764,81	0,04
US65339F1012	Nextera Energy Inc. Reg.Shares		STK	10.256	0	3.244	USD 221,120	2.054.638,02	0,15
US68389X1054	Oracle Corp. Reg.Shares		STK	16.831	16.831	0	USD 52,160	795.383,88	0,06
US7234841010	Pinnacle West Capital Corp. Reg.Shares		STK	7.500	7.500	0	USD 95,280	647.429,22	0,05
US6934751057	PNC Financial Services Group Reg.Shares		STK	6.600	0	0	USD 128,300	767.184,60	0,06
US7445731067	Public Service Ent. Group Inc. Reg.Shares		STK	26.000	0	0	USD 60,080	1.415.248,02	0,10
US8168511090	Sempra Energy Reg.Shares		STK	4.900	0	0	USD 142,240	631.461,83	0,05
US8718291078	Sysco Corp. Reg.Shares		STK	34.900	0	0	USD 74,490	2.355.334,99	0,17
US00130H1059	The AES Corp. Reg.Shares		STK	124.500	7.600	0	USD 15,120	1.705.494,90	0,12
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares		STK	19.172	0	4.828	USD 102,220	1.775.548,67	0,13
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares		STK	35.500	0	0	USD 55,050	1.770.577,58	0,13
US4165151048	The Hartford Finl SvcsGrp Inc. Reg.Shares		STK	13.900	0	0	USD 58,660	738.730,69	0,05
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares		STK	13.700	1.400	0	USD 157,990	1.961.008,38	0,14
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	5.100	0	0	USD 227,320	1.050.357,42	0,08
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	5.500	5.500	0	USD 121,180	603.841,45	0,04
US8725401090	TJX Companies Inc. Reg.Shares		STK	12.300	0	0	USD 55,400	617.368,06	0,04
US9078181081	Union Pacific Corp. Reg.Shares		STK	6.900	0	0	USD 161,730	1.011.041,45	0,07
US94106L1098	Waste Management Inc. (Del.) Reg.Shares		STK	16.566	0	18.934	USD 119,320	1.790.854,02	0,13
US92939U1060	WEC Energy Group Inc. Reg.Shares		STK	6.400	0	0	USD 95,930	556.241,90	0,04
Verzinsliche Wertpapiere								687.563.594,08	49,30
EUR								583.243.891,58	41,80
XS0859920406	4,5000 % A2A S.p.A. MTN 12/19		EUR	7.500.000	0	0	% 101,098	7.582.350,00	0,54
XS1520897163	0,3750 % AbbVie Inc. Notes 16/19		EUR	2.500.000	0	0	% 100,080	2.502.000,00	0,18
FR0013182821	0,5000 % Air Liquide Finance MTN 16/22		EUR	800.000	0	0	% 102,215	817.720,00	0,06
XS0809847667	2,6250 % Akzo Nobel N.V. MTN 12/22		EUR	3.000.000	0	0	% 108,618	3.258.525,00	0,23
DE000A1G0RU9	3,5000 % Allianz Finance II B.V. MTN 12/22		EUR	4.000.000	0	0	% 109,731	4.389.240,00	0,31
FR0010870949	4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20		EUR	1.000.000	0	0	% 102,863	1.028.625,00	0,07
XS0907606379	2,7500 % Amcor Ltd. MTN 13/23		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 109,428	2.188.550,00	0,16
XS0967299016	1,8750 % American Honda Finance Corp. MTN 13/19		EUR	4.000.000	0	0	% 100,006	4.000.240,00	0,29
XS0829317832	2,1250 % Amgen Inc. Notes 12/19		EUR	2.500.000	0	0	% 100,058	2.501.450,00	0,18
XS0995040051	2,8750 % Anglo American Capital PLC MTN 13/20		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 103,424	1.861.623,00	0,13
XS1422919594	0,6250 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. MTN 16/21		EUR	2.000.000	0	0	% 101,627	2.032.540,00	0,15
XS0896144655	2,5000 % Atlas Copco AB MTN 13/23		EUR	500.000	0	0	% 110,322	551.607,50	0,04
XS0953783239	2,3750 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 13/20		EUR	1.500.000	0	0	% 102,377	1.535.655,00	0,11
FR0010491720	5,6250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 07/22 ¹⁾		EUR	2.150.000	0	0	% 117,010	2.515.704,25	0,18
XS0986174851	2,8750 % Autostrade per l'Italia S.p.A. MTN 13/21		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 104,184	2.604.600,00	0,19

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS1533918584	2,0000 % Azimut Holding S.p.A. Bonds 17/22		EUR	4.450.000	4.450.000	0	% 103,307	4.597.139,25	0,33
XS1107731702	1,3750 % Bank of America Corp. MTN 14/21		EUR	1.500.000	0	0	% 103,326	1.549.890,00	0,11
FR0010957662	3,6410 % Bouygues S.A. Obl. 10/19		EUR	2.500.000	0	0	% 100,598	2.514.950,00	0,18
XS1040506112	2,1770 % BP Capital Markets PLC MTN 14/21		EUR	3.000.000	0	0	% 105,144	3.154.320,00	0,23
DE0001135143	6,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 00/30		EUR	28.000.000	28.000.000	0	% 175,254	49.071.120,00	3,51
DE0001135044	6,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 97/27 ¹⁾		EUR	59.000.000	0	0	% 159,496	94.102.640,00	6,74
XS1317296421	1,1250 % Carnival Corp. Notes 15/19		EUR	2.500.000	0	0	% 100,235	2.505.875,00	0,18
XS1912654321	2,1250 % Castellum AB MTN 18/23		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 107,581	2.689.512,50	0,19
XS0458257796	5,0000 % CEZ AS MTN 09/21		EUR	2.500.000	0	0	% 110,840	2.770.987,50	0,20
XS1185597975	1,5000 % China Constr.Bk (Asia)Corp.Ltd MTN 15/20 ¹⁾		EUR	2.226.000	0	0	% 100,671	2.240.925,33	0,16
XS0443469316	7,3750 % Citigroup Inc. MTN 09/19		EUR	2.500.000	0	0	% 100,021	2.500.525,00	0,18
XS1128148845	1,3750 % Citigroup Inc. MTN 14/21		EUR	1.400.000	0	0	% 103,528	1.449.392,00	0,10
XS1377682676	1,8750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 16/24		EUR	2.500.000	0	0	% 110,412	2.760.287,50	0,20
FR0010967216	3,6000 % Danone S.A. MTN 10/20		EUR	3.000.000	0	0	% 104,889	3.146.655,00	0,23
XS1109110251	1,1250 % Deutsche Lufthansa AG MTN 14/19		EUR	4.500.000	0	0	% 100,035	4.501.575,00	0,32
XS0795877454	2,9500 % Deutsche Post Finance B.V. MTN 12/22		EUR	3.000.000	0	0	% 109,550	3.286.500,00	0,24
XS0525787874	4,2500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 10/22		EUR	3.000.000	0	0	% 112,863	3.385.875,00	0,24
XS1255436005	1,7000 % DH Europe Finance S.A. Notes 15/22		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 104,685	2.617.112,50	0,19
XS1395180802	2,6250 % Digital Euro Finco LLC Notes 16/24		EUR	9.000.000	9.000.000	0	% 111,145	10.003.050,00	0,72
XS1529859321	1,0000 % Ecolab Inc. Notes 16/24		EUR	1.000.000	0	0	% 104,795	1.047.950,00	0,08
XS0995380580	4,1250 % EDP Finance B.V. MTN 13/21		EUR	1.566.000	0	0	% 106,171	1.662.630,03	0,12
XS1578886258	0,8750 % Elisa Oyj MTN 17/24		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 103,495	2.069.900,00	0,15
XS0741137029	4,2500 % ENI S.p.A. MTN 12/20		EUR	7.400.000	0	0	% 101,909	7.541.266,00	0,54
XS0942094805	2,5000 % Essity AB MTN 13/23		EUR	2.000.000	0	0	% 110,680	2.213.590,00	0,16
FR0011660596	2,6250 % Eutelsat S.A. Bonds 13/20		EUR	3.800.000	0	0	% 100,304	3.811.552,00	0,27
XS0482908091	4,7500 % Experian Finance PLC MTN 10/20		EUR	600.000	0	0	% 102,152	612.912,00	0,04
XS1573192058	1,1250 % Fastighets AB Balder Notes 17/22 ¹⁾		EUR	2.500.000	0	0	% 102,625	2.565.612,50	0,18
XS0940284937	3,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 13/21		EUR	1.000.000	0	0	% 106,561	1.065.605,00	0,08
XS0629937409	4,0000 % Fortum Oyj MTN 11/21		EUR	4.000.000	0	0	% 107,524	4.300.940,00	0,31
XS1515216650	1,5000 % G4S International Finance PLC MTN 16/23 4		EUR	3.000.000	0	0	% 103,334	3.100.005,00	0,22
XS1147600305	0,6250 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 14/19		EUR	4.000.000	0	0	% 100,238	4.009.520,00	0,29
XS0974877150	3,3750 % Glencore Finance (Europe) Ltd. MTN 13/20		EUR	12.945.000	12.945.000	0	% 103,733	13.428.172,13	0,96
XS1956014531	1,6250 % Grenke Finance PLC MTN 19/24 ¹⁾		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 105,939	2.118.770,00	0,15
XS0458685913	8,5000 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 09/19		EUR	4.750.000	0	0	% 101,401	4.816.523,75	0,35
XS0811554962	2,1250 % Heineken N.V. MTN 12/20		EUR	3.000.000	0	0	% 102,234	3.067.005,00	0,22
XS0911691003	2,0000 % Heineken N.V. MTN 13/21 ¹⁾		EUR	2.900.000	0	0	% 103,839	3.011.331,00	0,22
FR0013064755	0,6250 % HSBC France S.A. MTN 15/20		EUR	1.000.000	0	0	% 101,319	1.013.185,00	0,07
XS1379182006	1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22		EUR	2.600.000	0	0	% 104,034	2.704.884,00	0,19
XS1191116174	1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22		EUR	3.000.000	0	0	% 104,376	3.131.280,00	0,22
XS1145526585	1,1250 % ISS Global A/S MTN 14/20		EUR	6.500.000	0	0	% 100,133	6.508.645,00	0,47
XS0496716282	5,3750 % Italcementi Finance S.A. MTN 10/20		EUR	5.250.000	0	0	% 102,970	5.405.925,00	0,39
XS0984367077	2,6250 % JPMorgan Chase & Co. MTN 13/21		EUR	500.000	0	0	% 104,888	524.440,00	0,04
BE6286238561	1,0000 % KBC Groep N.V. MTN 16/21		EUR	2.000.000	0	0	% 102,149	2.042.980,00	0,15
FR0012199008	1,3750 % Kering S.A. MTN 14/21		EUR	100.000	0	0	% 103,753	103.752,50	0,01
XS0677389347	4,5000 % Kon. KPN N.V. MTN 11/21		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 109,495	3.284.850,00	0,24
XS0752092311	4,2500 % Kon. KPN N.V. MTN 12/22		EUR	3.000.000	0	0	% 110,978	3.329.325,00	0,24
DE000A2AAPN5	0,1400 % Land Berlin FLR Landessch. Ausg.494 17/23 ¹⁾		EUR	5.000.000	0	0	% 102,425	5.121.250,00	0,37
DE000A161WS6	0,7500 % Land Berlin Landessch. Ausg.474 15/23		EUR	5.000.000	0	0	% 105,666	5.283.300,00	0,38
DE000A11QER4	1,6250 % Land Brandenburg MTN Landessch. 14/24		EUR	5.000.000	0	0	% 110,880	5.544.000,00	0,40
DE000NRW2319	1,8750 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1295 14/24 ¹⁾		EUR	5.000.000	0	0	% 111,525	5.576.250,00	0,40
XS1016363308	0,0000 % Landwirtschaftliche Rentenbank FLR MTN 14/21		EUR	10.000.000	0	0	% 100,780	10.077.950,00	0,72

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
FR0011625441	1,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 13/20		EUR	1.500.000	0	0	% 102,508	1.537.620,00	0,11
XS1109743960	1,0000 % Macquarie Bank Ltd. MTN 14/19		EUR	2.000.000	0	0	% 100,049	2.000.970,00	0,14
XS1169353338	1,1250 % Macquarie Bank Ltd. MTN 15/22		EUR	3.000.000	0	0	% 103,397	3.101.895,00	0,22
XS1237271009	1,1250 % McDonald's Corp. MTN 15/22		EUR	4.000.000	0	0	% 104,116	4.164.640,00	0,30
XS1403264374	1,0000 % McDonald's Corp. MTN 16/23		EUR	500.000	0	0	% 105,240	526.200,00	0,04
XS1346762641	1,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 16/21		EUR	15.000.000	15.000.000	0	% 102,472	15.370.725,00	1,10
XS1689739347	0,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 17/22		EUR	2.000.000	0	0	% 101,178	2.023.550,00	0,15
IT0004608797	4,5000 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Obbl. 10/20		EUR	1.950.000	1.950.000	0	% 103,285	2.014.057,50	0,14
XS1928480166	1,6000 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Preferred MTN 19/24		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 103,385	2.067.690,00	0,15
XS0497186758	4,5000 % Merck Financial Services GmbH MTN 10/20		EUR	500.000	0	0	% 102,671	513.352,50	0,04
XS1284576581	0,7500 % Merck Financial Services GmbH MTN 15/19		EUR	1.000.000	0	0	% 100,009	1.000.085,00	0,07
XS1416688890	2,3750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. MTN 16/22		EUR	2.000.000	0	0	% 106,321	2.126.420,00	0,15
XS1143974159	2,0000 % mFinance France S.A. MTN 14/21		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 103,330	2.583.250,00	0,19
XS1496343986	1,3980 % mFinance France S.A. MTN 16/20		EUR	2.000.000	0	0	% 101,085	2.021.700,00	0,14
XS1003251441	2,3750 % Mondelez International Inc. Notes 13/21		EUR	4.500.000	0	0	% 103,732	4.667.917,50	0,33
XS0945158821	2,2500 % Morrison Supermarkets PLC, Wm. MTN 13/20 ¹⁾		EUR	1.500.000	0	0	% 101,884	1.528.260,00	0,11
XS1188094673	0,7500 % National Grid North Amer. Inc. MTN 15/22		EUR	2.000.000	0	0	% 102,276	2.045.520,00	0,15
XS1204254715	1,0000 % NN Group N.V. MTN 15/22 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 103,276	1.032.760,00	0,07
DE000NWB17V0	0,3460 % NRW.BANK FLR IHS Ausg.17V 17/21		EUR	44.000.000	0	0	% 101,416	44.623.040,00	3,19
DE000NWB18A2	0,4300 % NRW.BANK FLR IHS Ausg.18A 17/22		EUR	30.000.000	0	0	% 102,463	30.738.900,00	2,19
XS0690406243	4,2500 % OMV AG MTN 11/21		EUR	1.100.000	0	0	% 109,814	1.207.948,50	0,09
XS0834367863	2,6250 % OMV AG MTN 12/22		EUR	2.000.000	0	0	% 109,490	2.189.800,00	0,16
XS0996734868	1,7500 % OMV AG MTN 13/19		EUR	3.958.000	0	0	% 100,480	3.976.998,40	0,29
XS0541498837	3,5000 % Optus Finance Pty Ltd. MTN 10/20		EUR	2.000.000	0	0	% 103,893	2.077.850,00	0,15
XS0841018004	2,8750 % Origin Energy Finance Ltd. MTN 12/19		EUR	6.000.000	0	0	% 100,321	6.019.230,00	0,43
XS1082660744	2,5000 % ORLEN Capital AB Notes 14/21		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 104,598	2.614.937,50	0,19
XS1650147660	0,7500 % Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski MTN 17/21		EUR	15.000.000	15.000.000	0	% 101,472	15.220.800,00	1,09
XS0832466931	3,3750 % Rentokil Initial PLC MTN 12/19		EUR	7.000.000	0	0	% 100,199	7.013.895,00	0,50
XS1334225361	2,1250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 15/20		EUR	2.000.000	0	0	% 103,148	2.062.950,00	0,15
XS1496344794	0,2500 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19		EUR	3.400.000	0	0	% 100,039	3.401.326,00	0,24
XS0969523843	3,2500 % Scentre Group MTN 13/23 Reg. S ¹⁾		EUR	2.500.000	0	0	% 113,623	2.840.562,50	0,20
FR0011561000	2,5000 % Schneider Electric SE MTN 13/21		EUR	3.000.000	0	0	% 105,955	3.178.650,00	0,23
XS1327531486	1,6250 % SKF AB Notes 15/22		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 105,540	2.638.487,50	0,19
XS1109741246	1,5000 % Sky PLC MTN 14/21		EUR	3.000.000	0	0	% 103,593	3.107.775,00	0,22
XS0853682069	3,5000 % Snam S.p.A. MTN 12/20		EUR	2.500.000	0	0	% 101,718	2.542.950,00	0,18
XS1434560642	1,0000 % Southern Power Co. Notes S.2016A 16/22		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 103,235	2.580.875,00	0,19
XS1287779208	1,7500 % SSE PLC MTN 15/23		EUR	700.000	0	0	% 107,848	754.932,50	0,05
XS1130340091	1,5000 % Stockland Trust Management Ltd MTN 14/21		EUR	1.549.000	0	0	% 103,286	1.599.900,14	0,11
XS1907150350	1,1250 % Tele2 AB MTN 18/24		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 104,915	3.147.435,00	0,23
XS0462999573	4,6930 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 09/19		EUR	7.700.000	0	0	% 100,933	7.771.802,50	0,56
XS0798790027	2,7500 % Telenor ASA MTN 12/22		EUR	1.000.000	0	0	% 108,890	1.088.900,00	0,08
XS0706229555	3,7500 % Telstra Corp. Ltd. FLR MTN 11/22		EUR	1.000.000	0	0	% 110,985	1.109.850,00	0,08
XS1375980197	0,6250 % The Toronto-Dominion Bank MTN 16/21		EUR	3.000.000	0	0	% 101,468	3.044.025,00	0,22
XS1107890763	1,0000 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 14/21		EUR	1.100.000	0	0	% 102,586	1.128.446,00	0,08
XS1171489393	0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 15/22 ¹⁾		EUR	2.200.000	0	0	% 102,983	2.265.615,00	0,16
XS0210237011	4,2500 % United Utilities Water Ltd. MTN 05/20		EUR	3.500.000	0	0	% 101,734	3.560.672,50	0,26
FR0010830034	4,8750 % Vivendi S.A. MTN 09/19		EUR	7.700.000	0	0	% 101,244	7.795.749,50	0,56
XS0968433135	2,2500 % Wells Fargo & Co. MTN 13/20		EUR	1.500.000	0	0	% 102,566	1.538.490,00	0,11

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS0907301260	2,8750 % Wolters Kluwer N.V. Notes 13/23		EUR	400.000	0	0	% 111,216	444.864,00	0,03
XS1378780891	2,2500 % Xylem Inc. Notes 16/23		EUR	1.226.000	0	0	% 107,305	1.315.559,30	0,09
USD								104.319.702,50	7,50
US00287YAU38	2,3000 % AbbVie Inc. Notes 16/21		USD	2.000.000	0	0	% 100,403	1.819.306,91	0,13
US02364WAV72	5,0000 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 10/20		USD	857.000	0	2.143.000	% 101,590	788.789,40	0,06
US02364WBD65	3,1250 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 12/22		USD	1.000.000	0	0	% 102,842	931.746,32	0,07
US034863AG56	4,1250 % Anglo American Capital PLC Notes 12/22 144A		USD	5.000.000	0	0	% 104,340	4.726.613,82	0,34
US034863AM25	4,1250 % Anglo American Capital PLC Notes 14/21 144A		USD	2.500.000	0	0	% 102,298	2.317.044,17	0,17
US94973VAW72	3,7000 % Anthem Inc. Notes 11/21		USD	2.000.000	0	0	% 102,663	1.860.267,27	0,13
US94973VAX55	3,1250 % Anthem Inc. Notes 12/22		USD	3.000.000	0	0	% 102,509	2.786.201,59	0,20
US00182EBC21	2,8750 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. MTN 17/22 144A		USD	1.920.000	0	0	% 101,782	1.770.513,98	0,13
US00185AAD63	4,0000 % AON PLC Notes 13/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 106,825	2.419.592,30	0,17
US053332AM44	3,7000 % AutoZone Inc. Notes 12/22		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 103,617	2.346.930,92	0,17
US05964HAC97	3,5000 % Banco Santander S.A. 2nd Ranking Notes 17/22		USD	1.600.000	0	0	% 102,997	1.493.041,00	0,11
US05968LAG77	5,9500 % Bancolombia S.A. Notes 11/21		USD	5.000.000	0	0	% 105,740	4.790.011,33	0,34
US07177MAL72	3,6000 % Baxalta Inc. Notes 15/22		USD	745.000	0	0	% 102,598	692.507,45	0,05
US120568AY67	3,0000 % Bunge Ltd. Finance Corp. Notes 17/22		USD	500.000	0	2.500.000	% 101,445	459.547,00	0,03
US13645RAP91	4,5000 % Canadian Pacific Railway Co. Notes 11/22		USD	1.000.000	0	0	% 105,230	953.390,71	0,07
US14040HBR57	2,4000 % Capital One Financial Corp. Notes 17/20		USD	4.950.000	0	0	% 100,260	4.496.393,88	0,32
US22822VAD38	2,2500 % Crown Castle Internatl Corp. Notes 16/21		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 99,538	2.254.541,34	0,16
US279158AC30	5,8750 % Ecopetrol S.A. Notes 13/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 111,550	2.526.613,82	0,18
US30161MAF05	5,2000 % Exelon Generation Co. LLC Notes 09/19		USD	8.000.000	0	0	% 100,212	7.263.347,68	0,52
US30161MAR43	3,4000 % Exelon Generation Co. LLC Notes 17/22		USD	1.800.000	0	0	% 102,759	1.675.794,70	0,12
US364760AK48	5,9500 % Gap Inc. Notes 11/21		USD	1.000.000	0	0	% 104,492	946.699,89	0,07
US370334CA00	2,6000 % General Mills Inc. Notes 17/22		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 101,248	2.293.272,93	0,16
US42824CAG42	3,6000 % Hewlett Packard Enterprise Co. Notes 16/20		USD	2.500.000	0	0	% 101,333	2.295.209,51	0,16
US404280AK50	5,1000 % HSBC Holdings PLC Notes 11/21		USD	5.000.000	0	0	% 104,378	4.728.335,22	0,34
US46625HHS22	4,4000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 10/20		USD	700.000	0	0	% 102,070	647.326,39	0,05
US46625HJD35	4,5000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 12/22		USD	1.000.000	0	0	% 105,770	958.278,60	0,07
US58013MEL46	3,6250 % McDonald's Corp. MTN 11/21		USD	1.000.000	0	0	% 102,979	932.992,07	0,07
US61747YCM57	5,5000 % Morgan Stanley MTN S.F 10/20		USD	8.000.000	0	0	% 101,277	7.340.611,55	0,53
US637071AJ02	2,6000 % National Oilwell Varco Inc. Notes 12/22		USD	2.500.000	0	0	% 100,048	2.266.104,19	0,16
US65557CAD56	4,8750 % Nordea Bank Abp MTN 11/21 144A		USD	1.100.000	0	0	% 103,709	1.033.566,48	0,07
US655664AP58	4,0000 % Nordstrom Inc. Notes 11/21		USD	500.000	0	0	% 103,064	466.881,09	0,03
US655844BJ66	3,0000 % Norfolk Southern Corp. Notes 12/22		USD	1.000.000	0	0	% 102,266	926.527,75	0,07
US674599BY08	4,1000 % Occidental Petroleum Corp. Notes 10/21		USD	2.350.000	0	0	% 101,873	2.168.989,85	0,16
US682680AQ69	4,2500 % Oneok Inc. (New) Notes 12/22		USD	2.500.000	0	0	% 103,766	2.350.317,10	0,17
US714046AE97	5,0000 % PerkinElmer Inc. Notes 11/21		USD	815.000	0	0	% 105,260	777.227,57	0,06
US75625QAC33	2,3750 % Reckitt Benckiser Treas. Serv. Notes 17/22 144A		USD	3.000.000	0	0	% 100,509	2.731.827,86	0,20
US74949LAB80	3,5000 % RELX Capital Inc. Notes 18/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 104,232	2.360.849,38	0,17
US824348AT35	2,2500 % Sherwin-Williams Co. Notes 17/20		USD	1.800.000	0	0	% 99,929	1.629.646,21	0,12
US834423AA33	3,4000 % Solvay Finance (America) LLC Notes 15/20 144A		USD	550.000	0	0	% 101,121	503.889,69	0,04
US71644EAB83	9,2500 % Suncor Energy Inc. Debts 91/21		USD	2.500.000	0	0	% 114,127	2.584.971,69	0,19
US87938WAP86	5,4620 % Telefonica Emisiones S.A.U. Notes 11/21		USD	1.700.000	0	0	% 104,625	1.611.430,58	0,12
US38141GG575	5,7500 % The Goldman Sachs Group Inc. Notes 12/22		USD	1.000.000	0	0	% 107,997	978.455,27	0,07
US416518AB42	5,1250 % The Hartford Finl SvcsGrp Inc. Notes 12/22		USD	4.000.000	0	0	% 108,234	3.922.406,34	0,28
US89153VAB53	2,8750 % Total Capital Intl S.A. Notes 12/22		USD	2.550.000	0	0	% 102,124	2.359.376,67	0,17
US911308AA21	8,3750 % Utd Parcel Service of Am. Inc. Debts 89/20		USD	200.000	0	0	% 103,539	187.613,14	0,01
US928563AA33	2,3000 % VMware Inc. Notes 17/20		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 100,021	2.265.469,99	0,16

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US928563AB16	2,9500 % VMware Inc. Notes 17/22		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 101,597	2.301.177,80	0,16
US42217KBA34	3,7500 % Welltower Inc. Notes 12/23		USD	2.500.000	0	0	% 104,991	2.378.052,10	0,17
Sonstige Beteiligungswertpapiere								2.133.777,63	0,15
CHF								2.133.777,63	0,15
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	8.606	0	0	CHF 270,750	2.133.777,63	0,15
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								198.066.308,81	14,21
Verzinsliche Wertpapiere								198.066.308,81	14,21
EUR								67.942.816,50	4,88
ES0211845252	4,7500 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 12/19		EUR	900.000	0	0	% 100,705	906.345,00	0,06
ES0211845260	3,7500 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 13/23		EUR	2.000.000	0	0	% 114,372	2.287.440,00	0,16
DE000DK0Q3Q9	2,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Indexanl. SX5E 19/20		EUR	5.000.000	5.000.000	0	% 99,880	4.994.000,00	0,36
XS0416848520	5,6250 % Equinor ASA MTN 09/21		EUR	1.500.000	0	0	% 109,237	1.638.547,50	0,12
XS1378895954	1,7500 % Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV Notes 16/23		EUR	4.500.000	0	0	% 106,038	4.771.687,50	0,34
DE000A13SL42	0,0000 % Investitionsbank Schleswig-Hol. FLR IHS S.1 14/19		EUR	13.200.000	0	0	% 100,127	13.216.698,00	0,95
XS1731617194	0,0000 % Johnson Controls Internat. PLC Notes 17/20		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 100,234	2.505.837,50	0,18
XS1196817156	1,5000 % Kinder Morgan Inc. Notes 15/22		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 104,196	2.604.887,50	0,19
XS1373987707	1,8750 % LYB International Fin. II B.V. Notes 16/22		EUR	2.500.000	0	0	% 104,282	2.607.050,00	0,19
XS1137512668	1,5000 % Mölnlycke Holding AB Notes 14/22		EUR	1.000.000	0	0	% 104,252	1.042.515,00	0,07
XS1051934831	2,8750 % ProLogis Intl Funding II S.A. MTN 14/22		EUR	2.000.000	0	0	% 108,258	2.165.150,00	0,16
XS1087819634	1,5000 % Scentre Management Ltd. MTN 14/20		EUR	15.000.000	15.000.000	0	% 101,063	15.159.375,00	1,09
XS1418774706	2,1250 % Trinity Acquisition PLC Notes 16/22		EUR	6.200.000	5.500.000	0	% 105,333	6.530.646,00	0,47
XS1321974740	0,7500 % WPP Finance 2013 MTN 15/19		EUR	7.500.000	0	0	% 100,169	7.512.637,50	0,54
USD								130.123.492,31	9,33
US025816BS73	3,4000 % American Express Co. Notes 18/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 104,357	2.363.691,96	0,17
US03027XAB64	3,5000 % American Tower Corp. Notes 13/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 103,903	2.353.408,83	0,17
US03027XAQ34	3,0000 % American Tower Corp. Notes 17/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 102,753	2.327.372,59	0,17
US00205GAA58	3,8750 % APT Pipelines Ltd. Notes 12/22 144A		USD	1.651.000	0	0	% 104,248	1.559.344,26	0,11
US05253JAK79	2,7000 % Aus.& N.Z.Bkg Gr.Ltd.(NY.Br.) MTN 15/20		USD	5.000.000	0	0	% 100,833	4.567.746,32	0,33
US05253JAS06	2,6250 % Aus.& N.Z.Bkg Gr.Ltd.(NY.Br.) MTN 17/22		USD	900.000	0	0	% 101,735	829.553,34	0,06
US06051GFT13	2,6250 % Bank of America Corp. Notes 15/20		USD	1.000.000	0	0	% 100,703	912.371,46	0,07
US06367TYL87	2,1000 % Bank of Montreal MTN 17/20		USD	500.000	0	0	% 100,073	453.332,28	0,03
US06367WHH97	3,3000 % Bank of Montreal MTN 19/24		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 104,653	2.370.407,70	0,17
US07274EAD58	2,3750 % Bayer US Finance LLC Notes 14/19 144A		USD	5.000.000	0	0	% 99,973	4.528.788,22	0,32
US075887BE86	2,6750 % Becton, Dickinson & Co. Notes 14/19		USD	11.000.000	0	0	% 100,014	9.967.420,16	0,71
US101137AN70	4,1250 % Boston Scientific Corp. Notes 13/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 106,785	2.418.686,30	0,17
US11133TAB98	3,9500 % Broadridge Financial Solutions Notes 13/20		USD	2.450.000	0	0	% 101,496	2.252.923,44	0,16
US12673PAH82	3,6000 % CA Inc. Notes 17/22		USD	1.000.000	0	0	% 101,835	922.627,41	0,07
US136069TY74	2,5500 % Canadian Imperial Bk of Comm. Notes 17/22		USD	2.500.000	0	0	% 101,634	2.302.027,18	0,17
US151020AX24	2,7500 % Celgene Corp. Notes 17/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 102,148	2.313.657,98	0,17
US25156PAY97	2,8200 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. Notes 17/22 144A		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 101,306	2.294.597,96	0,16
US254709AJ71	3,8500 % Discover Financial Services Notes 12/22		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 104,813	2.374.022,65	0,17
US23341CAA18	2,3750 % DNB Bank ASA MTN 16/21 144A		USD	375.000	0	0	% 100,360	340.972,26	0,02
US256746AF59	3,7000 % Dollar Tree Inc. Notes 18/23		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 104,024	2.356.138,17	0,17
US278642AR47	2,1500 % eBay Inc. Notes 17/20		USD	1.000.000	0	0	% 100,065	906.591,17	0,07
US29278GAB41	2,8750 % ENEL Finance Intl N.V. Notes 17/22 144A		USD	1.000.000	0	0	% 101,149	916.416,76	0,07
US29364GAH65	4,0000 % Entergy Corp. Notes 15/22		USD	1.100.000	0	0	% 104,745	1.043.892,28	0,07
US313747AU17	3,9500 % Federal Realty Invest. Trust Notes 13/24		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 107,225	1.942.912,80	0,14
US337738AQ13	3,8000 % Fiserv Inc. Notes 18/23		USD	900.000	0	0	% 106,115	865.263,87	0,06

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US380956AF94	3,6250 % Goldcorp Inc. Notes 14/21		USD	1.400.000	0	0	% 101,721	1.290.232,39	0,09
US418056AT46	3,1500 % Hasbro Inc. Notes 14/21		USD	1.000.000	0	0	% 100,867	913.857,30	0,07
DE000TR39ZY4	4,5000 % HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Indexanl. S500 19/20		USD	5.500.000	5.500.000	0	% 99,845	4.975.288,79	0,36
US45326TAA60	6,0000 % Incitec Pivot Finance LLC Notes 09/19 144A		USD	1.850.000	0	0	% 100,925	1.691.608,15	0,12
US48127HAA77	2,2000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 14/19		USD	1.000.000	0	0	% 100,002	906.015,86	0,06
US55608JAC27	6,0000 % Macquarie Group Ltd. MTN 10/20 144A		USD	2.500.000	0	0	% 101,351	2.295.617,21	0,16
US571903AM51	3,1250 % Marriott International Inc. Notes S.N 14/21		USD	2.000.000	0	0	% 101,205	1.833.848,24	0,13
US579780AH00	3,9000 % McCormick & Co. Inc. Notes 11/21		USD	2.000.000	0	0	% 102,433	1.856.090,60	0,13
US63254AAW80	2,5000 % Natl Austr.Bank Ltd. (NY Br.) MTN 17/22		USD	5.000.000	0	0	% 101,375	4.592.321,63	0,33
US65120FAC86	4,2000 % Newcrest Finance Pty Ltd. Notes 12/22 144A		USD	3.000.000	0	0	% 104,889	2.850.876,56	0,20
US67066GAD60	2,2000 % NVIDIA Corp. Notes 16/21		USD	1.000.000	0	0	% 100,280	908.543,60	0,07
US68620YAA01	5,4500 % Origin Energy Finance Ltd. Notes 11/21 144A		USD	2.500.000	0	0	% 105,984	2.400.532,28	0,17
US686330AH40	2,9000 % ORIX Corp. Notes 17/22		USD	5.000.000	0	0	% 102,011	4.621.109,85	0,33
US714264AA62	5,7500 % Pernod-Ricard S.A. Notes 11/21 144A		USD	1.000.000	0	0	% 105,487	955.714,61	0,07
US714264AD02	4,4500 % Pernod-Ricard S.A. Notes 11/22 144A		USD	1.000.000	0	0	% 105,211	953.214,04	0,07
US69362BAW28	5,1250 % PSEG Power LLC Notes 10/20		USD	4.000.000	0	0	% 101,740	3.687.048,70	0,26
US747525AD56	2,2500 % QUALCOMM Inc. Notes 15/20		USD	2.200.000	0	0	% 100,157	1.996.344,28	0,14
US74947LAA26	5,2500 % REC Ltd. MTN 18/23 144A		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 108,093	2.448.312,57	0,18
US80282KAT34	3,7000 % Santander Holdings USA Inc. Notes 17/22		USD	3.400.000	0	0	% 102,524	3.158.157,19	0,23
US806851AC55	3,0000 % Schlumberger Holdings Corp. Notes 15/20 144A		USD	1.450.000	0	0	% 101,052	1.327.523,44	0,10
US816851AT63	2,8750 % Sempra Energy Notes 12/22		USD	2.500.000	0	0	% 101,487	2.298.697,62	0,16
US82620KAR41	2,7000 % Siemens Finan.maatschappij NV Notes 17/22 144A		USD	2.500.000	0	0	% 101,634	2.302.027,18	0,17
US830505AR41	2,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken Notes 16/21		USD	1.500.000	0	0	% 100,737	1.369.019,25	0,10
US86960BAQ59	1,8750 % Svenska Handelsbanken AB MTN 16/21		USD	500.000	0	0	% 99,615	451.257,08	0,03
US87020PAH01	2,8000 % Swedbank AB MTN 17/22 144A		USD	2.000.000	0	0	% 101,032	1.830.695,36	0,13
US874060AC01	2,4500 % Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. Notes 17/22 144A		USD	4.000.000	0	0	% 100,325	3.635.768,97	0,26
US064159MK98	3,4000 % The Bank of Nova Scotia Bank Notes 19/24		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 105,344	2.386.047,57	0,17
US064159FL54	2,8000 % The Bank of Nova Scotia Notes 14/21		USD	2.500.000	0	0	% 101,532	2.299.716,87	0,16
US61945CAF05	3,2500 % The Mosaic Co. Notes 17/22		USD	2.500.000	0	0	% 102,255	2.316.081,54	0,17
US902674XF24	2,2000 % UBS AG (London Branch) Notes 17/20 144A		USD	2.500.000	0	0	% 100,443	2.275.050,96	0,16
US92345YAA47	5,8000 % Verisk Analytics Inc. Notes 11/21		USD	300.000	300.000	0	% 105,603	287.029,67	0,02
US92343VER15	4,3290 % Verizon Communications Inc. Notes 18/28		USD	5.061.000	0	0	% 114,634	5.256.264,05	0,38
US949746RS22	2,5000 % Wells Fargo & Co. Notes 16/21		USD	1.000.000	0	0	% 100,782	913.091,73	0,07
US980888AF86	4,5500 % Woolworths Group Ltd. Notes 11/21 144A		USD	1.450.000	0	0	% 103,244	1.356.319,82	0,10
Nichtnotierte Wertpapiere								14.313.728,00	1,03
Verzinsliche Wertpapiere								14.313.728,00	1,03
EUR								14.313.728,00	1,03
XS1821532493	0,0200 % Toyota Industries Fin. Intl AB MTN 18/21		EUR	14.300.000	0	0	% 100,096	14.313.728,00	1,03
Wertpapier-Investmentanteile								131.308.316,23	9,40
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								92.784.667,00	6,65
EUR								92.784.667,00	6,65
DE000ETFL268	Deka MSCI USA UCITS ETF		ANT	3.480.000	0	0	EUR 25,278	87.967.440,00	6,30
DE0005424568	Deka-BR 45		ANT	78.700	78.700	0	EUR 61,210	4.817.227,00	0,35
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								38.523.649,23	2,75
EUR								38.523.649,23	2,75
LU1685588649	Deka-MultiFactor Global Government Bonds I		ANT	50.900	0	0	EUR 102,110	5.197.399,00	0,37
LU0297135294	Deka-OptiRent 3y CF		ANT	273.637	0	0	EUR 121,790	33.326.250,23	2,38
Summe Wertpapiervermögen²⁾								EUR 1.159.687.061,08	83,17
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
				Anzahl -41				-118.855,49	0,00
	DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 19	XEUR	EUR					-53.710,00	0,00
	E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 19	XCME	USD	Anzahl -229				-453.361,71	-0,03
	FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 19	IFEU	GBP	Anzahl 115				-84.349,44	-0,01
	OMX Index Future (O30) Sep. 19	XNDX	SEK	Anzahl 267				170.348,32	0,01
	OMXC25 Index Future (OMW) Sep. 19	XNDX	DKK	Anzahl 192				77.254,26	0,01
	S&P 500 ST Future (SP) Sep. 19	XIOM	USD	Anzahl 46				498.006,80	0,04
	S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 19	XMOD	CAD	Anzahl 84				111.251,59	0,01
	SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 19	XSFE	AUD	Anzahl 83				89.224,31	0,01
	Swiss Market Index Future (S30) Sep. 19	XEUR	CHF	Anzahl -27				-93.782,48	-0,01
	Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 19	XOSE	JPY	Anzahl 93				-379.737,14	-0,03
	Summe Aktienindex-Derivate						EUR	-118.855,49	0,00
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
				15.000.000				2.035.878,70	0,15
	10 Year Spanish Bono Futures (FBN) Sep. 19	XEUR	EUR					1.071.985,67	0,08
	EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 19	XEUR	EUR	-104.500.000				-2.148.600,00	-0,15
	EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 19	XEUR	EUR	-135.000.000				-597.000,00	-0,04
	EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 19	XEUR	EUR	12.000.000				1.977.450,00	0,14
	Five-Year US Treasury Note Future (FV) Dez. 19	XCBT	USD	-4.400.000				3.114,36	0,00
	Long Gilt Future (FLG) Dez. 19	IFEU	GBP	24.500.000				297.249,75	0,02
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 19	XEUR	EUR	18.000.000				1.404.400,00	0,10
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Dez. 19	XCBT	USD	5.600.000				-6.738,39	0,00
	Two-Year US Treasury Note Future (TU) Dez. 19	XCBT	USD	-106.800.000				34.017,31	0,00
	Optionsrechte							82.650,00	0,01
	Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte							82.650,00	0,01
	EURO Bund Future (FGBL) Call Okt. 19 175,50	XEUR	EUR	Anzahl 885			EUR 0,093	82.650,00	0,01
	Summe Zins-Derivate						EUR	2.118.528,70	0,16
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)									
								107.650,07	0,01
	Offene Positionen								
	CHF/EUR 3.000.000,00		OTC					7.126,76	0,00
	USD/EUR 4.000.000,00		OTC					100.523,31	0,01
	Devisenterminkontrakte (Verkauf)							-8.185.642,99	-0,58
	Offene Positionen								
	CHF/EUR 16.000.000,00		OTC					-326.249,51	-0,02
	GBP/EUR 12.000.000,00		OTC					278.166,37	0,02
	JPY/EUR 2.000.000.000,00		OTC					-471.346,25	-0,03
	USD/EUR 349.000.000,00		OTC					-7.666.213,60	-0,55
	Summe Devisen-Derivate						EUR	-8.077.992,92	-0,57
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Credit Default Swaps (CDS)									
								-4.851,45	0,00
	Protection Buyer							-4.851,45	0,00
	CDS CDX.NA.IG. S31 V1 5Y / BNP_PAR 20.12.2023	OTC	USD	100.000				-2.170,67	0,00
	CDS ITRAXX EUROPE S30 V2 5Y / MERRILL_LDN 20.12.2023	OTC	EUR	100.000				-2.680,78	0,00
	Summe Swaps						EUR	-4.851,45	0,00
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	137.449.457,51			% 100,000	137.449.457,51	9,85
EUR-Guthaben bei									
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	40.912.464,60			% 100,000	40.912.464,60	2,92
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	2.725.922,97			% 100,000	365.606,16	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	3.315.801,44			% 100,000	3.657.221,34	0,26
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	4.519.365,72			% 100,000	449.464,52	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	12.574.749,77			% 100,000	1.162.724,55	0,08
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	4.199.668,29			% 100,000	2.557.085,84	0,18
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	4.575.545,18			% 100,000	3.115.126,94	0,22
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	1.511.903,68			% 100,000	1.384.533,52	0,10
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	927.620,09			% 100,000	107.146,42	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	303.484.412,00			% 100,000	2.581.637,63	0,19
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SGD	723.898,01			% 100,000	472.394,94	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	23.800.718,52			% 100,000	21.563.504,89	1,54
	Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR	215.778.368,86	15,44
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	9.760.096,50				9.760.096,50	0,70

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Dividendenansprüche		EUR	240.276,09				240.276,09	0,02
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	7.804.522,08				7.804.522,08	0,55
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	10.976,00				10.976,00	0,00
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	5.061,60				5.061,60	0,00
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	2.429.574,61				2.429.574,61	0,17
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	272.070,96				272.070,96	0,02
	Forderungen aus Ersatzleistung Zinsen/Dividenden		EUR	191.575,00				191.575,00	0,01
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	6.370.000,00				6.370.000,00	0,46
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	27.084.152,84	1,93
	Sonstige Verbindlichkeiten								
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-1.152,46				-1.152,46	0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-480.289,72				-480.289,72	-0,03
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-1.328.560,39				-1.328.560,39	-0,10
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-1.810.002,57	-0,13
	Fondsvermögen						EUR	1.394.656.409,05	100,00
	Umlaufende Anteile Klasse CF						STK	22.752.063,000	
	Umlaufende Anteile Klasse D						STK	1.137.550,000	
	Anteilwert Klasse CF						EUR	56,34	
	Anteilwert Klasse D						EUR	99,25	

*) 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 in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
5,6250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 07/22	EUR 882.000		1.032.023,79	
6,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 97/27	EUR 59.000.000		94.102.640,00	
1,5000 % China Constr.Bk (Asia)Corp.Ltd MTN 15/20	EUR 500.000		503.352,50	
1,1250 % Fastighets AB Balder Notes 17/22	EUR 2.500.000		2.565.612,50	
1,6250 % Grenke Finance PLC MTN 19/24	EUR 297.000		314.637,35	
2,0000 % Heineken N.V. MTN 13/21	EUR 2.280.000		2.367.529,20	
0,1400 % Land Berlin FLR Landessch. Ausg.494 17/23	EUR 500.000		512.125,00	
1,8750 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1295 14/24	EUR 400.000		446.100,00	
2,2500 % Morrison Supermarkets PLC, Wm. MTN 13/20	EUR 1.450.000		1.477.318,00	
1,0000 % NN Group N.V. MTN 15/22	EUR 436.000		450.283,36	
3,2500 % Scentre Group MTN 13/23 Reg.S	EUR 608.000		690.824,80	
0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 15/22	EUR 500.000		514.912,50	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		104.977.359,00	104.977.359,00

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.08.2019

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,90665 = 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45590 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,05500 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	10,81490 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,09200 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10375 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46882 = 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,53240 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	117,55500 = 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,65750 = 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,64237 = 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)
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options
XNDX	Stockholm - Nasdaq Stockholm - Derivatives

OTC Over-the-Counter

Deka-Stiftungen Balance

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				
CH0432492467	Alcon AG Namens-Aktien	STK	4.101	4.101
CH0012410517	Bâloise Holding AG Namens-Aktien	STK	0	8.987
CH0012271687	Helvetia Holding AG Namens-Aktien	STK	522	1.971
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK	20.506	41.012
EUR				
DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien	STK	24.000	24.000
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien	STK	385.000	385.000
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK	0	4.211
PTGAL0AM0009	Galp Energia SGPS S.A. Acções Nominativas	STK	0	50.136
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien	STK	66.000	66.000
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK	455.000	455.000
FR0013326246	Unib.-Rod.-Westf.SE/WFD UR NV Stapled Shares	STK	20.000	20.000
NL0000009355	Unilever N.V. Cert.v.Aand.	STK	0	13.791
GBP				
GB0031215220	Carnival PLC Reg.Shares	STK	0	6.686
GB0008847096	Tesco PLC Reg.Shares	STK	0	137.189
JPY				
JP3246400000	Kyushu Electric Power Co. Inc. Reg.Shares	STK	63.000	63.000
JP3877600001	Marubeni Corp. Reg.Shares	STK	0	127.200
JP3893600001	Mitsui & Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	43.300
JP3672400003	Nissan Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	107.900
JP3422950000	Seven & I Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	53.900
JP3435000009	SONY Corp. Reg.Shares	STK	0	18.500
USD				
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	10.900
US0394831020	Archer Daniels Midland Co. Reg.Shares	STK	0	41.800
US1924461023	Cognizant Technology Sol.Corp. Reg.Shs Cl.A	STK	0	16.800
US2003401070	Comerica Inc. Reg.Shares	STK	0	17.300
US2788651006	Ecolab Inc. Reg.Shares	STK	0	12.400
US2910111044	Emerson Electric Co. Reg.Shares	STK	0	18.700
US3719011096	Gentex Corp. Reg.Shares	STK	0	42.900
US45866F1049	Intercontinental Exchange Inc. Reg.Shares	STK	0	9.200
US4878361082	Kellogg Co. Reg.Shares	STK	0	12.400
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK	0	355
US6558441084	Norfolk Southern Corp. Reg.Shares	STK	0	1.700
US6745991058	Occidental Petroleum Corp. Reg.Shares	STK	0	13.300
US74340W1036	ProLogis Inc. Reg.Shares	STK	0	9.142
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares	STK	0	900
CH0102993182	TE Connectivity Ltd. Namens-Aktien	STK	0	10.200
US8919061098	Total System Services Inc. Reg.Shares	STK	0	16.400
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc. Reg.Shares	STK	0	14.000
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
FR0011452291	2,5000 % ACCOR S.A. Notes 13/19	EUR	0	1.600.000
FR0011531631	3,0000 % Alstom S.A. MTN 13/19	EUR	0	1.000.000
XS1616407869	0,0000 % Amadeus Capital Markets S.A.U. MTN 17/19	EUR	0	5.000.000
XS0604462704	4,6250 % Amcor Ltd. MTN 11/19	EUR	0	8.900.000
XS0699618863	4,1250 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 11/19	EUR	0	5.000.000
XS0757310270	2,6250 % Atlas Copco AB MTN 12/19	EUR	0	2.800.000
FR0010737882	7,3750 % Autoroutes du Sud de la France MTN 09/19	EUR	0	2.500.000
XS1385051112	1,8750 % Barclays PLC MTN 16/21	EUR	0	1.000.000
XS1622560842	0,3680 % Becton, Dickinson & Co. Notes 17/19	EUR	0	5.000.000
XS1015212811	1,6250 % BMW Finance N.V. MTN 14/19	EUR	0	4.000.000
XS1075430741	1,1250 % British Telecommunications PLC MTN 14/19	EUR	0	3.050.000
DE0001102325	2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23	EUR	0	20.000.000
XS0800572454	2,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 12/19	EUR	0	9.700.000
XS0934191114	1,7500 % Carrefour S.A. MTN 13/19	EUR	0	700.000
XS0197646218	5,0000 % Citigroup Inc. MTN 04/19	EUR	0	2.154.000
XS0444030646	4,7500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 09/19	EUR	0	2.500.000
DE000DL19SQ4	1,0000 % Deutsche Bank AG MTN 16/19	EUR	0	4.000.000
XS1250867642	1,3750 % Deutsche Wohnen SE Anl. 15/20	EUR	0	1.000.000
XS1035001921	1,8750 % FCE Bank PLC MTN 14/19	EUR	0	2.500.000
XS0723509104	5,2500 % FMC Finance VIII S.A. Notes 12/19 Reg.S	EUR	0	2.500.000
XS0418729934	6,0000 % Fortum Oyj MTN 09/19	EUR	0	5.000.000
XS1044496203	2,2500 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 14/19	EUR	0	2.900.000
XS0758419658	2,5000 % Heineken N.V. MTN 12/19	EUR	0	5.000.000
NL0000122489	5,2500 % ING Bank N.V. MTN 99/19	EUR	0	2.300.000
FR0011236983	3,1250 % Kering S.A. MTN 12/19	EUR	0	75.000
XS0758640279	3,6250 % Luxottica Group S.p.A. Notes 12/19	EUR	0	3.500.000
XS0794392588	2,7500 % Michelin Luxembourg SCS MTN 12/19	EUR	0	5.000.000
XS0298899534	5,0000 % Morgan Stanley MTN 07/19	EUR	0	2.500.000
XS0436928872	6,3750 % Naturgy Capital Markets S.A. MTN 09/19	EUR	0	7.650.000
XS0627188468	5,3750 % Naturgy Capital Markets S.A. MTN 11/19	EUR	0	4.000.000
XS1068765418	1,8750 % Pearson Funding Five PLC Notes 14/21 Reg.S	EUR	0	1.000.000

Deka-Stiftungen Balance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1075312626	1,6250 % PGE Sweden AB (Publ) MTN 14/19	EUR	0	9.500.000
XS0935803386	2,3750 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. MTN 13/19	EUR	0	2.500.000
FI4000006176	4,0000 % Republik Finnland Bonds 09/25	EUR	0	20.000.000
XS1385935769	0,7500 % Santander Consumer Finance SA MTN 16/19	EUR	0	4.400.000
XS0995382446	1,5000 % Schlumberger Finance B.V. MTN 13/19	EUR	0	2.000.000
FR0010745976	6,2500 % Suez S.A. MTN 09/19	EUR	0	1.800.000
XS1080952960	1,6250 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC MTN 14/19	EUR	0	2.500.000
USD				
US23355LAB27	2,8750 % DXC Technology Co. Notes 17/20	USD	0	800.000
US585055AV80	4,1250 % Medtronic Inc. Notes 11/21	USD	0	2.200.000
US87938WAH60	5,8770 % Telefonica Emisiones S.A.U. Notes 09/19	USD	0	2.500.000
US020002AX98	7,4500 % The Allstate Corp. Notes 09/19	USD	0	2.270.000
US92276MAX39	4,2500 % Ventas Realty L.P./Cap. Corp. Notes 12/22	USD	2.500.000	2.500.000
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06445809I8	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	56.053	56.053
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
ES03136793B0	1,7500 % Bankinter S.A. Bonos 14/19	EUR	0	7.500.000
FR0010750489	6,7500 % Veolia Environnement S.A. MTN 09/19	EUR	0	2.500.000
USD				
US378272AG37	3,1250 % Glencore Funding LLC Notes 14/19 144A	USD	0	3.200.000
US49327M2N31	2,3500 % Key Bank N.A. Notes 16/19	USD	0	850.000
US55608JAB44	7,6250 % Macquarie Group Ltd. MTN 09/19 144A	USD	0	500.000
US620076BD08	3,5000 % Motorola Solutions Inc. Notes 14/21	USD	0	850.000
US654740AH26	2,3500 % Nissan Motor Acceptance Corp. Notes 14/19 144A	USD	0	500.000
US824348AZ94	7,2500 % Sherwin-Williams Co. Notes 17/19	USD	0	2.500.000
US83051GAC24	2,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken MTN 14/19 144A	USD	0	266.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000CV1YW59	4,0000 % Commerzbank AG Aktienanl. Classic BOY 17/19	EUR	0	4.000.000
DE000CZ40K31	0,6250 % Commerzbank AG MTN IHS S.854 15/19	EUR	0	2.500.000
FR0011022771	4,1500 % Crédit Agricole S.A. Obligations 11/19	EUR	0	1.700.000
DE000DK0N7R1	2,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. IFX 17/19	EUR	0	7.000.000
DE000DK0NHS2	6,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale Aktienanl. MUV2 17/19	EUR	0	5.000.000
DE000DM9VU38	2,0000 % Deutsche Bank AG Aktienanl. LHA 17/19	EUR	0	7.000.000
DE000DM69RN6	6,0000 % Deutsche Bank AG Aktienanl. PHI1 17/19	EUR	0	5.000.000
XS0993272862	1,8750 % Erste Group Bank AG MTN 13/19	EUR	0	2.500.000
DE000TD3FBL1	4,0000 % HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Aktienanl. 1BR1 17/19	EUR	0	4.000.000
DE000TB45QJ5	4,0000 % HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Aktienanl. CON 17/19	EUR	0	4.000.000
XS0981596819	2,3750 % Korea Gas Corp. MTN 13/19	EUR	0	695.000
DE000LB1PQY5	2,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Aktien-Anl. BNP 17/19	EUR	0	6.000.000
DE000LB1PPP5	2,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Aktien-Anl. HEN3 17/19	EUR	0	6.000.000
DE000LB1PPQ3	2,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Aktien-Anl. IXD1 17/19	EUR	0	6.000.000
DE000LB1PQZ2	2,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Aktien-Anl. LOR 17/19	EUR	0	6.000.000
DE000LB1NJD9	2,0000 % Ldsbk Baden-Württemb. Aktien-Anl. TNE5 17/19	EUR	0	6.000.000
FR0013005196	1,8750 % Wendel S.A. Bonds 15/20	EUR	0	2.500.000
USD				
US05579LAA17	2,3500 % BNZ Inter. Fund. Ltd.(Ldn Br.) Notes 14/19 144A	USD	0	1.621.000
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06735169E5	Repsol S.A. Anrechte	STK	28.802	28.802
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
LU0629460675	UBS ETF-U.E.-MSCI EMU S.R.U.E. Namens-Ant. A-dis	ANT	0	100

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	353.827
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, Nasdaq-100 Index, OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), OMX Stockholm 30 Index, S&P 500 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	13.421
(Basiswert(e): S&P 500 Index, Swiss Market Index (Price) (CHF))		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	160.146

Deka-Stiftungen Balance

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO-BTP Future (FBTP), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	426.576
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Two-Year US Treasury Note Future (TU))		
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	498.250
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
CHF/EUR	EUR	12.328
GBP/EUR	EUR	13.609
JPY/EUR	EUR	17.400
USD/EUR	EUR	308.956
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
CHF/EUR	EUR	23.980
GBP/EUR	EUR	26.005
JPY/EUR	EUR	35.491
USD/EUR	EUR	578.693
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	801.894
(Basiswert(e): 0,5000 % Air Liquide Finance MTN 16/22, 0,6250 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. MTN 16/21, 0,6250 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 14/19, 0,7500 % Land Berlin Landessch. Ausg.474 15/23, 0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 15/22, 1,0000 % NN Group N.V. MTN 15/22, 1,0000 % Southern Power Co. Notes S.2016A 16/22, 1,1250 % Carnival Corp. Notes 15/19, 1,1250 % Deutsche Lufthansa AG MTN 14/19, 1,1250 % Fastighets AB Balder Notes 17/22, 1,1250 % Macquarie Bank Ltd. MTN 15/22, 1,1250 % McDonald's Corp. MTN 15/22, 1,3750 % Bank of America Corp. MTN 14/21, 1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22, 1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22, 1,5000 % Kinder Morgan Inc. Notes 15/22, 1,6250 % Grenke Finance PLC MTN 19/24, 1,7500 % OMV AG MTN 13/19, 1,8750 % American Honda Finance Corp. MTN 13/19, 1,8750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 16/24, 1,8750 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1295 14/24, 1,8750 % LYB International Fin. II B.V. Notes 16/22, 2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23, 2,0000 % mFinance France S.A. MTN 14/21, 2,1250 % Heineken N.V. MTN 12/20, 2,1770 % BP Capital Markets PLC MTN 14/21, 2,2500 % Morrison Supermarkets PLC, Wm. MTN 13/20, 2,3750 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 13/20, 2,5000 % ACCOR S.A. Notes 13/19, 2,5000 % Schneider Electric SE MTN 13/21, 2,7500 % Telenor ASA MTN 12/22, 3,2500 % Scentre Group MTN 13/23 Reg.S, 3,4000 % The Bank of Nova Scotia Bank Notes 19/24, 3,5000 % Allianz Finance II B.V. MTN 12/22, 3,7500 % Telstra Corp. Ltd. FLR MTN 11/22, 4,1250 % EDP Finance B.V. MTN 13/21, 4,2500 % Kon. KPN N.V. MTN 12/22, 4,2500 % OMV AG MTN 11/21, 5,3750 % Naturgy Capital Markets S.A. MTN 11/19, 5,6250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 07/22, 5,9500 % Bancolumbia S.A. Notes 11/21, 6,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 00/30, 6,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 97/27, 6,7500 % Veolia Environnement S.A. MTN 09/19, 7,3750 % Autoroutes du Sud de la France MTN 09/19)		

Deka-Stiftungen Balance (CF)

Entwicklung des Sondervermögens

			EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			1.367.595.489,28
1 Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr			-2.453.052,80
2 Zwischenausschüttung(en)			-2.302.574,60
3 Mittelzufluss (netto)			-108.285.514,62
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	37.182.523,62	
davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	37.182.523,62	
davon aus Verschmelzung	EUR	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-145.468.038,24	
4 Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			-203.837,83
5 Ergebnis des Geschäftsjahres			27.403.945,46
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne			26.652.971,92
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste			3.308.329,62
II. Wert des Sondervermögens zur Mitte des Geschäftsjahres			1.281.754.454,89

Deka-Stiftungen Balance (CF)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.03.2019 - 31.08.2019 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	234.717,63	0,01
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	2.221.669,88	0,10
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren ¹⁾	-603.939,72	-0,03
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	8.115.067,52	0,36
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-158.877,72	-0,01
davon Negative Einlagezinsen	-401.935,22	-0,02
davon Positive Einlagezinsen	243.057,50	0,01
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	378.766,81	0,02
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	79.081,73	0,00
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	79.081,73	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-35.207,60	-0,00
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge	-35.207,60	-0,00
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-473.704,48	-0,02
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-473.709,73	-0,02
davon aus Zinsen aus ausländischen Wertpapieren/Liquiditätsanlagen	5,25	0,00
10. Sonstige Erträge	3.658.832,49	0,16
davon Kick-Back-Zahlungen	3.718,15	0,00
davon Kompensationszahlungen	3.627.846,54	0,16
davon Quellensteuerrückvergütung	27.267,80	0,00
Summe der Erträge	13.416.406,54	0,59
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-6.963,12	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-6.386.916,63	-0,28
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-1.083.368,80	-0,05
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-34.885,64	-0,00
davon EMIR-Kosten	-4.848,04	-0,00
davon Gebühren für Quellensteuerrückstattung	-2.372,72	0,00
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-21.941,42	-0,00
davon Kostenpauschale	-1.019.320,98	-0,04
Summe der Aufwendungen	-7.477.248,55	-0,33
III. Ordentlicher Nettoertrag	5.939.157,99	0,26
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	25.194.092,23	1,11
2. Realisierte Verluste	-33.690.606,30	-1,48
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-8.496.514,07	-0,37
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-2.557.356,08	-0,11
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	26.652.971,92	1,17
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	3.308.329,62	0,15
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	29.961.301,54	1,32
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	27.403.945,46	1,20

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

¹⁾ Negative Zinserträge berücksichtigen Zinsansprüche (Stückzinsen) verliehener Wertpapiere bis zum Kupon-Termin. Gezahlte Kupons aus verliehenen Wertpapieren sind in den Kompensationszahlungen enthalten.

Deka-Stiftungen Balance (D)

Entwicklung des Sondervermögens

			EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			111.270.089,18
1 Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr			-204.248,34
2 Zwischenausschüttung(en)			-201.966,66
3 Mittelzufluss (netto)			-235.043,92
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	4.588.853,29	
davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	4.588.853,29	
davon aus Verschmelzung	EUR	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-4.823.897,21	
4 Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			2.323,48
5 Ergebnis des Geschäftsjahres			2.270.800,43
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne			2.242.783,84
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste			254.888,83
II. Wert des Sondervermögens zur Mitte des Geschäftsjahres			112.901.954,17

Deka-Stiftungen Balance (D)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.03.2019 - 31.08.2019 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	20.675,15	0,02
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	195.699,31	0,17
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren ¹⁾	-61.469,50	-0,05
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	714.824,65	0,63
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-13.995,02	-0,01
davon Negative Einlagezinsen	-35.405,09	-0,03
davon Positive Einlagezinsen	21.410,07	0,02
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	33.364,65	0,03
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	6.966,07	0,01
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	6.966,07	0,01
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-3.101,26	-0,00
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge	-3.101,26	-0,00
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-41.719,83	-0,04
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-41.720,28	-0,04
davon aus Zinsen aus ausländischen Wertpapieren/Liquiditätsanlagen	0,45	0,00
10. Sonstige Erträge	325.404,92	0,29
davon Kick-Back-Zahlungen	327,52	0,00
davon Kompensationszahlungen	319.567,03	0,28
davon Quellensteuerrückvergütung	2.401,90	0,00
davon Rückerstattung inländischer Körperschaftsteuer	3.108,47	0,00
Summe der Erträge	1.176.649,14	1,03
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-613,33	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-559.120,47	-0,49
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-95.362,75	-0,08
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-3.073,01	-0,00
davon EMIR-Kosten	-427,04	-0,00
davon Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	-209,02	0,00
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-1.932,01	-0,00
davon Kostenpauschale	-89.721,67	-0,08
Summe der Aufwendungen	-655.096,55	-0,58
III. Ordentlicher Nettoertrag	521.552,59	0,46
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	2.219.264,54	1,95
2. Realisierte Verluste	-2.967.689,37	-2,61
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-748.424,83	-0,66
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-226.872,24	-0,20
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	2.242.783,84	1,97
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	254.888,83	0,22
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	2.497.672,67	2,20
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	2.270.800,43	2,00

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

¹⁾ Negative Zinserträge berücksichtigen Zinsansprüche (Stückzinsen) verliehener Wertpapiere bis zum Kupon- Termin. Gezahlte Kupons aus verliehenen Wertpapieren sind in den Kompensationszahlungen enthalten.

Deka-Stiftungen Balance

Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF	STK	22.752.063,000
Umlaufende Anteile Klasse D	STK	1.137.550,000
Anteilwert Klasse CF	EUR	56,34
Anteilwert Klasse D	EUR	99,25

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 Umsatzzolumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte, z.B. Broker-Quotes, zugrunde gelegt, welche sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Investmentanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs bewertet.

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Verzinsliche Wertpapiere, rentenähnliche Genussscheine, Zertifikate und Schuldscheindarlehen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mittels externer Modellkurse, z.B. Broker-Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.

Bankguthaben

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

Derivate

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

Sonstiges

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

Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR
104.977.359,00

in % des Fondsvermögens
7,53

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale
Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
103.622.321,30
1.355.037,70

Sitzstaat
Deutschland
Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)

unbefristet

absolute Beträge in EUR
104.977.359,00

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. Marktturnbulenzen) 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-Aktienindex (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>.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR
GBP

Deka-Stiftungen Balance

USD

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
Restlaufzeit 1-7 Tage	45.619.849,19
unbefristet	71.887.028,84

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	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	89.773,06	100,00
Kostenanteil des Fonds	39.763,04	44,29
Ertragsanteil der KVG	39.763,04	44,29

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

Neben dem oben ausgewiesenen Kostenanteil für den Fonds, der dem Ertragsanteil der Kapitalverwaltungsgesellschaft entspricht, fallen für den Fall, dass Aktien Gegenstand von Wertpapier-Darlehensgeschäften sind, zusätzliche Kosten Dritter an. Diese wurden bereits vor Zufluss der Erträge aus dem Wertpapier-Darlehen an den Fonds in Abzug gebracht. Sie betragen 35% bzw. infolge der im Geschäftsjahr erfolgten Anpassung nunmehr 25% der Bruttoerträge aus den Wertpapier-Darlehensgeschäften.

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

9,05% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Koninklijke Philips N.V.	33.711.941,39
Morgan Stanley	16.285.180,45
Daimler AG	10.386.240,74
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	8.120.093,62
Citigroup Global Markets Holdings Inc.	7.393.162,74
adidas AG	6.340.377,30
Société Générale S.A.	5.670.442,65
Fresenius SE & Co. KGaA	5.406.653,40
NRW.BANK	4.088.230,49
Kering S.A.	3.803.734,80

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	3
Clearstream Banking Frankfurt	38.273.079,09 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus	1.423.248,38 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
J.P.Morgan AG Frankfurt	77.810.550,56 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

Eine Zuordnung der Kontrahenten zu den erhaltenen Sicherheiten ist auf Geschäftsartenebenen durch die Globalbesicherung im Einzelnen bei Total Return Swaps oder Pensionsgeschäften 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 oder Pensionsgeschäften 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 2. September 2019
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2018

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

Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main
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;
Stellvertretende Vorsitzende des Verwaltungsrates der
DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A., Luxemburg;
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,
Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der
Ostsächsischen Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning
Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Dr. Ulrich Neugebauer (stv. Vorsitzender)
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,
Köln
und der
Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln
und der
Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

Jörg Boysen

Thomas Ketter
Mitglied der Geschäftsführung der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squaire
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. August 2019

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

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