

Halbjahresbericht
zum 28. Februar 2017.

DekaTresor

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



„Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

März 2017

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds DekaTresor für den Zeitraum vom 1. September 2016 bis zum 28. Februar 2017.

An den internationalen Kapitalmärkten überwogen in den zurückliegenden sechs Monaten die optimistischen Töne. Sowohl in den USA wie auch in Europa zeigten die Konjunkturdaten eine robuste Entwicklung, zugleich zogen die langfristigen Inflationserwartungen in den USA deutlich an. Die US-Notenbank erhöhte in diesem Umfeld im Dezember erwartungsgemäß die Leitzinsen um 25 Basispunkte. Der überraschende Ausgang der US-Präsidentschaftswahl führte nur sehr kurz zu Unsicherheit an den US-Börsen. Im Gegenteil: Die Wahlversprechen Donald Trumps, die neben Steuererleichterungen und einem Investitionsprogramm auch die Deregulierung des Banken- und Finanzsektors in Aussicht stellten, befeuerten die Kurse am US-Aktienmarkt und mündeten in einer veritablen Jahresendrallye. Parallel dazu verzeichnete das Gros der Börsenplätze weltweit im Berichtshalbjahr komfortable Kurssteigerungen.

Die Renditen an den Anleihemärkten diesseits und jenseits des Atlantiks zeigten zunächst einen Seitwärtstrend, ehe nach der US-Präsidentschaftswahl Anfang November eine kräftige Aufwärtsbewegung einsetzte. So zog die Rendite 10-jähriger US-Treasuries nach der Wahl signifikant an und lag Ende Februar 2017 bei 2,4 Prozent. Laufzeitgleiche Bundesanleihen rentierten zum Stichtag bei 0,2 Prozent, nachdem die Rendite bis in den Herbst hinein noch überwiegend im negativen Bereich gelegen hatte.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds DekaTresor eine Wertentwicklung von plus 0,2 Prozent. 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 wichtige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider



Steffen Selbach

Inhalt.

Anlagepolitik. DekaTresor	5
Vermögensübersicht zum 28. Februar 2017. DekaTresor	7
Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2017. DekaTresor	8
Anhang. DekaTresor	26
Informationen der Verwaltung.	28
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.	29

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

DekaTresor Anlagepolitik.

Das Anlageziel des DekaTresor ist kurz- bis mittelfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, überwiegend in verzinsliche Wertpapiere mit kurz- bis mittelfristiger Laufzeit zu investieren. Dabei bilden Anleihen öffentlicher Emittenten sowie Quasi-Staatsanleihen aus der Eurozone den Anlageschwerpunkt. Daneben wird in besicherte, verzinsliche Wertpapiere (z.B. Pfandbriefe) und ausgewählte Unternehmensanleihen insbesondere aus der Eurozone investiert. Die Investitionen erfolgen weitestgehend in auf Euro lautende Wertpapiere oder in gegenüber Euro abgesicherte Wertpapiere fremder Währung. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden. Dieser Investmentfonds darf mehr als 35 Prozent des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland investieren.

Bitte beachten Sie, dass per 3. Februar 2017 die Fonds Deka-EuroRent 2y und Deka-EuroRent 4y auf DekaTresor verschmolzen wurden.

Anleger des übertragenden Sondervermögens Deka-EuroRent 2y A erhielten je Anteil 1,1789449 Anteile des übernehmenden Sondervermögens DekaTresor. Anleger des übertragenden Sondervermögens Deka-EuroRent 2y CF erhielten je Anteil 1,1966441 Anteile des übernehmenden Sondervermögens DekaTresor. Anleger des übertragenden Sondervermögens Deka-EuroRent 2y TF erhielten je Anteil 1,1766464 Anteile des übernehmenden Sondervermögens DekaTresor.

Anleger des übertragenden Sondervermögens Deka-EuroRent 4y A erhielten je Anteil 1,2537639 Anteile des übernehmenden Sondervermögens DekaTresor. Anleger des übertragenden Sondervermögens Deka-EuroRent 4y CF erhielten je Anteil 1,2757154 Anteile des übernehmenden Sondervermögens DekaTresor. Anleger des übertragenden Sondervermögens Deka-EuroRent 4y TF erhielten je Anteil 1,2485921 Anteile des übernehmenden Sondervermögens DekaTresor.

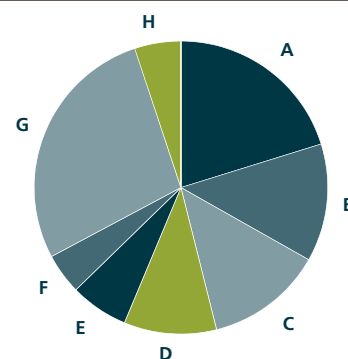
Der übergeordnete Trend rückläufiger Renditen erreichte im Sommer 2016 einen vorläufigen Höhepunkt. Noch Anfang Oktober rentierten 10-jährige Euroland-Staatsanleihen im negativen Bereich. Im weiteren Verlauf dominierten Renditesteigerungen

Wichtige Kennzahlen DekaTresor

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Performance*	0,2%	1,5%	1,3%
ISIN	DE0008474750		

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

Fondsstruktur DekaTresor



A Deutschland	20,2%
B Spanien	13,0%
C Italien	12,9%
D Frankreich	10,2%
E Niederlande	6,4%
F USA	4,5%
G Sonstige Länder	27,7%
H Barreserve, Sonstiges	5,1%

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

das Bild, die insbesondere jenseits des Atlantiks und befeuert durch die US-Wahl deutlich ausfielen.

Das Fondsmanagement hat das Zinsänderungsrisiko im Fonds aktiv gesteuert und die durchschnittliche Kapitalbindungsdauer (Duration) den Marktgegebenheiten situativ angepasst. Angesichts der Trendwende an den Anleihemärkten wurde die Duration (Zinsbindungsdauer) im Stichtagsvergleich vorsorglich verkürzt.

Mit Blick auf die Wertpapierstruktur umfasste das Portfolio Engagements in Staatsanleihen, staatlich garantierten Anleihen, Pfandbriefen (Covered Bonds) und Unternehmensanleihen. Während der Anteil an Staatsanleihen, halbstaatlicher Emissionen und Pfandbriefen angesichts der erreichten Bewertungsniveaus reduziert wurde, stockte das Fondsmanagement Unternehmensanleihen auf. Die Inves-

tionen erfolgten weit überwiegend in Anleihen mit guter bis sehr guter Bonität (Investment Grade), selektiv bestanden auch Beimischungen im Hochzinssegment (Speculative Grade). Investitionen in Unternehmensanleihen konzentrierten sich auf den Laufzeitbereich bis sieben Jahre und bevorzugt im Segment Industriefinanzierungen. Derivate dienten primär der kostengünstigen Absicherung von Zinsänderungsrisiken.

Währungsseitig lautete der weit überwiegende Teil des Fondsvolumens auf Euro. Beimischungen in norwegischer Krone und britischem Pfund waren vollständig, die US-Dollar-Position weitgehend mittels Devisentermingeschäften gegen Währungskursverluste abgesichert.

Unter Ländergesichtspunkten akzentuierte das Fondsmanagement u.a. Spanien, während im Ge-

genzug Italien und Frankreich weniger aussichtsreich erschienen.

Der Fonds profitierte im Berichtszeitraum vom Engagement im Segment Corporate Bonds, die im Verhältnis zu Staatsanleihen von der Einengung der Risikoaufschläge profitieren konnten. Als vorteilhaft erwies sich zudem die Präferenz für Spanien gegenüber Italien. Auch trug die derivative Absicherung Anfang 2017 positiv zur Fondsperformance bei. Negativen Einfluss auf die Wertentwicklung hatten vor allem die Anleihekursverluste im unmittelbaren Kontext der US-Präsidentschaftswahl.

DekaTresor erzielte im Berichtshalbjahr eine Wertsteigerung um 0,2 Prozent. Bei einem Fondsvolumen von 541,1 Mio. Euro lag der Anteilwert zum 28. Februar 2017 bei 87,20 Euro.

Vermögensübersicht zum 28. Februar 2017.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	511.835.252,26	94,59
Australien	2.341.876,00	0,43
Belgien	2.816.573,00	0,52
Dänemark	2.362.484,88	0,44
Deutschland	109.453.957,47	20,17
Finnland	2.365.083,88	0,44
Frankreich	55.184.951,45	10,21
Großbritannien	10.296.459,48	1,91
Indonesien	429.000,00	0,08
Irland	17.861.589,78	3,29
Israel	907.200,00	0,17
Italien	69.908.986,16	12,92
Kaiman-Inseln	1.638.842,28	0,30
Kanada	351.715,00	0,07
Kroatien	1.291.232,71	0,24
Lettland	499.875,00	0,09
Litauen	1.926.020,41	0,36
Luxemburg	17.632.668,22	3,26
Marokko	557.680,00	0,10
Mexiko	8.933.269,13	1,65
Neuseeland	1.878.716,25	0,34
Niederlande	34.223.731,96	6,35
Norwegen	12.295.304,07	2,28
Österreich	1.013.730,00	0,19
Polen	7.003.352,52	1,30
Portugal	1.693.099,00	0,31
Rumänien	1.481.005,00	0,28
Schweden	15.218.920,75	2,82
Schweiz	3.885.005,88	0,72
Serbien	2.733.880,39	0,50
Singapur	1.098.086,00	0,20
Slowakei	1.755.660,00	0,32
Slowenien	394.840,00	0,07
Sonstige	10.885.752,25	2,01
Spanien	70.030.272,82	12,97
Tschechische Republik	7.823.754,50	1,44
USA	24.433.576,02	4,51
Zypern	7.227.100,00	1,33
2. Investmentanteile	1.327.560,00	0,25
Deutschland	1.327.560,00	0,25
3. Derivate	-1.025.084,90	-0,17
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	33.246.683,61	6,13
5. Sonstige Vermögensgegenstände	7.411.982,29	1,36
II. Verbindlichkeiten	-11.701.800,69	-2,16
III. Fondsvermögen	541.094.592,57	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	511.835.252,26	94,59
CHF	3.315.029,72	0,61
DEM	395.944,43	0,07
EUR	483.952.318,67	89,44
GBP	4.237.232,18	0,78
NOK	4.985.555,82	0,92
PLN	4.477.296,27	0,83
SEK	2.595.721,12	0,48
USD	7.876.154,05	1,46
2. Investmentanteile	1.327.560,00	0,25
EUR	1.327.560,00	0,25
3. Derivate	-1.025.084,90	-0,17
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	33.246.683,61	6,13
5. Sonstige Vermögensgegenstände	7.411.982,29	1,36
II. Verbindlichkeiten	-11.701.800,69	-2,16
III. Fondsvermögen	541.094.592,57	100,00

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

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2017.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								407.004.346,25	75,21
Verzinsliche Wertpapiere								407.004.346,25	75,21
EUR								386.567.341,26	71,44
XS0495913229	5,6250 % 3i Group PLC MTN 10/17	EUR		1.050.000	1.050.000	0	% 100,224	1.052.346,75	0,19
DE000AAR0199	0,0100 % Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.212 17/22	EUR		1.200.000	1.200.000	0	% 100,202	1.202.424,00	0,22
DE000A1TNC78	1,6250 % Aareal Bank AG MTN IHS S.210 14/19 ¹⁾	EUR		2.000.000	0	0	% 102,527	2.050.540,00	0,38
XS0802995166	7,1250 % ABN AMRO Bank N.V. MTN 12/22	EUR		300.000	500.000	200.000	% 128,314	384.940,50	0,07
XS1422841202	0,6250 % ABN AMRO Bank N.V. MTN 16/22	EUR		575.000	0	0	% 102,249	587.931,75	0,11
FR0013233384	1,2500 % ACCOR S.A. Bonds 17/24	EUR		300.000	1.200.000	900.000	% 99,380	298.138,50	0,06
FR0011274026	2,8750 % ACCOR S.A. Notes 12/17	EUR		500.000	500.000	400.000	% 100,897	504.482,50	0,09
XS0805452405	3,0000 % AEGON N.V. MTN 12/17	EUR		200.000	200.000	0	% 101,210	202.420,00	0,04
XS1035755674	1,2500 % Agence Française Développement MTN 14/19	EUR		1.100.000	0	0	% 103,625	1.139.869,50	0,21
FR0013182805	0,1250 % Air Liquide Finance MTN 16/20	EUR		400.000	0	0	% 100,496	401.982,00	0,07
DE000A180872	0,0000 % Allianz Finance II B.V. MTN 16/20 ¹⁾	EUR		700.000	0	0	% 100,593	704.151,00	0,13
XS0519903743	3,7500 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 10/17	EUR		1.475.000	1.475.000	0	% 101,254	1.493.489,13	0,28
XS0789283792	2,7500 % Anglo American Capital PLC MTN 12/19	EUR		600.000	200.000	0	% 105,526	633.156,00	0,12
FR0011884899	0,4310 % APRR FLR MTN 14/19	EUR		500.000	0	0	% 101,082	505.407,50	0,09
FR0013054020	0,3810 % APRR FLR MTN 15/20	EUR		700.000	0	0	% 101,244	708.708,00	0,13
XS1311440082	5,5000 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 15/47	EUR		300.000	300.000	0	% 105,875	317.625,00	0,06
XS1014759648	2,8750 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 14/20	EUR		500.000	0	500.000	% 107,924	539.617,50	0,10
XS1062900912	4,1250 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 14/26	EUR		500.000	700.000	300.000	% 106,625	533.125,00	0,10
IT0004869985	3,6250 % Atlantia S.p.A. Obbl. 12/18	EUR		600.000	0	0	% 106,557	639.339,00	0,12
FR0013236312	0,6250 % Auchan Holding S.A. MTN 17/22	EUR		1.200.000	1.200.000	0	% 100,628	1.207.536,00	0,22
XS0307791698	5,3750 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 07/17	EUR		700.000	700.000	0	% 101,863	713.041,00	0,13
XS0294901045	4,2500 % BA Covered Bond Issuer Asset Cov. MTN 07/17	EUR		700.000	700.000	0	% 100,417	702.919,00	0,13
XS1346315200	1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 16/21	EUR		1.400.000	600.000	0	% 102,744	1.438.416,00	0,27
XS1548914800	0,6250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 17/22 ¹⁾	EUR		1.300.000	1.300.000	0	% 100,219	1.302.840,50	0,24
XS1562614831	3,5000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 17/27	EUR		600.000	1.300.000	700.000	% 101,537	609.219,00	0,11
XS1024830819	4,2500 % Banco BPM S.p.A. MTN 14/19	EUR		500.000	500.000	0	% 105,004	525.020,00	0,10
XS1293577208	2,6250 % Banco BPM S.p.A. MTN 15/18 ¹⁾	EUR		800.000	800.000	0	% 102,059	816.468,00	0,15
XS1403619411	1,7500 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 16/26	EUR		250.000	600.000	350.000	% 102,375	255.937,50	0,05
XS0301928262	0,4000 % Bank of America Corp. FLR MTN 07/17	EUR		200.000	0	0	% 100,070	200.139,00	0,04
XS1458405112	0,1720 % Bank of America Corp. FLR MTN 16/19	EUR		925.000	0	0	% 100,600	930.550,00	0,17
XS0495891821	4,7500 % Bank of America Corp. MTN 10/17	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 100,449	1.004.490,00	0,19
XS1385051112	1,8750 % Barclays PLC MTN 16/21 ¹⁾	EUR		400.000	0	0	% 104,068	416.272,00	0,08
DE000A188WV3	0,0000 % BASF Finance Europe N.V. MTN 16/20	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 100,297	2.005.940,00	0,37
XS0872702112	3,7500 % BBVA Senior Fin. S.A.U. MTN 13/18	EUR		900.000	0	0	% 103,537	931.833,00	0,17
XS1055241373	3,5000 % BBVA Sub.Capital S.A.U. FLR MTN 14/24 ¹⁾	EUR		600.000	600.000	0	% 104,802	628.809,00	0,12
XS1548792420	0,2500 % Berkshire Hathaway Inc. Notes 17/21	EUR		900.000	1.000.000	100.000	% 101,041	909.369,00	0,17
DE000BHY0BA8	0,1250 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. S.194 15/20 ¹⁾	EUR		5.700.000	0	0	% 101,123	5.764.011,00	1,06
DE000BHY0BC4	0,2500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. S.196 16/23	EUR		750.000	0	0	% 101,144	758.580,00	0,14
DE000BHY0GU5	0,5000 % Berlin Hyp AG IHS S.112 16/23 ¹⁾	EUR		500.000	600.000	100.000	% 100,825	504.122,50	0,09
DE000A1R0TU2	2,3750 % Bilfinger SE IHS 12/19 ¹⁾	EUR		300.000	0	0	% 104,604	313.810,50	0,06
XS1105264821	0,5000 % BMW Finance N.V. MTN 14/18	EUR		500.000	0	0	% 101,563	507.812,50	0,09
XS1396260520	0,1250 % BMW Finance N.V. MTN 16/20	EUR		975.000	0	0	% 100,794	982.736,63	0,18
XS1548436556	0,1250 % BMW Finance N.V. MTN 17/21	EUR		750.000	1.250.000	500.000	% 100,623	754.672,50	0,14
XS1434582703	0,1250 % BNZ Inter. Fund. Ltd.(Ldn Br.) MT Mtg.Cov.Bd 16/21	EUR		1.150.000	0	0	% 100,190	1.152.179,25	0,21
FR0012601342	0,0000 % BPCE S.A. FLR MTN 15/17	EUR		500.000	0	0	% 100,009	500.045,00	0,09
FR0011030980	4,2000 % BPCE S.A. Obl. 11/17	EUR		1.202.000	1.202.000	0	% 100,922	1.213.082,44	0,22
FR0013063930	0,1250 % Bpifrance Financement S.A. MTN 15/20	EUR		800.000	0	0	% 100,932	807.456,00	0,15
XS1046498157	0,4060 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel FLR MTN 14/19	EUR		500.000	0	0	% 101,212	506.060,00	0,09
XS0873248420	1,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 13/18	EUR		300.000	0	0	% 101,631	304.891,50	0,06
XS1379128215	0,2500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 16/19	EUR		1.500.000	0	1.500.000	% 100,657	1.509.847,50	0,28
DE000A1R01Z7	1,7500 % Bundesländer Ländersch. Nr.42 13/23	EUR		1.000.000	0	1.400.000	% 110,330	1.103.300,00	0,20
DE0001135473	1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 12/22 ¹⁾	EUR		3.000.000	0	0	% 112,440	3.373.200,00	0,62
DE0001102309	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23	EUR		3.000.000	500.000	500.000	% 111,754	3.352.620,00	0,62
DE0001102317	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23 ¹⁾	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 112,114	1.121.140,00	0,21
DE0001102325	2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23 ¹⁾	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 115,725	2.314.490,00	0,43
DE0001141729	0,2500 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.172 15/20 ¹⁾	EUR		1.000.000	0	0	% 103,744	1.037.440,00	0,19
DE0001030526	1,7500 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 09/20 ¹⁾	EUR		200.000	3.000.000	7.800.000	% 122,636	245.271,34	0,05

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE0001030542	0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 12/23		EUR	100.000	650.000	900.000	% 114,814	114.814,48	0,02
FR0012872182	0,3750 % Cais. Ctr. du Crd. Imm. France MTN 15/20		EUR	2.400.000	1.800.000	500.000	% 101,589	2.438.136,00	0,45
FR0012159507	0,3750 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 14/19		EUR	800.000	0	0	% 101,641	813.128,00	0,15
XS0302816672	4,8750 % Cargill Inc. MTN 07/17		EUR	200.000	200.000	0	% 101,198	202.395,00	0,04
XS0548805299	3,3750 % Carlsberg Breweries A/S MTN 10/17		EUR	100.000	100.000	0	% 102,197	102.197,00	0,02
FR0013155868	0,3510 % Carrefour Banque FLR MTN 16/21		EUR	800.000	0	0	% 101,185	809.476,00	0,15
FR0011052661	5,9760 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 11/21 ¹⁾		EUR	400.000	400.000	0	% 118,200	472.800,00	0,09
FR0011301480	4,4070 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 12/19		EUR	800.000	0	900.000	% 109,525	876.200,00	0,16
FR0011215508	3,9940 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 12/20 ¹⁾		EUR	1.500.000	700.000	0	% 113,575	1.703.625,00	0,31
IT0004960537	3,5000 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 13/19		EUR	2.500.000	1.100.000	0	% 105,440	2.636.000,00	0,49
IT0004997943	2,3750 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 14/19		EUR	1.000.000	0	0	% 104,235	1.042.350,00	0,19
XS0807706006	4,1250 % Ceske Drah AS Bonds 12/19		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 109,099	1.418.287,00	0,26
XS1415366720	1,8750 % Ceske Drah AS Notes 16/23		EUR	700.000	300.000	125.000	% 104,793	733.547,50	0,14
XS0521158500	4,5000 % CEZ AS MTN 10/20 ¹⁾		EUR	1.500.000	500.000	0	% 114,623	1.719.345,00	0,32
XS1417876759	0,5000 % Citigroup Inc. FLR MTN 16/21 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 102,102	1.021.015,00	0,19
XS1457608013	0,7500 % Citigroup Inc. MTN 16/23		EUR	1.075.000	1.075.000	0	% 99,308	1.067.555,63	0,20
DE000CB83CE3	6,3750 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN S.773 11/19 ¹⁾		EUR	700.000	300.000	0	% 111,900	783.300,00	0,14
DE000CB83CF0	7,7500 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN S.774 11/21		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 120,751	1.811.265,00	0,33
DE000CZ40LM6	0,0500 % Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P15 16/24		EUR	200.000	0	300.000	% 98,559	197.118,00	0,04
DE000CZ226Y9	3,8750 % Commerzbank AG MTN Anl. S.745 10/17		EUR	1.900.000	1.900.000	0	% 100,234	1.904.446,00	0,35
DE000CZ40KN6	0,5000 % Commerzbank AG MTN Anl. S.843 15/18		EUR	2.050.000	0	0	% 100,708	2.064.503,75	0,38
DE000CZ40LR5	0,5000 % Commerzbank AG MTN Anl. S.871 16/23 ¹⁾		EUR	900.000	900.000	0	% 95,637	860.733,00	0,16
DE000CZ40K31	0,6250 % Commerzbank AG MTN IHS S.854 15/19		EUR	1.200.000	0	0	% 101,542	1.218.498,00	0,23
XS0294547285	4,7500 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 07/17		EUR	1.750.000	1.750.000	0	% 100,555	1.759.712,50	0,33
XS1493428426	0,0000 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 16/20		EUR	100.000	700.000	600.000	% 100,013	100.013,00	0,02
ES0000101818	2,1460 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 17/27		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 101,438	1.217.250,00	0,22
XS0953199634	3,0000 % Continental AG MTN 13/18		EUR	850.000	0	0	% 104,297	886.520,25	0,16
XS0429484891	5,8750 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 09/19		EUR	600.000	0	0	% 112,972	677.829,00	0,13
XS0826634874	4,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 12/22 ¹⁾		EUR	500.000	500.000	0	% 116,154	580.770,00	0,11
XS1555575320	0,5000 % Corporación Andina de Fomento MTN 17/22		EUR	3.275.000	3.275.000	0	% 100,727	3.298.809,25	0,61
XS1211053571	0,0110 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) FLR MTN 15/17 ¹⁾		EUR	925.000	925.000	0	% 100,029	925.268,25	0,17
XS1211053225	0,5000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 15/18		EUR	900.000	0	0	% 100,791	907.119,00	0,17
XS1428769738	1,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 16/23		EUR	350.000	0	0	% 102,568	358.986,25	0,07
DE000A169GZ7	0,2060 % Daimler AG FLR MTN 16/19		EUR	1.300.000	0	0	% 100,678	1.308.814,00	0,24
DE000A1MA9V5	2,0000 % Daimler AG MTN 12/17		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 100,394	1.505.910,00	0,28
DE000A169NA6	0,2500 % Daimler AG MTN 16/20		EUR	1.025.000	0	0	% 101,050	1.035.757,38	0,19
XS0848458179	4,5000 % Davide Campari-Milano S.p.A. Notes 12/19		EUR	300.000	0	0	% 110,508	331.524,00	0,06
DE000DB7XHMO	0,2230 % Deutsche Bank AG FLR MTN 14/19 ¹⁾		EUR	5.300.000	5.800.000	500.000	% 99,242	5.259.826,00	0,96
DE000DL19TD0	0,2230 % Deutsche Bank AG FLR MTN 17/19		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 99,274	1.191.288,00	0,22
DE000DB7XJB9	1,2500 % Deutsche Bank AG MTN 14/21		EUR	600.000	600.000	0	% 101,235	607.407,00	0,11
DE000DL19TA6	1,5000 % Deutsche Bank AG MTN 17/22 ¹⁾		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 101,322	2.533.050,00	0,47
XS1109110251	1,1250 % Deutsche Lufthansa AG MTN 14/19 ¹⁾		EUR	100.000	0	200.000	% 102,443	102.443,00	0,02
DE000A13SWH9	1,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35254 16/20 ¹⁾		EUR	750.000	400.000	0	% 102,308	767.306,25	0,14
DE000A2DASD4	0,8750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35270 17/21		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 100,942	1.615.072,00	0,30
XS0977500767	1,5000 % Deutsche Post AG MTN 13/18		EUR	350.000	0	0	% 102,779	359.724,75	0,07
XS1388661651	0,3750 % Deutsche Post AG MTN 16/21		EUR	550.000	0	0	% 101,659	559.124,50	0,10
XS0795872901	1,8750 % Deutsche Post Finance B.V. MTN 12/17		EUR	500.000	500.000	0	% 100,664	503.317,50	0,09
XS1557096267	0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/24		EUR	500.000	900.000	400.000	% 101,428	507.140,00	0,09
XS0986147709	1,6250 % Dexia Crédit Local S.A. MTN 13/18 ¹⁾		EUR	2.000.000	0	2.000.000	% 102,988	2.059.760,00	0,38
XS1423725172	0,0400 % Dexia Crédit Local S.A. MTN 16/19 ¹⁾		EUR	1.250.000	0	0	% 100,241	1.253.012,50	0,23
DE000DXA1NV3	1,0000 % Dexia Kommunalbank D.AG MTN Öff.-Pfe. S.1636 14/19		EUR	2.700.000	0	0	% 102,684	2.772.468,00	0,51
XS1069539374	1,1250 % Diageo Finance PLC MTN 14/19		EUR	400.000	0	0	% 102,876	411.502,00	0,08
XS0761320208	2,7500 % DNB Bank ASA MTN 12/17		EUR	700.000	700.000	0	% 100,229	701.603,00	0,13

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE000A1X2566	1,3750 % Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15204 13/18		EUR	1.000.000	0	0	% 102,509	1.025.090,00	0,19
XS1166863339	0,5000 % DVB Bank SE MTN 15/18		EUR	1.000.000	0	0	% 100,538	1.005.375,00	0,19
XS1555094066	1,0000 % DVB Bank SE MTN IHS 17/22 ¹⁾		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 101,084	1.010.835,00	0,19
XS0148579153	6,3750 % E.ON Intl Finance B.V. MTN 02/17		EUR	300.000	300.000	0	% 101,631	304.891,50	0,06
XS0831842645	5,7500 % EDP Finance B.V. MTN 12/17		EUR	500.000	500.000	0	% 103,230	516.150,00	0,10
XS0834643727	4,2500 % Enagás Financiaciones S.A.U. MTN 12/17		EUR	200.000	200.000	0	% 102,759	205.517,00	0,04
XS0674277933	7,3750 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR Anl. 11/72		EUR	200.000	200.000	0	% 100,627	201.253,00	0,04
FR0012602746	0,0000 % Engie S.A. MTN 15/17		EUR	2.300.000	2.300.000	0	% 100,009	2.300.195,50	0,43
EU000A1G0DK9	0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/22		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 99,839	2.995.155,00	0,55
EU000A1U9985	0,0000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) MTN 16/22 ¹⁾		EUR	1.000.000	1.700.000	700.000	% 100,311	1.003.110,00	0,19
FR0013184702	1,1250 % Eutelsat S.A. Bonds 16/21 ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 102,348	307.044,00	0,06
FR0010877183	4,1250 % Eutelsat S.A. Notes 10/17		EUR	1.700.000	1.700.000	0	% 100,309	1.705.244,50	0,32
DE000A185QC1	0,0000 % Evonik Finance B.V. MTN 16/21		EUR	750.000	750.000	0	% 99,544	746.580,00	0,14
XS1186131634	0,1420 % FCE Bank PLC FLR MTN 15/18		EUR	500.000	0	0	% 100,240	501.200,00	0,09
XS0838847381	2,8750 % FCE Bank PLC MTN 12/17		EUR	700.000	0	0	% 101,800	712.596,50	0,13
XS0933505967	1,7500 % FCE Bank PLC MTN 13/18		EUR	475.000	0	0	% 102,408	486.438,00	0,09
XS1554373164	0,8750 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/22 ¹⁾		EUR	575.000	575.000	0	% 101,334	582.667,63	0,11
XS0873432511	2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA Notes 13/20 Reg.S ¹⁾		EUR	800.000	0	200.000	% 108,509	868.072,00	0,16
XS1013955379	3,0000 % Fresenius SE & Co. KGaA Notes 14/21 Reg.S		EUR	700.000	700.000	0	% 109,890	769.230,00	0,14
XS0805582011	3,7550 % Gaz Capital S.A. MTN GAZPROM 12/17		EUR	1.550.000	1.550.000	0	% 100,100	1.551.550,00	0,29
XS0491042353	4,2500 % GE Capital Europ.Fund.Unltd.Co MTN 10/17		EUR	1.350.000	1.350.000	0	% 100,000	1.350.000,00	0,25
XS1506612693	0,8750 % GELF Bond Issuer I S.A. MTN 16/22		EUR	1.100.000	1.400.000	300.000	% 99,819	1.098.003,50	0,20
ES00000950E9	4,9500 % Generalitat de Catalunya Bonos 10/20 ¹⁾		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 107,440	2.148.800,00	0,40
XS0495973470	5,2500 % Glencore Finance Europe S.A. MTN 10/17		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 100,370	1.003.700,00	0,19
LU1556942974	0,6250 % Großherzogtum Luxemburg Bonds 17/27		EUR	2.000.000	3.050.000	1.050.000	% 101,440	2.028.800,00	0,37
DE000A2AAPV8	0,1000 % Hamburger Sparkasse AG Pfe. Ausg.30 16/22		EUR	1.300.000	0	0	% 100,426	1.305.531,50	0,24
XS0834382151	2,7500 % Hammerson PLC Bonds 12/19		EUR	200.000	0	300.000	% 106,591	213.182,00	0,04
XS1044496203	2,2500 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 14/19		EUR	900.000	0	0	% 104,617	941.548,50	0,17
XS1549372420	0,5000 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 17/21 ¹⁾		EUR	700.000	1.300.000	600.000	% 101,059	707.409,50	0,13
XS1040041649	1,2500 % Hella KGaA Hueck & Co. Anl. 14/17		EUR	250.000	250.000	0	% 100,882	252.205,00	0,05
XS1488370740	0,0000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 16/18		EUR	150.000	150.000	0	% 100,477	150.715,50	0,03
XS1488418960	0,0000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 16/21		EUR	550.000	550.000	0	% 100,409	552.249,50	0,10
XS1366026596	0,6500 % Honeywell International Inc. Notes 16/20 ¹⁾		EUR	500.000	0	0	% 102,135	510.675,00	0,09
XS0302868475	4,8750 % HSBC Finance Corp. MTN 07/17		EUR	700.000	700.000	0	% 101,286	708.998,50	0,13
FR0013062684	0,2210 % HSBC France S.A. FLR MTN 15/19		EUR	500.000	0	0	% 101,039	505.195,00	0,09
XS0969636371	3,3750 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 13/24		EUR	400.000	0	0	% 105,307	421.226,00	0,08
XS0433028254	6,0000 % HSBC Holdings PLC MTN 09/19		EUR	500.000	0	0	% 113,678	568.390,00	0,11
XS0790010747	2,5000 % Hutch.Whampoa Eur.Fin.(12)Ltd. Notes 12/17		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 100,685	1.308.898,50	0,24
XS0645669200	4,5000 % Imperial Brands Finance PLC MTN 11/18		EUR	400.000	0	0	% 106,323	425.290,00	0,08
XS1169586606	0,7000 % ING Bank N.V. MTN 15/20		EUR	400.000	0	0	% 102,421	409.684,00	0,08
XS0304508921	4,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.a. MTN 07/17 ¹⁾		EUR	1.200.000	0	0	% 101,419	1.217.028,00	0,22
XS0452166324	5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.a. MTN 09/19 ¹⁾		EUR	900.000	700.000	500.000	% 108,764	978.876,00	0,18
XS0555977312	4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.a. MTN 10/18 ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 106,550	639.297,00	0,12
XS0852993285	4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.a. MTN 12/17		EUR	500.000	0	0	% 102,823	514.112,50	0,10
XS1168003900	1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.a. MTN 15/20		EUR	1.500.000	0	1.000.000	% 101,724	1.525.852,50	0,28
XS0972240997	5,3500 % Intesa Sanpaolo Vita S.p.a. Notes 13/18 ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 107,994	323.982,00	0,06
XS1375841159	0,5000 % Intl Business Machines Corp. Notes 16/21		EUR	1.200.000	0	0	% 102,244	1.226.928,00	0,23
XS1023541847	2,8750 % Israel MTN 14/24		EUR	800.000	800.000	0	% 113,400	907.200,00	0,17
XS1145526585	1,1250 % ISS Global A/S MTN 14/20		EUR	1.075.000	0	0	% 102,737	1.104.417,38	0,20
XS1330300341	1,1250 % ISS Global A/S MTN 15/21		EUR	725.000	0	0	% 103,090	747.402,50	0,14
XS1551917245	0,5000 % Italgas S.P.A. MTN 17/22 ¹⁾		EUR	100.000	875.000	775.000	% 99,914	99.913,50	0,02
XS0997941355	4,1250 % K+S Aktiengesellschaft Anl. 13/21		EUR	300.000	0	0	% 113,435	340.305,00	0,06
XS1531060025	0,5000 % Knorr-Bremse AG MTN 16/21		EUR	525.000	525.000	0	% 102,068	535.854,38	0,10
BE0000342510	0,5000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.82 17/24		EUR	1.000.000	2.275.000	1.275.000	% 101,714	1.017.140,00	0,19
XS0546649822	4,5000 % Königreich Marokko Notes 10/20 Reg.S		EUR	500.000	0	0	% 111,536	557.680,00	0,10
ES00000122D7	4,0000 % Königreich Spanien Bonos 10/20 ¹⁾		EUR	800.000	0	0	% 112,521	900.168,00	0,17
ES00000122T3	4,8500 % Königreich Spanien Bonos 10/20		EUR	1.900.000	0	0	% 117,338	2.229.412,50	0,41
ES00000123K0	5,8500 % Königreich Spanien Bonos 11/22 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 126,495	1.264.945,00	0,23
ES00000123U9	5,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23 ¹⁾		EUR	3.000.000	1.000.000	800.000	% 127,307	3.819.210,00	0,71
ES00000123X3	4,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23 ¹⁾		EUR	1.600.000	900.000	800.000	% 122,508	1.960.120,00	0,36
ES00000124V5	2,7500 % Königreich Spanien Bonos 14/19		EUR	2.500.000	0	0	% 106,273	2.656.812,50	0,49
ES00000126C0	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 14/20 ¹⁾		EUR	3.000.000	0	0	% 104,184	3.125.505,00	0,58

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
E50000124W3	3,8000 % Königreich Spanien Bonos 14/24		EUR	700.000	1.200.000	1.500.000	% 118,738	831.162,50	0,15
E50000127H7	1,1500 % Königreich Spanien Bonos 15/20 ¹⁾		EUR	3.000.000	700.000	0	% 103,751	3.112.515,00	0,58
E50000128B8	0,7500 % Königreich Spanien Bonos 16/21		EUR	3.000.000	0	1.500.000	% 102,339	3.070.170,00	0,57
E50000126W8	0,5500 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflation 14/19		EUR	1.000.000	3.400.000	2.400.000	% 105,517	1.055.166,06	0,20
E50000126A4	1,8000 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflation 14/24		EUR	500.000	1.800.000	1.300.000	% 113,813	569.067,24	0,11
E50000128D4	0,3000 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflation 16/21		EUR	500.000	1.100.000	800.000	% 105,740	528.699,52	0,10
E50000128O1	0,4000 % Königreich Spanien Obligaciones 17/22 ¹⁾		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 99,588	3.983.500,00	0,73
E50000128P8	1,5000 % Königreich Spanien Obligaciones 17/27		EUR	600.000	1.000.000	400.000	% 98,814	592.884,00	0,11
DE000A2AARZ5	0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 16/21 ¹⁾		EUR	4.350.000	0	0	% 101,676	4.422.906,00	0,81
DE000A168Y22	0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 16/23 ¹⁾		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 102,889	1.028.890,00	0,19
XS1087815483	0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 14/19 ¹⁾		EUR	2.000.000	0	0	% 102,304	2.046.080,00	0,38
DE000A14KQW5	0,2500 % Land Berlin Landessch. Ausg.470 15/20		EUR	3.500.000	0	0	% 101,858	3.565.030,00	0,66
DE000A1RQCT2	0,3750 % Land Hessen Schatzanw. S.1515 15/22		EUR	1.000.000	0	0	% 102,526	1.025.260,00	0,19
DE000A161YU8	0,1250 % Land Niedersachsen Landessch. Ausg.854 15/19		EUR	3.000.000	0	0	% 101,258	3.037.740,00	0,56
DE000NRW0HH6	0,3750 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1377 15/21 ¹⁾		EUR	2.000.000	0	0	% 102,574	2.051.470,00	0,38
XS0468940068	5,8750 % Landesbank Berlin AG Nachr. MTN IHS 09/19		EUR	2.500.000	1.100.000	0	% 113,510	2.837.750,00	0,52
DE000LB5MH0	1,8750 % Landesbank Berlin AG Pfe. S.491 12/18		EUR	1.000.000	0	0	% 102,030	1.020.300,00	0,19
XS1377695652	0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H291 16/20		EUR	1.000.000	0	600.000	% 101,272	1.012.715,00	0,19
DE000LB06FB4	0,0500 % Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. 16/20		EUR	900.000	0	0	% 100,933	908.392,50	0,17
XS0984200617	2,3750 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 13/19		EUR	1.500.000	600.000	0	% 104,963	1.574.445,00	0,29
XS1295413345	1,3750 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 15/18		EUR	500.000	0	0	% 102,315	511.575,00	0,09
XS1418631930	1,0000 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 16/21 ¹⁾		EUR	700.000	0	400.000	% 101,795	712.565,00	0,13
XS0828235225	1,7500 % Linde AG MTN 12/20		EUR	500.000	0	0	% 106,632	533.160,00	0,10
XS0297699588	4,7500 % Linde Finance B.V. MTN 07/17		EUR	300.000	300.000	0	% 100,738	302.212,50	0,06
XS1518704900	0,2500 % Linde Finance B.V. MTN 17/22		EUR	875.000	875.000	0	% 100,929	883.124,38	0,16
XS0969350999	3,7790 % Madriëna Red de Gas Fin. B.V. MTN 13/18		EUR	500.000	0	0	% 105,843	529.212,50	0,10
XS0756457833	2,1250 % MAN SE MTN 12/17		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 100,068	1.000.675,00	0,18
XS1403263723	0,5000 % McDonald's Corp. MTN 16/21		EUR	400.000	0	0	% 101,270	405.080,00	0,07
XS1567173809	0,6250 % McKesson Corp. Notes 17/21		EUR	1.350.000	1.350.000	0	% 100,822	1.361.097,00	0,25
XS1137512312	0,8750 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 14/17		EUR	1.300.000	0	0	% 100,683	1.308.872,50	0,24
XS1046272420	2,2500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 14/19		EUR	1.100.000	300.000	0	% 103,977	1.143.747,00	0,21
PTMTLDOM0005	5,7500 % Metropolitan de Lisboa Notes 09/19		EUR	200.000	0	0	% 109,592	219.184,00	0,04
XS1050665386	2,3750 % mFinance France S.A. MTN 14/19		EUR	450.000	0	450.000	% 104,365	469.642,50	0,09
XS1496343986	1,3980 % mFinance France S.A. MTN 16/20		EUR	1.980.000	1.450.000	250.000	% 102,518	1.230.210,00	0,23
XS0794392588	2,7500 % Michelin Luxembourg SCS MTN 12/19		EUR	400.000	0	0	% 107,003	428.010,00	0,08
XS1529837947	0,1860 % Morgan Stanley FLR MTN S.G 16/19		EUR	725.000	725.000	0	% 100,454	728.291,50	0,13
XS1511787407	0,3720 % Morgan Stanley FLR MTN S.G 16/22 ¹⁾		EUR	1.400.000	1.400.000	0	% 101,091	1.415.274,00	0,26
XS0901370691	2,2500 % Morgan Stanley MTN 13/18		EUR	350.000	0	0	% 102,518	358.811,25	0,07
XS1268460885	0,3750 % Nationwide Building Society MT Mortg.Cov.Bds 15/20		EUR	300.000	0	0	% 101,681	305.041,50	0,06
XS1569896498	0,5000 % Nationwide Building Society MT Mortg.Cov.Bds 17/24		EUR	1.400.000	1.400.000	0	% 100,690	1.409.660,00	0,26
XS1402175811	0,5000 % Nationwide Building Society MTN 16/19 ¹⁾		EUR	600.000	0	0	% 101,475	608.850,00	0,11
XS0419587745	5,1250 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 09/17		EUR	200.000	200.000	0	% 100,453	200.906,00	0,04
XS1520713022	0,0000 % Nederlandse Gasunie, N.V. MTN 16/19		EUR	1.330.000	1.330.000	0	% 100,502	1.336.669,95	0,25
FR0010817452	4,3750 % New Areva Holding MT Bonds 09/19 ¹⁾		EUR	700.000	700.000	0	% 102,061	714.423,50	0,13
XS1385996126	2,2500 % NIBC Bank N.V. MTN 16/19		EUR	625.000	625.000	0	% 104,690	654.309,38	0,12
XS1316421137	0,1250 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. MT L.d.G.Publ. 15/18		EUR	3.000.000	0	3.000.000	% 100,461	3.013.830,00	0,56
XS1432510631	0,3750 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. MT L.d.G.Publ. 16/23		EUR	1.000.000	0	0	% 100,186	1.001.860,00	0,19
XS1569741884	0,2500 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. MT L.d.G.Publ. 17/21		EUR	900.000	900.000	0	% 100,540	904.860,00	0,17
DE000NLB8G16	0,6250 % Norddte Ldsbk -GZ- MTN IHS 15/18		EUR	2.000.000	0	0	% 101,092	2.021.830,00	0,37
DE000NLB8KA9	1,0000 % Norddte Ldsbk -GZ- MTN IHS 16/21		EUR	500.000	0	0	% 102,008	510.037,50	0,09
XS0497179035	4,5000 % Nordea Bank AB MTN 10/20 ¹⁾		EUR	1.200.000	0	0	% 113,395	1.360.734,00	0,25
DE000NWB1658	0,5000 % NRW.BANK IHS Ausg.16S 14/18		EUR	2.000.000	0	0	% 101,155	2.023.100,00	0,37
XS0912992160	1,8750 % O2 Telefónica Dtlid. Finanzier. Anl. 13/18		EUR	1.000.000	0	0	% 103,525	1.035.250,00	0,19
XS1138423774	0,6000 % OMV AG MTN 14/18		EUR	1.000.000	0	0	% 101,373	1.013.730,00	0,19
FR0011022110	5,0000 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 11/17		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 100,265	1.303.445,00	0,24
XS1508351357	0,1250 % PKO Bank Hipoteczny S.A. Mortg.Cov. MTN 16/22		EUR	500.000	800.000	300.000	% 98,775	493.875,00	0,09
XS1072613380	2,8750 % Poste Vita S.p.A. Notes 14/19		EUR	800.000	0	0	% 104,717	837.732,00	0,15
XS1405766467	0,0000 % PPG Industries Inc. Notes 16/19		EUR	600.000	600.000	0	% 100,527	603.159,00	0,11
XS1548539441	0,5000 % PSA Banque France S.A. MTN 17/20		EUR	300.000	300.000	0	% 100,921	302.763,00	0,06

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
FR0012674182	0,2530 % RCI Banque FLR MTN 15/18		EUR	700.000	0	0	% 100,395	702.761,50	0,13
XS0775870982	4,2500 % RCI Banque MTN 12/17		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 100,799	1.612.784,00	0,30
XS0905797113	2,8750 % RCI Banque MTN 13/18 ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 102,693	308.077,50	0,06
FR0012173144	1,1250 % RCI Banque MTN 14/19		EUR	700.000	0	0	% 102,723	719.061,00	0,13
FR0013181989	0,3750 % RCI Banque MTN 16/19		EUR	825.000	0	0	% 100,817	831.740,25	0,15
FR0010871541	5,6250 % Renault S.A. MTN 10/17		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 100,320	1.504.800,00	0,28
FR0010850032	1,3000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 09/19 ¹⁾		EUR	2.000.000	3.600.000	1.600.000	% 115,275	2.305.491,32	0,43
FR0011237643	0,2500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 12/18 ¹⁾		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 108,053	3.241.578,69	0,60
FR0013140035	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 16/21		EUR	400.000	2.000.000	1.600.000	% 106,724	426.896,87	0,08
FR0013238268	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 17/28		EUR	1.150.000	1.150.000	0	% 106,371	1.223.270,88	0,23
FR0012968337	0,2500 % Rep. Frankreich OAT 15/20 ¹⁾		EUR	4.000.000	0	0	% 102,144	4.085.760,00	0,75
FR0013219177	0,0000 % Rep. Frankreich OAT 16/22		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 100,020	4.000.800,00	0,73
XS1207054666	3,8750 % Repsol Intl Finance B.V. FLR Securit.15/Und. ¹⁾		EUR	500.000	700.000	500.000	% 103,050	515.250,00	0,10
XS0933604943	2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 13/20		EUR	600.000	0	0	% 108,199	649.191,00	0,12
XS1084368593	2,8750 % Republik Indonesien MTN 14/21 Reg.S ¹⁾		EUR	400.000	0	300.000	% 107,250	429.000,00	0,08
IE00B453JD47	3,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 13/23 ¹⁾		EUR	1.200.000	2.500.000	3.800.000	% 122,487	1.469.844,00	0,27
IE00B6X95T99	3,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 14/24		EUR	1.000.000	3.470.000	2.470.000	% 120,634	1.206.340,00	0,22
IE00BJ38CR43	2,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 14/30		EUR	370.000	370.000	0	% 112,836	417.493,20	0,08
IE00BJ38CQ36	0,8000 % Republik Irland Treasury Bonds 15/22 ¹⁾		EUR	5.000.000	4.500.000	0	% 104,405	5.220.250,00	0,95
IT0003493258	4,2500 % Republik Italien B.T.P. 03/19		EUR	800.000	0	0	% 107,919	863.348,00	0,16
IT0003644769	4,5000 % Republik Italien B.T.P. 04/20		EUR	1.000.000	1.500.000	500.000	% 111,999	1.119.990,00	0,21
IT0004009673	3,7500 % Republik Italien B.T.P. 06/21 ¹⁾		EUR	700.000	0	0	% 112,955	790.685,00	0,15
IT0004634132	3,7500 % Republik Italien B.T.P. 10/21		EUR	2.000.000	0	0	% 112,415	2.248.300,00	0,42
IT0004966401	3,7500 % Republik Italien B.T.P. 13/21		EUR	2.000.000	0	0	% 112,491	2.249.820,00	0,42
IT0004992308	2,5000 % Republik Italien B.T.P. 14/19		EUR	4.000.000	0	0	% 105,073	4.202.920,00	0,77
IT0005030504	1,5000 % Republik Italien B.T.P. 14/19		EUR	2.000.000	0	0	% 102,929	2.058.580,00	0,38
IT0005069395	1,0500 % Republik Italien B.T.P. 14/19		EUR	3.000.000	0	0	% 101,934	3.058.020,00	0,57
IT0005028003	2,1500 % Republik Italien B.T.P. 14/21		EUR	1.000.000	1.000.000	1.500.000	% 105,726	1.057.255,00	0,20
IT0005107708	0,7000 % Republik Italien B.T.P. 15/20		EUR	2.400.000	1.000.000	600.000	% 100,940	2.422.548,00	0,45
IT0005142143	0,6500 % Republik Italien B.T.P. 15/20		EUR	2.000.000	0	2.000.000	% 100,655	2.013.100,00	0,37
IT0005086886	1,3500 % Republik Italien B.T.P. 15/22		EUR	500.000	1.600.000	1.500.000	% 101,402	507.010,00	0,09
IT0005175598	0,4500 % Republik Italien B.T.P. 16/21		EUR	2.000.000	0	0	% 99,042	1.980.830,00	0,37
IT0005216491	0,3500 % Republik Italien B.T.P. 16/21		EUR	3.500.000	4.500.000	1.000.000	% 97,779	3.422.247,50	0,63
IT0004380546	2,3500 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 08/19		EUR	2.000.000	1.400.000	0	% 119,857	2.397.141,19	0,44
IT0004604671	2,1000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 10/21		EUR	1.000.000	500.000	1.500.000	% 119,785	1.197.853,57	0,22
IT0005012783	1,6500 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 14/20		EUR	1.400.000	2.000.000	600.000	% 105,114	1.471.600,08	0,27
XS1028953989	3,8750 % Republik Kroatien Notes 14/22 ¹⁾		EUR	900.000	900.000	0	% 108,875	979.875,00	0,18
XS1566190945	2,2500 % Republik Lettland MTN 17/47		EUR	500.000	625.000	125.000	% 99,975	499.875,00	0,09
XS1306382364	0,8750 % Republik Polen MTN 15/21 ¹⁾		EUR	400.000	0	600.000	% 102,975	411.900,00	0,08
XS1536786939	0,5000 % Republik Polen MTN 16/21		EUR	1.350.000	1.350.000	0	% 101,063	1.364.343,75	0,25
PTOTESOE0013	2,2000 % Republik Portugal Obr. 15/22		EUR	1.500.000	2.600.000	1.100.000	% 98,261	1.473.915,00	0,27
XS0972758741	4,6250 % Republik Rumänien MTN 13/20		EUR	500.000	0	1.000.000	% 115,561	577.805,00	0,11
XS1060842975	3,6250 % Republik Rumänien MTN 14/24 ¹⁾		EUR	800.000	800.000	0	% 112,900	903.200,00	0,17
SI0002103685	1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27		EUR	400.000	1.350.000	950.000	% 98,710	394.840,00	0,07
XS0483954144	4,6250 % Republik Zypern MTN 10/20		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 108,510	2.170.200,00	0,40
XS1081101807	4,7500 % Republik Zypern MTN 14/19 ¹⁾		EUR	3.100.000	1.800.000	0	% 108,700	3.369.700,00	0,62
XS1227247191	3,8750 % Republik Zypern MTN 15/22		EUR	1.600.000	1.400.000	400.000	% 105,450	1.687.200,00	0,31
XS1520733301	1,0000 % Sampo OYJ MTN 16/23		EUR	1.375.000	1.375.000	0	% 100,705	1.384.686,88	0,26
FR0012969020	0,8750 % Sanofi S.A. MTN 15/21 ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 103,478	310.434,00	0,06
XS0759014375	4,0000 % Santander Intl Debt S.A.U. MTN 12/17		EUR	500.000	500.000	0	% 100,301	501.505,00	0,09
XS1567901761	1,1250 % Securitas AB MTN 17/24		EUR	800.000	1.000.000	200.000	% 100,404	803.228,00	0,15
DE000A2DADR6	1,1250 % Sixt Leasing SE Anl. 17/21		EUR	2.250.000	2.250.000	0	% 99,550	2.239.875,00	0,41
XS0854425625	1,8750 % Skandinaviska Enskilda Banken MTN 12/19		EUR	205.000	0	0	% 105,520	216.316,00	0,04
SK4120011636	0,0000 % Slowakei Anl. S.230 16/23		EUR	800.000	0	500.000	% 97,620	780.960,00	0,14
SK4120012220	0,6250 % Slowakei Anl. S.231 16/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 97,470	974.700,00	0,18
XS0506435576	4,1250 % Smiths Group PLC Notes 10/17		EUR	500.000	500.000	0	% 100,714	503.567,50	0,09
XS1508588875	0,0000 % Snam S.p.A. MTN 16/20		EUR	700.000	1.100.000	400.000	% 99,337	695.355,50	0,13
XS0876828541	2,2500 % Société Générale S.A. MTN 13/20 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 106,517	1.065.170,00	0,20
XS1429528588	0,7500 % SpareBank 1 SMN MTN 16/21 ¹⁾		EUR	300.000	0	300.000	% 102,609	307.827,00	0,06
XS1516271290	0,3750 % SpareBank 1 SR Bank ASA MTN 16/22		EUR	1.225.000	1.225.000	0	% 99,955	1.224.448,75	0,23
XS1565074744	0,3750 % Sparebanken Vest Boligkred. AS MT Hyp.-Pfe. 17/24		EUR	950.000	950.000	0	% 100,432	954.104,00	0,18
XS0606202454	4,1250 % Südzucker Intl Finance B.V. Notes 11/18		EUR	900.000	0	0	% 104,642	941.778,00	0,17
XS0630463965	4,7500 % Telecom Italia S.p.A. MTN 11/18		EUR	1.400.000	0	0	% 105,875	1.482.250,00	0,27
XS0868458653	4,0000 % Telecom Italia S.p.A. MTN 12/20 ¹⁾		EUR	1.000.000	200.000	0	% 109,545	1.095.450,00	0,20
XS1505554698	0,3180 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 16/20		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 100,340	1.605.440,00	0,30
XS1490960942	3,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 16/Und.		EUR	300.000	800.000	500.000	% 101,325	303.975,00	0,06
XS0301954771	4,8750 % Telenor ASA MTN 07/17		EUR	700.000	700.000	0	% 101,289	709.019,50	0,13
XS0289507997	4,7500 % Telia Company AB MTN 07/17		EUR	400.000	400.000	0	% 100,070	400.280,00	0,07
XS0292607701	4,7500 % Telstra Corp. Ltd. MTN 07/17		EUR	400.000	400.000	0	% 100,270	401.078,00	0,07

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
XS1550202029	0,1250 % The Bank of Nova Scotia MT Mortg.Cov. Bds 17/22		EUR	350.000	750.000	400.000	% 100,490	351.715,00	0,07
XS1402235060	0,3720 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN 16/19		EUR	1.500.000	0	0	% 100,977	1.514.647,50	0,28
XS1458408306	0,6720 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN S.F. 16/21 ¹⁾		EUR	750.000	0	725.000	% 102,611	769.582,50	0,14
XS0494996043	4,3750 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 10/17		EUR	300.000	300.000	0	% 100,187	300.559,50	0,06
XS1355483162	0,2500 % The Swedish Covered Bond Corp. MTN 16/21		EUR	950.000	0	0	% 101,384	963.148,00	0,18
DE000A1R08U3	4,0000 % thyssenkrupp AG MTN 13/18		EUR	300.000	0	0	% 105,735	317.203,50	0,06
DE000A14J579	1,7500 % thyssenkrupp AG MTN 15/20		EUR	600.000	600.000	0	% 103,239	619.431,00	0,11
XS0750894577	3,8750 % Tschechien MTN 12/22		EUR	3.300.000	3.300.000	0	% 119,775	3.952.575,00	0,72
XS0304031775	4,7500 % UBS AG (Jersey Branch) MTN 07/17		EUR	700.000	700.000	0	% 101,369	709.579,50	0,13
IT0004932619	1,8750 % UniCredit S.p.A. Mortg.Cov. MTN 13/19		EUR	1.000.000	0	0	% 103,840	1.038.395,00	0,19
XS0754588787	4,8750 % UniCredit S.p.A. MTN 12/17 ¹⁾		EUR	1.900.000	1.900.000	0	% 100,072	1.901.368,00	0,35
XS1374865555	2,0000 % UniCredit S.p.A. MTN 16/23 ¹⁾		EUR	150.000	600.000	450.000	% 102,235	153.352,50	0,03
XS1566100977	0,3750 % Unilever N.V. MTN 17/23 ¹⁾		EUR	775.000	775.000	0	% 99,727	772.880,38	0,14
FR0013044294	0,3000 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. MTN 15/21		EUR	700.000	0	0	% 101,511	710.573,50	0,13
XS1529854280	0,1250 % Uniper SE MTN 16/18 ¹⁾		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 100,501	1.005.005,00	0,19
IT0004807167	5,0000 % Veneto Banca S.p.A. Obbl. 12/17		EUR	4.000.000	0	0	% 100,280	4.011.200,00	0,73
IT0005239535	0,5000 % Veneto Banca S.p.A. Obbl. 17/20		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 99,133	1.288.729,00	0,24
FR0010878751	4,0000 % Vivendi S.A. Bonds 10/17		EUR	500.000	500.000	0	% 100,331	501.652,50	0,09
FR0013176302	0,7500 % Vivendi S.A. Bonds 16/21		EUR	400.000	0	1.000.000	% 101,705	406.818,00	0,08
XS0306488627	5,3750 % Voith GmbH Notes 07/17		EUR	800.000	800.000	0	% 101,559	812.472,00	0,15
XS0927639780	1,1250 % Volkswagen Bank GmbH MTN 13/18 ¹⁾		EUR	250.000	0	0	% 101,206	253.013,75	0,05
XS0782708456	1,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. MTN 12/17		EUR	2.800.000	2.800.000	0	% 100,407	2.811.396,00	0,52
XS1273542867	0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH FLR MTN 15/17		EUR	225.000	225.000	0	% 100,044	225.099,00	0,04
XS0702452995	3,2500 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 11/18		EUR	900.000	0	0	% 104,018	936.157,50	0,17
XS0302948319	5,0000 % Volvo Treasury AB MTN 07/17		EUR	1.100.000	1.100.000	0	% 101,301	1.114.311,00	0,21
DE000A1HNW52	3,1250 % Vonovia Finance B.V. Anl. 13/19 ¹⁾		EUR	400.000	0	0	% 107,697	430.786,00	0,08
DE000A18V138	1,6250 % Vonovia Finance B.V. MTN 15/20		EUR	1.600.000	0	0	% 105,145	1.682.312,00	0,31
DE000A182V54	0,8750 % Vonovia Finance B.V. MTN 16/22		EUR	300.000	0	200.000	% 101,856	305.568,00	0,06
XS1400169428	0,2920 % Wells Fargo & Co. FLR MTN 16/21 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	900.000	% 100,854	1.008.540,00	0,19
XS1558022866	0,1720 % Wells Fargo & Co. FLR MTN 17/22		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 100,152	1.802.727,00	0,33
FR0013213709	1,0000 % Wendel S.A. Bonds 16/23		EUR	200.000	500.000	300.000	% 97,858	195.716,00	0,04
XS1506396974	0,2500 % Westpac Banking Corp. MTN 16/22		EUR	1.000.000	1.150.000	150.000	% 100,222	1.002.215,00	0,19
XS1432593660	0,1250 % Westpac Sec. NZ Ltd. (Ldn Br.) MT Mtg.Co.Bds 16/21		EUR	725.000	0	0	% 100,212	726.537,00	0,13
DEM								395.944,43	0,07
DE0001345759	0,0000 % Deutsche Bank AG Zero Bonds 96/26	DEM		1.000.000	1.000.000	0	% 77,440	395.944,43	0,07
CHF								3.315.029,72	0,61
CH0024590207	2,5000 % Commerzbank Finance&Covered Bd Let.d.Ga.Pub. 06/19	CHF		400.000	400.000	0	% 103,850	389.788,92	0,07
CH0028622600	2,7500 % Commerzbank Finance&Covered Bd MT Let.d.G.P. 07/22	CHF		2.000.000	2.000.000	0	% 109,390	2.052.913,33	0,38
CH0020393150	2,7500 % Commerzbank Finance&Covered Bd Öff.-Pfe. MTN 05/20	CHF		875.000	875.000	0	% 106,245	872.327,47	0,16
GBP								2.181.049,72	0,40
XS0739933421	3,3750 % BMW Finance N.V. MTN 12/18	GBP		500.000	0	0	% 104,662	614.733,11	0,11
XS1569850313	1,1250 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 17/21	GBP		1.325.000	1.325.000	0	% 100,632	1.566.316,61	0,29
NOK								4.985.555,82	0,92
NO0010572878	3,7500 % Königreich Norwegen Anl. 10/21	NOK		25.000.000	22.500.000	12.500.000	% 111,595	3.146.627,08	0,58
NO0010646813	2,0000 % Königreich Norwegen Anl. 12/23	NOK		6.000.000	6.000.000	0	% 104,556	707.559,04	0,13
NO0010752702	2,3500 % Stadt Oslo Anl. 15/24	NOK		10.000.000	0	0	% 100,310	1.131.369,70	0,21
SEK								2.595.721,12	0,48
XS1565301071	0,4930 % Stadt Stockholm FLR MTN 17/22	SEK		24.000.000	24.000.000	0	% 103,533	2.595.721,12	0,48
USD								6.963.704,18	1,29
XS1485742438	3,8750 % Allianz SE Subord. MTN 16/Und.	USD		1.000.000	1.200.000	200.000	% 86,450	816.798,94	0,15
US06051GFZ72	2,5030 % Bank of America Corp. Notes 16/22	USD		300.000	450.000	150.000	% 97,350	275.935,37	0,05
US25152R5D13	2,8500 % Deutsche Bank AG Senior Notes 16/19	USD		600.000	0	1.400.000	% 100,742	571.096,94	0,11
XS0525827845	6,6250 % Republik Kroatien Notes 10/20 Reg.S	USD		300.000	300.000	0	% 109,847	311.357,71	0,06
XS0602546136	6,1250 % Republik Litauen Bonds 11/21 Reg.S	USD		1.800.000	0	0	% 113,250	1.926.020,41	0,36
XS0995679619	5,8750 % Republik Serbien Bonds 13/18 Reg.S	USD		1.000.000	500.000	0	% 105,375	995.606,58	0,18
XS0856951263	5,2500 % Republik Serbien Notes 12/17 Reg.S	USD		1.800.000	0	0	% 102,211	1.738.273,81	0,32
XS1480699484	2,1000 % Standard Chartered PLC MTN 16/19 Reg.S ¹⁾	USD		350.000	0	0	% 99,373	328.614,42	0,06
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								103.557.774,26	19,14
Verzinsliche Wertpapiere								103.557.774,26	19,14
EUR								96.111.845,66	17,76
ES0211845211	5,1250 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 07/17	EUR		300.000	300.000	0	% 101,462	304.384,50	0,06
XS0995111761	2,5000 % Achmea B.V. MTN 13/20	EUR		200.000	0	0	% 108,359	216.717,00	0,04
XS0878195584	2,0000 % Achmea Bank N.V. MTN 13/18	EUR		1.200.000	0	0	% 102,025	1.224.300,00	0,23
XS1291332952	0,8750 % Achmea Bank N.V. MTN 15/18	EUR		500.000	0	0	% 101,693	508.465,00	0,09

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS1357663050	0,8750 % AIB Mortgage Bank Mortg. Cov. MTN 16/23		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 103,527	1.035.270,00	0,19
XS1265810686	0,6250 % AIB Mortgage Bank MT Cov.Secs 15/20		EUR	800.000	0	0	% 102,509	820.072,00	0,15
XS1325125158	4,1250 % Allied Irish Banks PLC FLR MTN 15/25		EUR	600.000	600.000	0	% 104,387	626.322,00	0,12
XS1057481084	2,7500 % Allied Irish Banks PLC MTN 14/19		EUR	1.800.000	400.000	0	% 105,828	1.904.895,00	0,35
XS1202664386	1,3750 % Allied Irish Banks PLC MTN 15/20		EUR	500.000	0	0	% 103,891	519.452,50	0,10
XS1405774990	0,6250 % ASML Holding N.V. Notes 16/22		EUR	525.000	0	0	% 100,960	530.037,38	0,10
XS1330978211	3,5000 % Ball Corp. Notes 15/20		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 110,875	1.108.750,00	0,20
XS1330978567	4,3750 % Ball Corp. Notes 15/23		EUR	100.000	100.000	0	% 112,938	112.937,50	0,02
ES0413860554	0,1250 % Banco de Sabadell S.A. Cédulas Hipotec. 16/23 ¹⁾		EUR	600.000	1.100.000	500.000	% 97,814	586.884,00	0,11
XS1557268221	1,3750 % Banco Santander S.A. Notes 17/22		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 101,241	1.518.607,50	0,28
XS1308351714	0,6250 % Bank of Irel.Mortgage Bank PLC MT.Cov.Nts 15/21		EUR	500.000	0	0	% 102,550	512.750,00	0,09
XS1170193061	0,5000 % Bank of Irel.Mortgage Bank PLC MTN 15/20		EUR	1.000.000	0	0	% 101,900	1.018.995,00	0,19
XS1228148158	0,3750 % Bank of Irel.Mortgage Bank PLC MTN 15/22		EUR	200.000	0	0	% 101,092	202.184,00	0,04
XS1014670233	3,2500 % Bank of Ireland (The Gov.&Co.) MTN 14/19		EUR	740.000	500.000	0	% 106,329	786.834,60	0,15
ES0313307003	3,5000 % BANKIA S.A. Bonos 14/19		EUR	600.000	0	0	% 106,477	638.859,00	0,12
ES0413679350	0,6250 % Bankinter S.A. Cédulas Hipotec. 15/20		EUR	700.000	0	0	% 102,361	716.523,50	0,13
ES0213679196	6,3750 % Bankinter S.A. Obl. 09/19		EUR	800.000	200.000	0	% 114,470	915.760,00	0,17
XS0997979249	4,0000 % Bharti Airtel Intl (NL) B.V. Notes 13/18		EUR	500.000	0	0	% 106,738	533.687,50	0,10
XS1169791529	2,0000 % BPE Financiaciones S.A. MTN 15/20		EUR	1.200.000	600.000	0	% 100,874	1.210.482,00	0,22
ES0340609199	3,1250 % Caixabank S.A. Bonos 13/18		EUR	1.300.000	0	0	% 103,968	1.351.584,00	0,25
XS0989061345	5,0000 % Caixabank S.A. FLR MTN 13/23 ¹⁾		EUR	600.000	600.000	0	% 106,583	639.495,00	0,12
ES0415306051	0,6250 % Caja Rural de Navarra Cédulas Hipotec. 16/23		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 100,416	1.204.986,00	0,22
ES0422714024	3,7500 % Cajamar Caja Rural, S.C.Créd. Cédulas Hipot. 13/18		EUR	1.000.000	0	0	% 106,514	1.065.140,00	0,20
XS1265778933	3,1250 % Cellnex Telecom S.A. MTN 15/22 ¹⁾		EUR	200.000	0	100.000	% 108,168	216.335,00	0,04
XS1291367313	2,3750 % Citycon Treasury B.V. Notes 15/22		EUR	400.000	0	0	% 108,672	434.688,00	0,08
IT0004790918	0,1370 % Claris ABS 2011 S.r.l. FLR Notes 12/60 C.I.A ²⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 38,859	388.586,57	0,07
XS1415535183	0,7500 % Coca-Cola European Partn. PLC Notes 16/22		EUR	400.000	0	0	% 101,920	407.678,00	0,08
ES0000101586	2,8750 % Comunidad Autónoma de Madrid Bonos 14/19		EUR	3.000.000	800.000	0	% 105,886	3.176.565,00	0,59
XS0981442931	2,7500 % CRH Finland Services Oyj MTN 13/20		EUR	900.000	0	0	% 108,933	980.397,00	0,18
ES0205045000	1,6250 % Critería Caixa S.A.U. MTN 15/22		EUR	1.000.000	800.000	800.000	% 101,758	1.017.575,00	0,19
DE000A2DADM7	0,8500 % Daimler AG MTN 17/25		EUR	500.000	1.200.000	700.000	% 100,708	503.540,00	0,09
XS1424730973	0,7500 % Danske Bank AS MTN 16/23 ¹⁾		EUR	400.000	0	0	% 102,117	408.468,00	0,08
ES0413320088	0,6250 % Deutsche Bank S.A.E. Cédulas Hipotec. 16/21		EUR	1.500.000	1.800.000	300.000	% 102,323	1.534.845,00	0,28
XS1165750198	0,0000 % DNB Bank ASA FLR MTN 15/20 ¹⁾		EUR	200.000	0	0	% 100,426	200.852,00	0,04
XS1548410080	0,0500 % DNB Boligkredit A.S. Mortg. Cov. MTN 17/22		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 100,158	2.003.160,00	0,37
XS1087753353	4,5000 % Dufry Finance S.C.A. Notes 14/22 Reg.S ¹⁾		EUR	400.000	0	0	% 104,875	419.500,00	0,08
XS1571293171	0,8750 % Ericsson MTN 17/21		EUR	775.000	775.000	0	% 100,381	777.948,88	0,14
XS1571293684	1,8750 % Ericsson MTN 17/24		EUR	350.000	350.000	0	% 100,367	351.282,75	0,06
XS0827573766	6,2500 % ESB Finance DAC MTN S.2 12/17		EUR	182.000	182.000	0	% 103,418	188.219,85	0,03
EU000A1G0DM5	0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/21		EUR	2.550.000	2.550.000	0	% 100,786	2.570.043,00	0,47
EU000A1G0DN3	2,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/56 ¹⁾		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 101,864	1.018.635,00	0,19
XS1021817355	2,8750 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 14/18		EUR	1.300.000	500.000	0	% 102,602	1.333.826,00	0,25
XS1057487875	2,6250 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 14/19		EUR	700.000	0	0	% 104,963	734.741,00	0,14
XS1111858756	2,0000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 14/19		EUR	500.000	0	0	% 104,080	520.400,00	0,10
XS1321405968	1,2500 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 15/18		EUR	525.000	0	0	% 101,459	532.659,75	0,10
XS1383510259	1,2500 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 16/20		EUR	100.000	0	400.000	% 101,764	101.764,00	0,02
ES0378641239	0,5000 % Fdo de Tit.D.Def.Sist.Elec.FTA MT Bonos 16/20		EUR	1.700.000	0	0	% 100,805	1.713.685,00	0,32
ES0378641288	0,6250 % Fdo de Tit.D.Def.Sist.Elec.FTA MT Bonos 17/22		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 100,486	1.507.282,50	0,28
ES0378641205	0,8500 % Fdo de Tit.D.Def.Sist.Elec.FTA MT Bonos S.21 15/19 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 102,122	1.021.215,00	0,19
XS1238900515	0,0000 % General Electric Co. FLR Notes 15/20		EUR	500.000	0	0	% 100,446	502.227,50	0,09
XS1121198094	1,8750 % General Motors Fin. Intl. B.V. MTN 14/19		EUR	500.000	0	0	% 105,080	525.397,50	0,10
XS1193853006	0,8500 % General Motors Fin. Intl. B.V. MTN 15/18		EUR	925.000	425.000	0	% 100,948	933.769,00	0,17
XS1046537665	4,7500 % Grupo Antolin Dutch B.V. Notes 14/21 Reg.S		EUR	200.000	0	0	% 102,973	205.945,00	0,04

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS0511389453	4,0000 % Heraeus Finance GmbH Anl. 10/17		EUR	600.000	600.000	0	% 100,946	605.673,00	0,11
ES0244251007	5,0000 % Ibercaja Banco S.A.U. FLR Obl. 15/25		EUR	500.000	500.000	0	% 99,800	499.000,00	0,09
IT0004682545	4,2000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Obbl. 11/17		EUR	1.940.000	1.940.000	0	% 100,035	1.940.679,00	0,36
XS1314238459	2,7500 % Iren S.p.A. MTN 15/22		EUR	700.000	700.000	100.000	% 109,508	766.556,00	0,14
XS1398275112	0,0210 % John Deere Bank S.A. FLR MTN 16/20		EUR	275.000	0	0	% 100,338	275.929,50	0,05
BE0002272418	0,7500 % KBC Groep N.V. MTN 17/22		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 99,969	1.799.433,00	0,33
ES00000128Q6	2,3500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/33		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 101,539	2.030.780,00	0,38
DE000A1TM3Q7	1,0000 % Kreissparkasse Köln Hyp.-Pfe. Em. 1072 13/18		EUR	4.100.000	0	0	% 101,812	4.174.292,00	0,76
XS1346762641	1,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 16/21		EUR	100.000	0	300.000	% 103,186	103.186,00	0,02
XS1551000364	0,7500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 17/20		EUR	1.100.000	2.000.000	900.000	% 100,661	1.107.265,50	0,20
XS1416688890	2,3750 % Metrovacesa S.A. MTN 16/22		EUR	100.000	0	300.000	% 104,892	104.891,50	0,02
XS0206170390	5,5000 % Mexiko MTN 04/20		EUR	1.000.000	1.400.000	400.000	% 114,360	1.143.600,00	0,21
XS1054418196	2,3750 % Mexiko MTN 14/21		EUR	600.000	600.000	0	% 105,695	634.170,00	0,12
XS1486520403	1,0000 % Nordea Bank AB FLR MTN 16/26		EUR	300.000	500.000	200.000	% 100,178	300.534,00	0,06
XS1082660744	2,5000 % ORLEN Capital AB Notes 14/21 ¹⁾		EUR	500.000	0	250.000	% 105,364	526.817,50	0,10
XS0997484430	3,1250 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 13/20 Reg.S		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 104,450	1.566.750,00	0,29
XS1379157404	3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 16/19		EUR	1.300.000	500.000	0	% 105,175	1.367.275,00	0,25
XS1568875444	2,5000 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/21		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 100,438	1.607.000,00	0,30
XS1568874983	3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/24		EUR	400.000	700.000	300.000	% 101,440	405.760,00	0,07
XS0985031375	2,7500 % ProLogis Intl Funding II S.A. MTN 13/18		EUR	900.000	0	0	% 104,738	942.637,50	0,17
XS1082661551	1,3750 % PZU Finance AB Notes 14/19		EUR	100.000	0	0	% 102,200	102.200,00	0,02
XS1487498922	3,0000 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 16/21 ¹⁾		EUR	500.000	900.000	400.000	% 104,388	521.937,50	0,10
XS1218217377	0,6250 % Santander Consumer Bank AS MTN 15/18		EUR	800.000	0	0	% 100,874	806.992,00	0,15
XS1496344794	0,2500 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19		EUR	400.000	400.000	0	% 100,436	401.742,00	0,07
ES0413495013	0,1250 % Santander Consumer Finance SA Cédulas Hip. 16/19		EUR	2.000.000	0	0	% 99,860	1.997.200,00	0,37
XS1264601805	1,1000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/18		EUR	1.500.000	0	0	% 101,785	1.526.767,50	0,28
XS1188117391	0,9000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20 ¹⁾		EUR	200.000	0	0	% 101,920	203.839,00	0,04
XS1316037545	1,5000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20		EUR	200.000	0	0	% 103,848	207.696,00	0,04
XS1413580579	1,0000 % Santander Consumer Finance SA MTN 16/21		EUR	1.600.000	0	0	% 101,853	1.629.640,00	0,30
XS1046276504	1,3750 % Santander Intl Debt S.A.U. MTN 14/17		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 100,107	1.201.284,00	0,22
XS1087819634	1,5000 % Scentre Management Ltd. MTN 14/20		EUR	900.000	0	0	% 104,287	938.583,00	0,17
XS1562623584	2,6250 % Sigma Alimentos S.A. Notes 17/24 Reg.S		EUR	700.000	700.000	0	% 102,175	715.225,00	0,13
XS1419638215	0,2710 % Skandinaviska Enskilda Banken FLR MTN 16/20		EUR	1.750.000	0	0	% 101,366	1.773.896,25	0,33
XS1511589605	1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken FLR MTN 16/28		EUR	900.000	1.250.000	350.000	% 99,320	893.880,00	0,17
DE000A1YC392	0,7500 % Stadtparkasse München Pfe. R.6 14/18		EUR	3.000.000	0	0	% 100,630	3.018.885,00	0,56
XS1571298139	0,2500 % Svenska Handelsbanken AB MTN 17/22		EUR	1.525.000	1.525.000	0	% 99,943	1.524.130,75	0,28
XS1207477628	0,3640 % Swedbank AB FLR MTN 15/18		EUR	500.000	0	0	% 100,754	503.767,50	0,09
XS1361548693	0,1500 % Swedbank Hypotek AB MT Mortg.Cov. Bds 16/21 ¹⁾		EUR	1.000.000	0	0	% 101,073	1.010.725,00	0,19
XS1211040917	1,2500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 15/23		EUR	700.000	730.000	330.000	% 98,636	690.452,00	0,13
XS1439749109	0,3750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 16/20		EUR	1.800.000	1.100.000	800.000	% 99,360	1.788.480,00	0,33
XS1322986537	1,5000 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 15/20		EUR	900.000	0	0	% 104,784	943.056,00	0,17
XS1232125416	0,5000 % UBS AG (London Branch) MTN 15/18		EUR	975.000	0	0	% 100,929	984.052,88	0,18
XS1404902535	4,2500 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. FLR MTN 16/26 ¹⁾		EUR	100.000	400.000	400.000	% 100,200	100.200,00	0,02
XS1033018158	2,8750 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. MTN 14/19		EUR	1.500.000	700.000	500.000	% 105,420	1.581.292,50	0,29
XS1571315917	0,1250 % United Overseas Bank Ltd. MT Mortg. Cov. Bds 17/22		EUR	1.100.000	1.100.000	0	% 99,826	1.098.086,00	0,20
GBP								2.056.182,46	0,38
XS1573156681	1,8750 % Deutsche Bank AG MTN 17/20		GBP	1.600.000	1.600.000	0	% 99,907	1.877.774,65	0,35
XS1555825378	2,7500 % Jaguar Land Rover Automotive Notes 17/21 Reg.S		GBP	150.000	350.000	200.000	% 101,250	178.407,81	0,03
PLN								4.477.296,27	0,83
PL0000108510	1,5000 % Republik Polen Bonds S.0420 15/20		PLN	14.000.000	14.000.000	0	% 96,935	3.144.125,11	0,58
PL0000109492	2,2500 % Republik Polen Bonds S.0422 16/22		PLN	6.000.000	6.000.000	0	% 95,905	1.333.171,16	0,25
USD								912.449,87	0,17
XS1569829200	3,5000 % ABQ Finance Ltd. MTN 17/22		USD	350.000	350.000	0	% 99,775	329.943,78	0,06
US25152R5E95	2,9437 % Deutsche Bank AG FLR Senior Notes 16/19		USD	400.000	0	100.000	% 101,621	384.055,18	0,07

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US912828C996	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 14/19 ¹⁾		USD	200.000	1.500.000	1.300.000	% 105,020	198.450,91	0,04
Nichtnotierte Wertpapiere								1.273.131,75	0,24
Verzinsliche Wertpapiere								1.273.131,75	0,24
EUR								1.273.131,75	0,24
XS1533922263	1,2500 % Avery Dennison Corp. Notes 17/25		EUR	975.000	975.000	0	% 99,805	973.098,75	0,18
XS0751525311	3,7500 % Société Générale S.A. MTN 12/17		EUR	300.000	300.000	0	% 100,011	300.033,00	0,06
Wertpapier-Investmentanteile								1.327.560,00	0,25
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								1.327.560,00	0,25
EUR								1.327.560,00	0,25
DE000DK2J6X5	Deka-CorporateBond High Yield Euro 1-4 S (A)		ANT	13.000	13.000	0	EUR 102,120	1.327.560,00	0,25
Summe Wertpapiervermögen ³⁾								513.162.812,26	94,84
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								-33.376,44	-0,00
	EURO Bobl Future (FGBM) Juni 17		XEUR	EUR	-21.000.000			10.500,00	0,00
	EURO Bund Future (FGBL) Juni 17		XEUR	EUR	-2.000.000			2.600,00	0,00
	EURO Bund Future (FGBL) März 17		XEUR	EUR	4.500.000			105.160,00	0,02
	EURO Buxl Future (FGBX) Juni 17		XEUR	EUR	-300.000			660,00	0,00
	EURO Buxl Future (FGBX) März 17		XEUR	EUR	-2.300.000			-121.100,00	-0,02
	EURO-BTP Future (FBTP) März 17		XEUR	EUR	-10.500.000			-25.500,00	-0,00
	Five-Year US Treasury Note Future (FV) März 17		XCBT	USD	-1.000.000			-3.956,44	-0,00
	SHORT EURO-BTP Future (FBTS) März 17		XEUR	EUR	-5.000.000			-1.740,00	-0,00
Optionsrechte								-4.620,00	-0,00
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte								-4.620,00	-0,00
	EURO Bund Future (FGBL) Put Apr. 17 162		XEUR	EUR	Anzahl 60		EUR -0,077	-4.620,00	-0,00
Summe Zins-Derivate								EUR -37.996,44	-0,00
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)								-51.949,10	-0,01
Offene Positionen									
	CAD/AUD 2.000.000,00		OTC					-20.566,05	-0,00
	CZK/EUR 60.000.000,00		OTC					-4.451,87	-0,00
	PLN/EUR 4.000.000,00		OTC					1.931,49	0,00
	SEK/EUR 30.000.000,00		OTC					-28.433,07	-0,01
	USD/EUR 1.500.000,00		OTC					-429,60	-0,00
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								-213.097,05	-0,03
Offene Positionen									
	GBP/EUR 2.500.000,00		OTC					-52.711,13	-0,01
	NOK/EUR 47.723.636,18		OTC					-56.391,93	-0,00
	PLN/EUR 11.900.000,00		OTC					-46.158,65	-0,01
	SEK/EUR 10.000.000,00		OTC					12.654,35	0,00
	USD/EUR 7.850.000,00		OTC					-70.489,69	-0,01
Summe Devisen-Derivate								EUR -265.046,15	-0,04
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsswaps								-299.267,46	-0,05
(Erhalten/Zahlen)									
	IRS 0.13% EUR / EURIBORM06 EUR / JPM_LDN 08.12.2021		OTC	EUR	30.000.000			114.074,12	0,02
	IRS 2.115% USD / LIBUSDM03 USD / CITIGMX_LDN 25.11.2026		OTC	USD	4.000.000			-47.156,27	-0,01
	IRS BUBORM06 HUF / 1.555% HUF / JPM_LDN 14.02.2022		OTC	HUF	900.000.000			-11.366,20	-0,00
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.019% EUR / DGZ_FRA 21.10.2022		OTC	EUR	20.000.000			148.326,80	0,03
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.166% EUR / DGZ_FRA 11.02.2022		OTC	EUR	16.000.000			-68.492,30	-0,01
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.277% EUR / DGZ_FRA 29.01.2022		OTC	EUR	16.000.000			-162.512,88	-0,03
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.479% EUR / DBK_FRA 15.02.2025		OTC	EUR	15.100.000			-40.142,48	-0,01
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.675% EUR / DGZ_FRA 14.05.2022		OTC	EUR	8.000.000			-282.964,02	-0,05
	IRS LIBUSDM03 USD / 2.39% USD / CITIGMX_LDN 25.11.2046		OTC	USD	1.600.000			50.965,77	0,01
Credit Default Swaps (CDS)								-395.344,58	-0,07
Protection Buyer									
	CDS Barclays Bank PLC682 06DABK / BNP_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	2.000.000			-26.881,41	-0,00
	CDS Credit Agricole S.A.977 FH49GG / CITIGMX_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	1.000.000			-7.981,35	-0,00
	CDS Credit Agricole S.A.977 FH49GG / CSFBINT_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	400.000			-3.192,54	-0,00
	CDS Credit Agricole S.A.977 FH49GG / CSFBINT_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	400.000			-3.192,54	-0,00
	CDS EDP-Energias de Portuga X3DGB7 / BNP_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	1.000.000			-163.651,45	-0,03

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CDS EDP-Energias de Portuga X3DGB7 / MERRILL_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	1.000.000				-163.651,45	-0,03
CDS ITRAXX EUROPE SEN FINANCIALS S26 V1 5Y / BNP_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	3.500.000				-14.890,14	-0,00
CDS Lloyds Bank PLC9730 GLA88B / BNP_LDN 20.06.2021		OTC	EUR	1.500.000				-27.750,55	-0,01
CDS Wells Fargo + Co.1365 / BNP_LDN 20.12.2020		OTC	USD	2.500.000				-60.329,14	-0,01
Protection Seller								76.175,99	0,01
CDS JPMorgan Chase + Co.148 4C933G / BNP_LDN 20.12.2017		OTC	EUR	-3.000.000				23.882,20	0,00
CDS UBS AG2161 HPHB2JAG6 / BNP_LDN 20.12.2021		OTC	EUR	-2.000.000				44.440,81	0,01
CDS Volkswagen AG13 / JPM_LDN 20.12.2017		OTC	EUR	-1.000.000				7.852,98	0,00
Inflation Swaps (IFS)									
Protection Buyer								5.670,93	0,00
IFS 1,295% EUR / Euro HICP Ex-Tobacco EUR / DTBKLDN_FRA 15.02.2022		OTC	STK	-10.000.000				5.670,93	0,00
Protection Seller								-33.101,20	-0,01
IFS France CPI Ex-Tobacco EUR / 1,415% EUR / DTBKLDN_FRA 15.02.2022		OTC	STK	10.000.000				-33.101,20	-0,01
Summe Swaps							EUR	-722.042,31	-0,13
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	18.390.652,98			% 100,000	18.390.652,98	3,39
EUR-Guthaben bei									
DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A.			EUR	1.395,80			% 100,000	1.395,80	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	7.000.959,61			% 100,000	7.000.959,61	1,28
Landesbank Berlin AG			EUR	27.906,57			% 100,000	27.906,57	0,01
Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-			EUR	30.450,23			% 100,000	30.450,23	0,01
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale			CZK	30.000.000,00			% 100,000	1.110.083,26	0,21
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	5.456.386,00			% 100,000	734.066,00	0,14
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	21.122,55			% 100,000	2.382,37	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			PLN	100.241,27			% 100,000	23.224,16	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	395.600,11			% 100,000	41.326,30	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	2.507.929,09			% 100,000	2.353.305,17	0,43
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	701.319,00			% 100,000	5.895,17	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			SGD	141,26			% 100,000	95,16	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	1.342.587,05			% 100,000	1.268.506,28	0,23
Summe Bankguthaben							EUR	30.990.249,06	5,71
Geldmarktpapiere									
NOK									
NO0010779598 1,3000 % Stadt Oslo Cert. of Deposit 16/17			NOK	20.000.000	20.000.000	0	% 100,030	2.256.434,55	0,42
Summe Geldmarktpapiere							EUR	2.256.434,55	0,42
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	33.246.683,61	6,13
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	4.813.538,71				4.813.538,71	0,88
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	589.391,45				589.391,45	0,11
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	9.895,47				9.895,47	0,00
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	31.130,40				31.130,40	0,01
Forderungen aus Wertpapiergeschäften			EUR	1.418.026,26				1.418.026,26	0,26
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	550.000,00				550.000,00	0,10
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	7.411.982,29	1,36
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	-1.486.261,75			% 100,000	-1.745.914,09	-0,32
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-1.745.914,09	-0,32
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen			EUR	-4.848,74				-4.848,74	-0,00
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-161.058,40				-161.058,40	-0,03
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften			EUR	-9.554.094,63				-9.554.094,63	-1,77
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-235.884,83				-235.884,83	-0,04
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-9.955.886,60	-1,84
Fondsvermögen									
Umlaufende Anteile							EUR	541.094.592,57	100,00
Anteilwert							STK	6.204.914	
							EUR	87,20	

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

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

²⁾ Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um Poolfaktoranleihen, deren Kurswert auch durch Teilrückzahlung oder Teilzinskaptalisierung beeinflusst wird.

³⁾ Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Gattungsbezeichnung

Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)

Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen		gesamt
		befristet	unbefristet	
1,6250 % Aareal Bank AG MTN IHS S.210 14/19	EUR	2.000.000	2.050.540,00	
0,0000 % Allianz Finance II B.V. MTN 16/20	EUR	700.000	704.151,00	
0,6250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 17/22	EUR	300.000	300.655,50	
2,6250 % Banco BPM S.p.A. MTN 15/18	EUR	500.000	510.292,50	
0,1250 % Banco de Sabadell S.A. Cédulas Hipotec. 16/23	EUR	600.000	586.884,00	
1,8750 % Barclays PLC MTN 16/21	EUR	400.000	416.272,00	
3,5000 % BBVA Sub.Capital S.A.U. FLR MTN 14/24	EUR	400.000	419.206,00	
0,1250 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. S.194 15/20	EUR	1.300.000	1.314.599,00	
0,5000 % Berlin Hyp AG IHS S.112 16/23	EUR	500.000	504.122,50	
2,3750 % Bilfinger SE IHS 12/19	EUR	150.000	156.905,25	
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 12/22	EUR	3.000.000	3.373.200,00	
1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23	EUR	429.920	482.000,51	
2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23	EUR	2.000.000	2.314.490,00	
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.172 15/20	EUR	550.000	570.592,00	
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 09/20	EUR	200.000	245.271,34	
5,0000 % Caixabank S.A. FLR MTN 13/23	EUR	600.000	639.495,00	
5,9760 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 11/21	EUR	400.000	472.800,00	
3,9940 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 12/20	EUR	1.500.000	1.703.625,00	
3,1250 % Cellnex Telecom S.A. MTN 15/22	EUR	200.000	216.335,00	
4,5000 % CEZ AS MTN 10/20	EUR	500.000	573.115,00	
0,5000 % Citigroup Inc. FLR MTN 16/21	EUR	200.000	204.203,00	
6,3750 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN S.773 11/19	EUR	200.000	223.800,00	
0,5000 % Commerzbank AG MTN Anl. S.871 16/23	EUR	81.000	77.465,97	
4,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 12/22	EUR	500.000	580.770,00	
0,0110 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) FLR MTN 15/17	EUR	600.000	600.174,00	
0,7500 % Danske Bank AS MTN 16/23	EUR	400.000	408.468,00	
0,2230 % Deutsche Bank AG FLR MTN 14/19	EUR	5.300.000	5.259.826,00	
1,5000 % Deutsche Bank AG MTN 17/22	EUR	800.000	810.576,00	
1,1250 % Deutsche Lufthansa AG MTN 14/19	EUR	100.000	102.443,00	
1,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35254 16/20	EUR	520.000	531.999,01	
1,6250 % Dexia Crédit Local S.A. MTN 13/18	EUR	2.000.000	2.059.760,00	
0,0400 % Dexia Crédit Local S.A. MTN 16/19	EUR	1.250.000	1.253.012,50	
0,0000 % DNB Bank ASA FLR MTN 15/20	EUR	200.000	200.852,00	
4,5000 % Dufry Finance S.C.A. Notes 14/22 Reg.S	EUR	400.000	419.500,00	
1,0000 % DVB Bank SE MTN IHS 17/22	EUR	600.000	606.501,00	
2,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/56	EUR	1.000.000	1.018.635,00	
0,0000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) MTN 16/22	EUR	1.000.000	1.003.110,00	
1,1250 % Eutelsat S.A. Bonds 16/21	EUR	300.000	307.044,00	
0,8500 % Fdo de Tit.D.Def.Sist.Elec.FTA MT Bonos S.21 15/19	EUR	1.000.000	1.021.215,00	
2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA Notes 13/20 Reg.S	EUR	800.000	868.072,00	
4,9500 % Generalitat de Catalunya Bonos 10/20	EUR	600.000	644.640,00	
0,5000 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 17/21	EUR	679.000	686.187,22	
0,6500 % Honeywell International Inc. Notes 16/20	EUR	500.000	510.675,00	
4,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 07/17	EUR	1.000.000	1.014.190,00	
5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 09/19	EUR	700.000	761.348,00	
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 10/18	EUR	200.000	213.099,00	
5,3500 % Intesa Sanpaolo Vita S.p.A. Notes 13/18	EUR	300.000	323.982,00	
0,5000 % Italgas S.P.A. MTN 17/22	EUR	100.000	99.913,50	
4,0000 % Königreich Spanien Bonos 10/20	EUR	800.000	900.168,00	
5,8500 % Königreich Spanien Bonos 11/22	EUR	250.000	316.236,25	
5,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23	EUR	1.700.000	2.164.219,00	
4,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23	EUR	1.200.000	1.470.090,00	
1,4000 % Königreich Spanien Bonos 14/20	EUR	200.000	208.367,00	
1,1500 % Königreich Spanien Bonos 15/20	EUR	873.000	905.741,87	
0,4000 % Königreich Spanien Obligaciones 17/22	EUR	2.235.000	2.225.780,63	
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 16/21	EUR	4.350.000	4.422.906,00	
0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 16/23	EUR	1.000.000	1.028.890,00	
0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 14/19	EUR	1.600.000	1.636.864,00	
0,3750 % Land Nordrhein-Westfalen Landesch. R.1377 15/21	EUR	700.000	718.014,50	
1,0000 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 16/21	EUR	700.000	712.565,00	
0,3720 % Morgan Stanley FLR MTN S.G 16/22	EUR	1.295.000	1.309.128,45	
0,5000 % Nationwide Building Society MTN 16/19	EUR	78.000	79.150,50	
4,3750 % New Areva Holding MT Bonds 09/19	EUR	700.000	714.423,50	
4,5000 % Nordea Bank AB MTN 10/20	EUR	1.200.000	1.360.734,00	
2,5000 % ORLEN Capital AB Notes 14/21	EUR	400.000	421.454,00	
2,8750 % RCI Banque MTN 13/18	EUR	26.000	26.700,05	
1,3000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 09/19	EUR	400.000	461.098,26	
0,2500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 12/18	EUR	3.000.000	3.241.578,69	
0,2500 % Rep. Frankreich OAT 15/20	EUR	4.000.000	4.085.760,00	
3,8750 % Repsol Intl Finance B.V. FLR Securit.15/Und.	EUR	500.000	515.250,00	
2,8750 % Republik Indonesien MTN 14/21 Reg.S	EUR	400.000	429.000,00	
3,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 13/23	EUR	739.928	906.315,61	
0,8000 % Republik Irland Treasury Bonds 15/22	EUR	4.000.000	4.176.200,00	
3,7500 % Republik Italien B.T.P. 06/21	EUR	257.000	290.294,35	
3,8750 % Republik Kroatien Notes 14/22	EUR	700.000	762.125,00	
0,8750 % Republik Polen MTN 15/21	EUR	400.000	411.900,00	

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
3,6250 % Republik Rumänien MTN 14/24	EUR 100.000		112.900,00	
4,7500 % Republik Zypern MTN 14/19	EUR 1.900.000		2.065.300,00	
3,0000 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 16/21	EUR 500.000		521.937,50	
0,8750 % Sanofi S.A. MTN 15/21	EUR 300.000		310.434,00	
0,9000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20	EUR 200.000		203.839,00	
2,2500 % Société Générale S.A. MTN 13/20	EUR 900.000		958.653,00	
0,7500 % SpareBank 1 SMN MTN 16/21	EUR 50.000		51.304,50	
2,1000 % Standard Chartered PLC MTN 16/19 Reg.S	USD 250.000		234.724,58	
0,1500 % Swedbank Hypotek AB MT Mortg.Cov. Bds 16/21	EUR 1.000.000		1.010.725,00	
4,0000 % Telecom Italia S.p.A. MTN 12/20	EUR 100.000		109.545,00	
0,6720 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN S.F 16/21	EUR 750.000		769.582,50	
4,8750 % UniCredit S.p.A. MTN 12/17	EUR 1.272.000		1.272.915,84	
2,0000 % UniCredit S.p.A. MTN 16/23	EUR 150.000		153.352,50	
0,3750 % Unilever N.V. MTN 17/23	EUR 775.000		772.880,38	
4,2500 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. FLR MTN 16/26	EUR 100.000		100.200,00	
0,1250 % Uniper SE MTN 16/18	EUR 500.000		502.502,50	
0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 14/19	USD 200.000		198.450,91	
1,1250 % Volkswagen Bank GmbH MTN 13/18	EUR 200.000		202.411,00	
3,1250 % Vonovia Finance B.V. Anl. 13/19	EUR 200.000		215.393,00	
0,2920 % Wells Fargo & Co. FLR MTN 16/21	EUR 89.000		89.760,06	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		85.123.778,73	85.123.778,73

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.02.2017

Deutschland, Mark	(DEM)	1,95583	= 1 Euro (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85128	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43310	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	8,86620	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	9,57260	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,06571	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,31625	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	27,02500	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	308,17000	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,05840	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,39513	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,48440	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	118,96500	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,37884	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

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

OTC	Over-the-Counter
-----	------------------

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1253955469	2,8750 % ABN AMRO Bank N.V. FLR MTN 15/25	EUR	0	200.000
XS1527526799	1,0000 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. MTN 16/24	EUR	800.000	800.000
XS1174814415	0,7500 % ALD International S.A. MTN 15/18	EUR	0	1.200.000
XS1550134602	0,7500 % American Honda Finance Corp. MTN S.A 17/24	EUR	750.000	750.000
BE6285454482	1,5000 % Anheuser-Busch InBev N.V./S.A. MTN 16/25	EUR	0	380.000
XS0973586059	1,5000 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) MT Mg.Cov.Bds 13/18	EUR	0	850.000
XS1492834806	0,1250 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) MT Mg.Cov.Bds 16/23	EUR	950.000	950.000
FR0013220258	1,2500 % APRR MTN 16/27	EUR	700.000	700.000
XS0452314536	5,1250 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 09/24	EUR	0	200.000
FR0013231099	1,2500 % Autoroutes du Sud de la France MTN 17/27	EUR	300.000	300.000
XS1509003361	0,6250 % Aviva PLC MTN 16/23	EUR	725.000	725.000
XS1117528189	1,7500 % Babcock International Grp PLC MTN 14/22	EUR	0	400.000
XS1428771809	0,2500 % Bank Nederlandse Gemeenten MTN 16/24 Reg.S	EUR	800.000	800.000
XS0286040331	4,6250 % Bank of America Corp. MTN 07/17	EUR	3.200.000	3.200.000
XS1567439689	5,6250 % Banque Centrale de Tunisie Notes 17/24	EUR	775.000	775.000
XS1144490833	0,0000 % Barclays Bank PLC FLR MTN 14/16	EUR	0	500.000
XS1531174388	1,8750 % Barclays PLC MTN 16/23	EUR	950.000	950.000
XS1531345376	1,0000 % Becton, Dickinson & Co. Notes 16/22	EUR	700.000	700.000
XS1548436473	0,7500 % BMW Finance N.V. MTN 17/24	EUR	900.000	900.000
DE000A1HJLN2	1,0000 % BMW US Capital LLC MTN 13/17	EUR	0	300.000
BE0002265347	0,0000 % BNP Paribas Fortis S.A. MT Mortg.Cov.Bds 16/23	EUR	700.000	700.000
XS1547407830	1,1250 % BNP Paribas S.A. MTN 17/23	EUR	425.000	425.000
FR0013222494	1,3750 % Bouygues S.A. Bonds 16/27	EUR	500.000	500.000

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1527126772	1,1170 % BP Capital Markets PLC MTN 16/24	EUR	900.000	900.000
FR0013094836	0,6250 % BPCE S.A. MTN 16/20	EUR	0	700.000
FR0013204476	0,3750 % BPCE S.A. MTN 16/23	EUR	1.000.000	1.000.000
FR0010160440	4,0000 % BPCE S.A. Obl. 05/17	EUR	1.410.000	1.410.000
XS1512677003	1,8750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 16/26	EUR	600.000	600.000
XS1548802914	0,3750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 17/22	EUR	1.400.000	1.400.000
DE0001135457	2,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 11/21	EUR	0	5.000.000
DE0001135499	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 12/22	EUR	0	4.000.000
DE0001102408	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26	EUR	0	300.000
DE0001135069	5,6250 % Bundesrep.Deutschland Anl. 98/28	EUR	0	400.000
DE0001141695	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.169 14/19	EUR	0	4.000.000
DE0001030575	0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 15/46	EUR	600.000	600.000
DE0001030534	0,7500 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Obl. 11/18	EUR	0	4.000.000
FR0013201084	1,2500 % Bureau Veritas SA Notes 16/23	EUR	300.000	300.000
FR0013230703	0,7500 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 17/27	EUR	800.000	800.000
FR0013218138	0,5000 % Cap Gemini S.A. Notes 16/21	EUR	300.000	300.000
IT0005068850	1,0000 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 14/18	EUR	0	1.000.000
XS0843328526	4,0000 % Celesio Finance B.V. Notes 12/16	EUR	0	300.000
XS1553210169	0,1250 % China Development Bank Corp. MTN 17/20	EUR	1.350.000	1.350.000
XS1505890530	1,1250 % Chorus Ltd. MTN 16/23	EUR	300.000	300.000
XS1497312295	0,8750 % CK Hutchison Fin. (16) II Ltd. Notes 16/24	EUR	1.350.000	1.350.000
FR0013213832	1,8750 % CNP Assurances S.A. Obl. 16/22	EUR	300.000	300.000
DE000C807899	0,6380 % Commerzbank AG Nachr. FLR MTN S.551 06/16	EUR	0	800.000
DE000CZ40LW5	4,0000 % Commerzbank AG T2 Nachr. MTN S.874 17/27	EUR	1.075.000	1.075.000
FR0013201126	0,3750 % Compagnie Fin. Ind. Autoroutes MTN 16/25 1	EUR	800.000	800.000
ES0000101644	2,8750 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 14/23	EUR	500.000	500.000
FR0013203734	4,7500 % Crédit Agricole Assurances SA FLR Notes 16/48	EUR	500.000	500.000
FR0013234986	1,3750 % Crédit Agricole Home Loan SFH MT Obl.Fin.Hab.17/32	EUR	700.000	700.000
FR0013215688	0,2500 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF MT Obl.Fonc. 16/26	EUR	400.000	400.000
XS1538284230	1,8750 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) MTN 16/26	EUR	900.000	900.000
XS1550135831	1,0000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) MTN 17/24	EUR	1.200.000	1.200.000
FR0013236544	3,5000 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 17/29	EUR	400.000	400.000
FR0013216900	0,4240 % Danone S.A. MTN 16/22	EUR	800.000	800.000
FR0013216918	0,7090 % Danone S.A. MTN 16/24	EUR	400.000	400.000
XS1485603747	1,6000 % Delphi Automotive PLC Notes 16/28	EUR	150.000	150.000
XS1493724584	0,6250 % Deutsche Bahn Finance B.V. MTN 16/28	EUR	800.000	800.000
DE000DB7XJP9	1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 15/25	EUR	500.000	500.000
DE000GRN0008	0,6250 % Deutsche Kreditbank AG IHS 16/21	EUR	0	600.000
XS1557095616	1,3750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/27	EUR	525.000	525.000
XS1268552061	0,2000 % Dexia Crédit Local S.A. MTN 15/18	EUR	0	2.000.000
DE000DXA1NX9	0,0500 % Dexia Kommunalbank D.AG MTN Öff.-Pfe. S.1638 16/21	EUR	0	1.500.000
XS0822316765	2,5000 % DVB Bank SE MTN IHS 12/17	EUR	0	400.000
XS1433231377	1,2500 % DVB Bank SE MTN IHS 16/23	EUR	0	600.000
XS1405783983	1,5000 % Eastman Chemical Co. Notes 16/23	EUR	1.150.000	1.150.000
XS1529859321	1,0000 % Ecolab Inc. Notes 16/24	EUR	450.000	450.000
FR0013213295	1,0000 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 16/26	EUR	800.000	800.000
XS1493322355	0,6250 % ENI S.p.A. MTN 16/24	EUR	1.000.000	1.000.000
EU000A1G0DJ1	1,3750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 16/47	EUR	475.000	475.000
DE000A185QB3	0,7500 % Evonik Finance B.V. MTN 16/28	EUR	475.000	475.000
XS1317725726	1,5280 % FCE Bank PLC MTN 15/20	EUR	0	200.000
BE0001764183	0,3750 % Flämische Gemeinschaft MTN 16/26	EUR	1.100.000	1.100.000
XS1554373248	1,5000 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/24 2	EUR	375.000	375.000
XS1554373677	2,1250 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/27 3	EUR	700.000	700.000
XS1515216650	1,5000 % G4S International Finance PLC MTN 16/23 4	EUR	275.000	275.000
PTGGDAOE0001	1,3750 % Galp Gás Natural Distrib. S.A. MTN 16/23	EUR	700.000	700.000
XS0587411595	5,6250 % Gas Natural CM S.A. MTN 11/17	EUR	1.400.000	1.400.000
FR0013205069	1,0000 % Gecina S.A. MTN 16/29	EUR	600.000	600.000
XS1506615282	1,6250 % GELF Bond Issuer I S.A. MTN 16/26	EUR	475.000	475.000
XS1489184900	1,8750 % Glencore Finance Europe S.A. MTN 16/23	EUR	775.000	775.000
XS1529515584	1,5000 % HeidelbergCement AG MTN 16/25	EUR	325.000	325.000
DE000A0TKUJ3	5,6250 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 07/18	EUR	0	700.000
XS1420337633	1,3750 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. MTN 16/23	EUR	0	300.000
XS1366026323	0,1710 % Honeywell International Inc. FLR Notes 16/18	EUR	0	400.000
XS1485597329	0,8750 % HSBC Holdings PLC MTN 16/24	EUR	1.050.000	1.050.000
XS1490726590	0,3750 % Iberdrola International B.V. MTN 16/25	EUR	900.000	900.000
FR0013218393	1,1250 % Icade S.A. Obl. 16/25	EUR	600.000	600.000
XS1490152565	2,7500 % IHO Verwaltungs GmbH Anl. 16/21 Reg.S	EUR	700.000	700.000
XS1275474085	0,3810 % ING Bank N.V. FLR MTN 15/17	EUR	0	500.000
XS0731153291	4,2500 % ING Bank N.V. MTN 12/17	EUR	0	1.000.000
XS1548475968	7,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Notes 17/Und.	EUR	300.000	300.000
XS0750763806	5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 12/17	EUR	1.500.000	2.500.000
XS1551294256	1,5000 % Israel MTN 17/27	EUR	1.275.000	1.275.000
BE0002266352	0,7500 % KBC Groep N.V. MTN 16/23	EUR	800.000	800.000
XS0896119384	3,2500 % Klépierre S.A. MTN 13/21	EUR	0	400.000
XS1485532896	0,6250 % Kon. KPN N.V. MTN 16/25	EUR	800.000	800.000
BE0000332412	2,6000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.72 14/24	EUR	1.000.000	1.000.000
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25	EUR	1.300.000	2.100.000
BE0000337460	1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.77 16/26	EUR	1.000.000	1.000.000
BE0000341504	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.81 17/27	EUR	1.500.000	1.500.000
NL0000102275	3,7500 % Königreich Niederlande Anl. 06/23	EUR	0	2.000.000

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
ES00000123B9	5,5000 % Königreich Spanien Bonos 11/21	EUR	0	1.500.000
ES00000123C7	5,9000 % Königreich Spanien Bonos 11/26	EUR	2.400.000	2.400.000
ES00000126B2	2,7500 % Königreich Spanien Bonos 14/24	EUR	600.000	600.000
ES00000127C8	1,0000 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 14/30	EUR	1.000.000	1.000.000
ES0000012932	4,2000 % Königreich Spanien Obligaciones 05/37	EUR	300.000	300.000
ES00000127A2	1,9500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/30	EUR	1.100.000	1.100.000
ES00000128H5	1,3000 % Königreich Spanien Obligaciones 16/26	EUR	0	100.000
DE000A1K0UG6	2,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 12/22	EUR	0	1.300.000
DE000A11QEK9	0,5000 % Land Berlin Landessch. Ausg.436 14/18	EUR	0	1.000.000
DE0001590552	2,5000 % Land Niedersachsen Landessch. Ausg.213 11/18	EUR	0	1.000.000
XS1405763019	4,5000 % LANXESS AG FLR Sub. Anl. 16/76	EUR	650.000	650.000
XS1002933668	0,7500 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H252 13/17	EUR	0	2.000.000
DE000LB1B2E5	2,8750 % Ldsbk Baden-Württemb. Nachr. MTN Schuldv. 16/26	EUR	700.000	700.000
XS1554456613	1,2500 % LEG Immobilien AG Anl. 17/24	EUR	600.000	600.000
XS1263854801	0,5000 % Lloyds Bank PLC MT Mortg.Cov. Bds 15/20	EUR	0	600.000
XS1567174286	1,5000 % McKesson Corp. Notes 17/25	EUR	575.000	575.000
XS1512827095	1,8750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. MTN 16/26	EUR	1.100.000	1.100.000
XS1003251011	1,1250 % Mondelez International Inc. Notes 13/17	EUR	0	500.000
XS0832446230	3,7500 % Morgan Stanley MTN 12/17	EUR	0	225.000
XS1511787589	1,3750 % Morgan Stanley MTN S.G 16/26	EUR	500.000	500.000
XS1496749349	2,2500 % NIBC Bank N.V. MTN T.2 16/19	EUR	625.000	625.000
XS1551677260	2,7500 % NTPC Ltd. MTN 17/27	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1294342792	5,2500 % OMV AG FLR Notes 15/Und.	EUR	0	400.000
XS0746259323	4,0000 % PGNiG Finance AB MTN 12/17	EUR	500.000	500.000
XS1495631993	0,3750 % Raiffeisenlandesbk.Oberösterreich. MTN 100 16/26	EUR	400.000	400.000
XS1075471265	0,4040 % RCI Banque FLR MTN 14/17	EUR	0	700.000
FR0012759744	1,2500 % RCI Banque MTN 15/22	EUR	0	200.000
FR0013230737	0,7500 % RCI Banque MTN 17/22	EUR	500.000	500.000
FR0010050559	2,2500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 04/20	EUR	0	700.000
FR0011347046	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 12/21	EUR	2.400.000	2.400.000
FR0011337880	2,2500 % Rep. Frankreich OAT 11/22	EUR	0	1.000.000
FR0012557957	0,0000 % Rep. Frankreich OAT 15/20	EUR	0	2.000.000
XS0287409212	4,7500 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 07/17	EUR	2.200.000	2.200.000
FI4000219787	0,0000 % Republik Finnland Bonds 16/23	EUR	2.150.000	2.150.000
FI4000242870	1,3750 % Republik Finnland Bonds 17/47	EUR	1.200.000	1.200.000
IE0034074488	4,5000 % Republik Irland Treasury Bonds 04/20	EUR	0	2.000.000
IE00B4TV0D44	5,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 09/25	EUR	1.500.000	3.000.000
IE00B60Z6194	5,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 10/20	EUR	0	1.500.000
IE00BV8C9418	1,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 16/26	EUR	1.300.000	1.550.000
IE00BV8C9B83	1,7000 % Republik Irland Treasury Bonds 17/37	EUR	1.775.000	1.775.000
IT0004423957	4,5000 % Republik Italien B.T.P. 08/19	EUR	0	2.000.000
IT0004695075	4,7500 % Republik Italien B.T.P. 11/21	EUR	0	500.000
IT0004957574	3,5000 % Republik Italien B.T.P. 13/18	EUR	0	1.000.000
IT0005045270	2,5000 % Republik Italien B.T.P. 14/24	EUR	350.000	350.000
IT0005139099	0,3000 % Republik Italien B.T.P. 15/18	EUR	0	2.000.000
IT0005135840	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 15/22	EUR	0	800.000
IT0005172322	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 16/23	EUR	900.000	1.400.000
IT0005170839	1,6000 % Republik Italien B.T.P. 16/26	EUR	250.000	250.000
IT0005162828	2,7000 % Republik Italien B.T.P. 16/47	EUR	280.000	280.000
IT0005240350	2,4500 % Republik Italien B.T.P. 17/33	EUR	850.000	850.000
IT0005056541	0,5820 % Republik Italien FLR C.C.T.eu 14/20	EUR	0	1.200.000
IT0005188120	0,1000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 16/22	EUR	0	3.000.000
IT0005217770	0,3500 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 16/24	EUR	900.000	900.000
XS1310032260	2,1250 % Republik Litauen MTN 15/35	EUR	1.200.000	1.200.000
AT0000A1PEF7	1,5000 % Republik Österreich Bundesobl. 16/86	EUR	150.000	150.000
XS1015428821	3,0000 % Republik Polen MTN 14/24	EUR	500.000	500.000
PTOTEYOEO007	3,8500 % Republik Portugal Obl. 05/21	EUR	2.600.000	2.900.000
PTOTENOE0018	4,4500 % Republik Portugal Obr. 08/18	EUR	0	3.500.000
PTOTEAEOE0021	4,9500 % Republik Portugal Obr. 08/23	EUR	1.100.000	1.100.000
PTOTECEO0029	4,8000 % Republik Portugal Obr. 10/20	EUR	4.200.000	4.800.000
SI0002103487	1,5000 % Republik Slowenien Bonds 15/35	EUR	1.550.000	1.550.000
SI0002103677	1,7500 % Republik Slowenien Bonds 16/40	EUR	750.000	750.000
XS1457553367	3,7500 % Republik Zypern MTN 16/23	EUR	0	1.000.000
XS0651159484	1,3190 % Santander Consumer Finance SA FLR MTN 11/16	EUR	0	50.000
FR0013201308	0,2500 % Schneider Electric SE MTN 16/24	EUR	1.200.000	1.200.000
FR0013213675	0,1250 % SFIL S.A. MTN 16/24	EUR	900.000	900.000
XS1476654238	0,3750 % Shell International Finance BV MTN 16/25	EUR	0	1.000.000
XS0413806596	5,1250 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 09/17	EUR	200.000	200.000
XS0914292254	2,3750 % Snam S.p.A. MTN 13/17	EUR	0	850.000
FR0013213683	0,9500 % Soc.Autorout.Nord-I'Est France Obl. 16/28	EUR	600.000	600.000
XS1538867760	1,0000 % Société Générale S.A. MTN 16/22	EUR	1.100.000	1.100.000
XS1505132602	0,7500 % Sodexo S.A. Notes 16/27	EUR	325.000	325.000
BE6282455565	0,5060 % Solvay S.A. FLR Notes 15/17	EUR	0	300.000
XS1434560642	1,0000 % Southern Power Co. Notes S.2016A 16/22	EUR	0	500.000
XS1482554075	0,2500 % SpareBank 1 Boligkreditt AS MT Mortg.Cov.Bds 16/26	EUR	0	1.500.000
XS1297977115	0,5000 % SR-Boligkreditt A.S. Mortg. Covered MTN 15/20	EUR	0	1.000.000
XS1524573752	1,2500 % Südzucker Intl Finance B.V. Notes 16/23	EUR	975.000	975.000
XS0490111563	3,7500 % Svenska Handelsbanken AB MTN 10/17	EUR	100.000	100.000
XS0740788699	3,3750 % Swedbank AB MTN 12/17	EUR	500.000	500.000
XS1493333717	0,8750 % Swedish Match AB MTN 16/24	EUR	475.000	475.000

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1497606365	3,0000 % Telecom Italia S.p.A. MTN 16/25	EUR	450.000	450.000
XS1551678409	2,5000 % Telecom Italia S.p.A. MTN 17/23	EUR	825.000	825.000
XS0585904443	4,7500 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 11/17	EUR	2.200.000	2.200.000
XS1550951211	1,5280 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 17/25	EUR	1.100.000	1.100.000
XS1405762805	1,5000 % Telekom Finanzmanagement GmbH Notes 16/26	EUR	800.000	800.000
XS0747771128	4,1250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA MTN 12/17	EUR	30.000	30.000
XS1405775708	0,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 16/24	EUR	1.050.000	1.050.000
XS1501167164	2,7080 % Total S.A. FLR MTN 16/Und.	EUR	1.500.000	1.500.000
XS0977502110	2,5000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd MTN 13/20	EUR	0	600.000
CH0336602930	1,2500 % UBS Group Funding (Jersey) Ltd MTN 16/26	EUR	0	500.000
XS1426039696	4,3750 % UniCredit S.p.A. FLR MTN 16/27	EUR	0	100.000
IT0005212987	0,3750 % UniCredit S.p.A. Mortg.Cov. MTN 16/26	EUR	0	700.000
XS1004918774	2,2500 % UniCredit S.p.A. MTN 13/16	EUR	0	1.100.000
XS1014627571	3,2500 % UniCredit S.p.A. MTN 14/21	EUR	600.000	600.000
XS1508450688	2,1250 % UniCredit S.p.A. MTN 16/26	EUR	750.000	750.000
XS1492446460	0,6250 % V.F. Corp. Notes 16/23	EUR	875.000	875.000
FR0013230943	0,6250 % Valéo S.A. MTN 17/23	EUR	400.000	400.000
XS1405767275	0,5000 % Verizon Communications Inc. Notes 16/22	EUR	875.000	875.000
XS1405766624	1,3750 % Verizon Communications Inc. Notes 16/28	EUR	550.000	550.000
FR0011164888	4,1250 % VINCI S.A. MTN 11/17	EUR	1.400.000	1.400.000
FR0013220399	1,1250 % Vivendi S.A. Bonds 16/23	EUR	500.000	500.000
XS1532765879	1,4140 % Zimmer Biomet Holdings Inc. Notes 16/22	EUR	450.000	450.000
GBP				
XS1475051162	1,1770 % BP Capital Markets PLC MTN 16/23	GBP	0	400.000
GB008BDR7T29	0,1250 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 13/19	GBP	0	1.200.000
XS1488419935	0,8750 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 16/22	GBP	300.000	300.000
XS1492680811	1,1250 % Natl Grid Gas Finance PLC MTN 16/21 1	GBP	300.000	300.000
USD				
XS1558077845	6,1250 % Arabische Republik Ägypten MTN 17/22 Reg.S	USD	325.000	325.000
US071813BR97	1,7000 % Baxter International Inc. Notes 16/21	USD	0	300.000
US29082HAB87	5,4000 % Embraer Netherlands Fin. B.V. Notes 17/27	USD	375.000	375.000
US65339KAJ97	1,6490 % Nextera Energy Capital Ho.Inc. FLR Debts S.G 13/18	USD	0	200.000
US68389XBK00	1,9000 % Oracle Corp. Notes 16/21	USD	0	275.000
US71647NAR08	6,1250 % Petrobras Global Finance B.V. Notes 17/22	USD	300.000	300.000
XS0863522149	2,7500 % Republik Lettland Notes 12/20 Reg.S	USD	0	1.000.000
USG8200TAF78	1,7500 % Sinopec Grp Over.Dev.2016 Ltd. Notes 16/19 Reg.S	USD	1.400.000	1.400.000
US191216BY55	1,5500 % The Coca-Cola Co. Notes 16/21	USD	0	1.150.000
US445545AK21	4,0000 % Ungarn Notes 14/19	USD	800.000	800.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1523975859	1,5000 % Akelius Residential Property Notes 16/22	EUR	775.000	775.000
XS1528093799	1,7500 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN 16/27	EUR	575.000	575.000
ES0312298104	4,0000 % AYT Cedula Ca.Gl.-FTA-S.XI AB Notes 06/16	EUR	0	600.000
ES0413860505	0,6250 % Banco de Sabadell S.A. Cédulas Hipotec. 15/20	EUR	0	100.000
XS1059619012	2,0000 % Bank of Ireland (The Gov.&Co.) MTN 14/17	EUR	0	1.400.000
XS1405777316	1,8500 % Bunge Finance Europe B.V. Notes 16/23	EUR	350.000	350.000
FR0013195567	0,3750 % Cais. Ctr. du Crd. Imm. France MTN Tr.2 16/20	EUR	0	1.800.000
ES0440609339	1,2500 % Caixabank S.A. Cédulas Hipotec. 17/27	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1565131213	3,5000 % Caixabank S.A. FLR MTN 17/27	EUR	800.000	800.000
XS1110862148	3,2500 % Celanese US Holdings LLC Notes 14/19	EUR	600.000	600.000
XS1492691008	1,1250 % Celanese US Holdings LLC Notes 16/23	EUR	525.000	525.000
XS1468525057	2,3750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 16/24	EUR	0	200.000
XS1551726810	2,8750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 17/25	EUR	300.000	300.000
XS1485608118	1,2500 % Citycon Treasury B.V. Notes 16/26	EUR	825.000	825.000
ES0000101768	0,9970 % Comunidad Autónoma de Madrid Bonos 16/24	EUR	400.000	400.000
ES0000101396	4,6880 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 10/20	EUR	0	600.000
XS1505896735	1,3750 % CRH Finance DAC MTN 16/28	EUR	900.000	900.000
XS0751166835	3,8750 % Danske Bank AS MTN 12/17	EUR	500.000	500.000
XS1492685885	0,7500 % Eaton Capital Unlimited Co. Notes 16/24 Reg.S	EUR	775.000	775.000
XS1385395121	2,3750 % EDP Finance B.V. MTN 16/23	EUR	400.000	400.000
XS1471646965	1,1250 % EDP Finance B.V. MTN 16/24	EUR	0	200.000
XS1435295925	1,2500 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 16/21	EUR	0	600.000
ES0378641155	3,8750 % Fdo de Tit.D.Def.Sist.Elec.FTA MTBonos S.16 13/18	EUR	0	500.000
XS1529684695	1,3750 % Gas Networks Ireland MTN 16/26	EUR	900.000	900.000
XS1413583839	1,1680 % General Motors Fin. Intl. B.V. MTN 16/20	EUR	0	525.000
XS1485748393	0,9550 % General Motors Financial Co. MTN 16/23	EUR	400.000	400.000
XS1488494987	1,0000 % Hemsø Fastighets AB MTN 16/26	EUR	550.000	550.000
ES0444251047	0,2500 % Ibercaja Banco S.A.U. Cédulas Hipotec. 16/23	EUR	900.000	900.000
XS1509942923	1,4500 % Inmobiliaria Colonial S.A. MTN 16/24	EUR	1.100.000	1.100.000
XS1511781467	0,8750 % Iren S.p.A. MTN 16/24	EUR	1.700.000	1.700.000
XS1086104681	3,0000 % Iren S.p.A. Notes 14/21	EUR	0	200.000
DE000A1Z6C06	2,1250 % JAB Holdings B.V. Notes 15/22	EUR	0	400.000
DE000A181034	1,7500 % JAB Holdings B.V. Notes 16/23	EUR	0	200.000
XS1551347393	2,2000 % Jaguar Land Rover Automotive Notes 17/24 Reg.S	EUR	550.000	550.000
XS1511779305	1,3750 % Mexiko MTN 16/25	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1564337993	1,8750 % Mölnlycke Holding AB Notes 17/25	EUR	550.000	550.000
XS1492457236	1,2500 % Mylan N.V. Notes 16/20	EUR	1.075.000	1.075.000
AT0000A1LHT0	1,6250 % Novomatic AG MT Schuldv. S.1 16/23	EUR	675.000	675.000

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1571341830	1,1250 % Parker-Hannifin Corp. Notes 17/25 Reg.S	EUR	550.000	550.000
XS1489391109	1,2500 % PartnerRe Ireland Finance DAC Notes 16/23	EUR	600.000	600.000
XS1452578591	5,6250 % Republik Mazedonien Bonds 16/23 Reg.S	EUR	0	400.000
XS1565699763	1,1250 % Ryanair DAC MTN 17/23	EUR	650.000	650.000
XS1548444816	3,1250 % Santander Issuances S.A.U. MTN 17/27	EUR	800.000	800.000
XS1508586150	1,2500 % SELP Finance S.a.r.l. Notes 16/23	EUR	550.000	550.000
XS1555147369	2,3750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. Notes 17/24 Reg.S	EUR	500.000	500.000
XS1418835002	1,5000 % Transmission Finance DAC MTN 16/23	EUR	0	100.000
XS1418774706	2,1250 % Trinity Acquisition PLC Notes 16/22	EUR	0	500.000
XS1504103984	2,1250 % TUI AG Anl. 16/21 Reg.S	EUR	700.000	700.000
XS1403416222	2,3750 % Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O MT Cov. Bds 16/21	EUR	0	400.000
XS1514149159	1,2500 % Whirlpool Fin. Luxembourg Sarl Notes 16/26	EUR	600.000	600.000
GBP				
XS1497682036	1,6250 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 16/21	GBP	1.050.000	1.050.000
USD				
XS1506066676	6,5000 % DNB Bank ASA FLR Notes 16/Und.	USD	475.000	475.000
US71656MBN83	4,6065 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) FLR MTN 16/22 Reg.S	USD	150.000	150.000
US71656MBL28	4,6250 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 16/23 Reg.S	USD	900.000	900.000
US912828K338	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 15/20	USD	4.000.000	4.000.000
Neuemissionen				
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen				
USD				
XS1567423501	3,2500 % Proven Glory Capital Ltd. MTN 17/22	USD	375.000	375.000
Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen				
EUR				
XS1507458377	1,7500 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN Tr.2 16/26	EUR	900.000	900.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1483607237	0,2500 % Bank Nederlandse Gemeenten MTN Tr.2 16/24 Reg.S	EUR	0	800.000
XS0749822556	3,0000 % BNP Paribas S.A. MTN 12/17	EUR	2.200.000	2.200.000
FR0010850719	4,3790 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. Obl. 10/17	EUR	3.350.000	3.350.000
XS0303074883	0,3690 % Citigroup Inc. FLR MTN 07/17	EUR	0	200.000
XS0463967074	3,0000 % Coöperatieve Rabobank U.A. FLR MTN 09/16	EUR	0	603.000
FR0010163444	3,9000 % Crédit Agricole S.A. Obl. 05/17	EUR	2.052.000	2.052.000
DE000DB9ZH23	0,1610 % Deutsche Bank AG, London Br. Marktzens-Anl. 11/16	EUR	0	151.900
FR0010859686	4,2500 % Legrand S.A. Obl. 10/17	EUR	500.000	500.000
XS0489825223	3,7500 % Nordea Bank AB MTN 10/17	EUR	100.000	100.000
XS0286705321	4,7500 % Orange S.A. MTN 07/17	EUR	1.300.000	1.300.000
XS0909787300	1,0000 % Volkswagen Intl Finance N.V. MTN 13/16	EUR	0	1.000.000
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
LU1440686027	Deka-Institutionell LiquiditätsPlan CF (A)	ANT	2.000	2.000
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
IE00B66F4759	iShs EO H.Yield Corp Bd U.ETF Reg.Shares	ANT	0	4.000
Geldmarktfonds				
Gruppeneigene Geldmarktfonds				
LU0249486092	Deka-LiquiditätsPlan CF	ANT	9.800	9.800
Geldmarktpapiere				
EUR				
XS1366739552	0,4710 % United Technologies Corp. FLR Notes 16/18	EUR	0	300.000
Gattungsbezeichnung		Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Terminkontrakte				
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:		EUR	65.426	
(Basiswert(e): 10 Year Euro Spanish Bonos (10,0), 10 Year US Treasury Notes (10,0), 30 Year US Treasury Bonds (30,0), Euro Bund (10,0), Euro Schatz (2,0), Long Gilt (10,0))				
Verkaufte Kontrakte:		EUR	308.426	
(Basiswert(e): 10 Year Euro Spanish Bonos (10,0), 10 Year US Treasury Notes (10,0), 30 Year US Treasury Bonds (30,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Euro Buxl Futures (30,0), Euro Schatz (2,0), EuroBTP Italian Gov. (10,0), EuroBTP Italian Gov. (3,0), EuroOAT French Gov. Bond (10,0), Long Gilt (10,0))				
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Swaps (Swaptions)				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):		EUR	27	
(Basiswert(e): SWP Long Pay ITraxxECrS26 BNP_LDN 21.12.2016)				

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	22.910
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS))		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
GBP/EUR	EUR	6.612
NOK/EUR	EUR	1.099
PLN/EUR	EUR	2.302
USD/EUR	EUR	23.287
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
GBP/EUR	EUR	5.273
NOK/EUR	EUR	1.669
PLN/EUR	EUR	1.803
SEK/EUR	EUR	1.642
USD/EUR	EUR	1.864
Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)		
Inflation Swaps (IFS)		
Protection Seller:	EUR	7.000
(Basiswert(e): IFS Euro HICP Ex-Tobacco EUR / 1,04% EUR)		
Credit Default Swaps (CDS)		
Protection Buyer:	EUR	8.000
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S25 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S26 V1 5Y)		
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	335.283
(Basiswert(e): 0,0000 % Allianz Finance II B.V. MTN 16/20, 0,0000 % BASF Finance Europe N.V. MTN 16/20, 0,0000 % BPCE S.A. FLR MTN 15/17, 0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/22, 0,0000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) MTN 16/22, 0,0000 % General Electric Co. FLR Notes 15/20, 0,0000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 16/18, 0,0000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 16/21, 0,0000 % Rep. Frankreich OAT 15/20, 0,0000 % Snam S.p.A. MTN 16/20, 0,0100 % Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.212 17/22, 0,0400 % Dexia Crédit Local S.A. MTN 16/19, 0,0500 % Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. 16/20, 0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 12/21, 0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 16/21, 0,1250 % ANZ New Zealand (Itd)(Ldn Br.) MT Mg.Cov.Bds 16/23, 0,1250 % Banco de Sabadell S.A. Cédulas Hipotec. 16/23, 0,1250 % BMW Finance N.V. MTN 16/20, 0,1250 % BNZ Inter. Fund. Ltd.(Ldn Br.) MT Mtg.Cov.Bd 16/21, 0,1250 % The Bank of Nova Scotia MT Mortg.Cov. Bds 17/22, 0,1500 % Swedbank Hypotek AB MT Mortg.Cov. Bds 16/21, 0,2230 % Deutsche Bank AG FLR MTN 14/19, 0,2500 % Berkshire Hathaway Inc. Notes 17/21, 0,2500 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF MT Obl.Fonc. 16/26, 0,2500 % Daimler AG MTN 16/20, 0,2500 % Land Berlin Landessch. Ausg.470 15/20, 0,2500 % Schneider Electric SE MTN 16/24, 0,2500 % SpareBank 1 Boligkredit AS MT Mortg.Cov.Bds 16/26, 0,2500 % The Swedish Covered Bond Corp. MTN 16/21, 0,2920 % Wells Fargo & Co. FLR MTN 16/21, 0,3180 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 16/20, 0,3720 % Morgan Stanley FLR MTN S.G 16/22, 0,3750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 17/22, 0,3750 % Deutsche Post AG MTN 16/21, 0,3750 % Iberdrola International B.V. MTN 16/25, 0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 14/19, 0,3750 % Sparebank 1 SR Bank ASA MTN 16/22, 0,3750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 16/20, 0,3810 % ING Bank N.V. FLR MTN 15/17, 0,4240 % Danone S.A. MTN 16/22, 0,4710 % United Technologies Corp. FLR Notes 16/18, 0,5000 % Bank of Irel.Mortgage Bank PLC MTN 15/20, 0,5000 % Berlin Hyp AG IHS S.112 16/23, 0,5000 % BMW Finance N.V. MTN 14/18, 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.169 14/19, 0,5000 % Cap Gemini S.A. Notes 16/21, 0,5000 % Citigroup Inc. FLR MTN 16/21, 0,5000 % Commerzbank AG MTN Anl. S.843 15/18, 0,5000 % Commerzbank AG MTN Anl. S.871 16/23, 0,5000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 15/18, 0,5000 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 17/21, 0,5000 % Intl Business Machines Corp. Notes 16/21, 0,5000 % Italgas S.P.A. MTN 17/22, 0,5000 % Knorr-Bremse AG MTN 16/21, 0,5000 % Nationwide Building Society MTN 16/19, 0,5000 % SR-Boligkredit A.S. Mortg. Covered MTN 15/20, 0,5000 % Verizon Communications Inc. Notes 16/22, 0,6250 % ABN AMRO Bank N.V. MTN 16/22, 0,6250 % AIB Mortgage Bank MT Cov.Secs 15/20, 0,6250 % Aviva PLC MTN 16/23, 0,6250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 17/22, 0,6250 % Bankinter S.A. Cédulas Hipotec. 15/20, 0,6250 % BPCE S.A. MTN 16/20, 0,6250 % Commerzbank AG MTN IHS S.854 15/19, 0,6250 % Deutsche Kreditbank AG IHS 16/21, 0,6250 % ENI S.p.A. MTN 16/24, 0,6250 % Valéo S.A. MTN 17/23, 0,6720 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN S.F 16/21, 0,7000 % ING Bank N.V. MTN 15/20, 0,7090 % Danone S.A. MTN 16/24, 0,7500 % Citigroup Inc. MTN 16/23, 0,7500 % Danske Bank AS MTN 16/23, 0,7500 % KBC Groep N.V. MTN 16/23, 0,7500 % Königreich Spanien Bonos 16/21, 0,7500 % Vivendi S.A. Bonds 16/21, 0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25, 0,8000 % Republik Irland Treasury Bonds 15/22, 0,8500 % General Motors Fin. Intl. B.V. MTN 15/18, 0,8750 % AIB Mortgage Bank Mortg. Cov. MTN 16/23, 0,8750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35270 17/21, 0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/24, 0,8750 % Republik Polen MTN 15/21, 1,0000 % BMW US Capital LLC MTN 13/17, 1,0000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) MTN 17/24, 1,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 16/23, 1,0000 % DVB Bank SE MTN IHS 17/22, 1,0000 % Kreissparkasse Köln Hyp.-Pfe. Em.1072 13/18, 1,0000 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 16/21, 1,0000 % Norddte Ldsbk -GZ- MTN IHS 16/21, 1,0000 % Nordea Bank AB FLR MTN 16/26, 1,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 16/26, 1,0000 % Société Générale S.A. MTN 16/22, 1,0000 % Volkswagen Intl Finance N.V. MTN 13/16, 1,1250 % BNP Paribas S.A. MTN 17/23, 1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 15/25, 1,1250 % Deutsche Lufthansa AG MTN 14/19, 1,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35254 16/20, 1,1250 % Eutelsat S.A. Bonds 16/21, 1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 15/20, 1,1250 % RCI Banque MTN 14/19, 1,1250 % Vivendi S.A. Bonds 16/23, 1,1680 % General Motors Fin. Intl. B.V. MTN 16/20, 1,2500 % ACCOR S.A. Bonds 17/24, 1,2500 % Bureau Veritas SA Notes 16/23, 1,2500 % Deutsche Bank AG MTN 14/21, 1,2500 % DVB Bank SE MTN IHS 16/23, 1,2500 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 15/18, 1,2500 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 16/20, 1,2500 % LEG Immobilien AG Anl. 17/24, 1,2500 % Mylan N.V. Notes 16/20, 1,2500 % RCI Banque MTN 15/22, 1,2500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. Notes 15/23, 1,2500 % Whirlpool Fin. Luxembourg Sarl Notes 16/26, 1,3750 % Allied Irish Banks PLC MTN 15/20, 1,3750 % CRH Finance DAC MTN 16/28, 1,3750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/27, 1,3750 % Mexiko MTN 16/25, 1,3750 % PZU Finance AB Notes 14/19, 1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken FLR MTN 16/28, 1,3750 % Verizon		

Gattungsbezeichnung

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

Volumen in 1.000

Communications Inc. Notes 16/28, 1,3980 % mFinance France S.A. MTN 16/20, 1,4000 % Königreich Spanien Bonos 14/20, 1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 12/22, 1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23, 1,5000 % Deutsche Bank AG MTN 17/22, 1,5000 % Eastman Chemical Co. Notes 16/23, 1,5000 % Israel MTN 17/27, 1,5000 % Scentre Management Ltd. MTN 14/20, 1,5280 % FCE Bank PLC MTN 15/20, 1,5280 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 17/25, 1,6250 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 15/22, 1,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 16/21, 1,6250 % Novomatic AG MT Schuldv. S.1 16/23, 1,7000 % Republik Irland Treasury Bonds 17/37, 1,7500 % Autostrade per L'Italia S.p.A. MTN 16/27, 1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 12/22, 1,7500 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 09/20, 1,7500 % Linde AG MTN 12/20, 1,7500 % Sinopec Grp Over.Dev.2016 Ltd. Notes 16/19 Reg.S, 1,8750 % Barclays PLC MTN 16/21, 1,8750 % Barclays PLC MTN 16/23, 1,8750 % General Motors Fin. Intl. B.V. MTN 14/19, 1,8750 % Glencore Finance Europe S.A. MTN 16/23, 1,8750 % O2 Telefónica Dtltd. Finanzier. Anl. 13/18, 1,8750 % UniCredit S.p.A. Mortg.Cov. MTN 13/19, 2,0000 % Achmea Bank N.V. MTN 13/18, 2,0000 % BPE Financiaciones S.A. MTN 15/20, 2,0000 % UniCredit S.p.A. MTN 16/23, 2,1000 % Standard Chartered PLC MTN 16/19 Reg.S, 2,1250 % Republik Litauen MTN 15/35, 2,1250 % Trinity Acquisition PLC Notes 16/22, 2,1250 % UniCredit S.p.A. MTN 16/26, 2,2500 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 14/19, 2,2500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 14/19, 2,2500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 04/20, 2,2500 % Rep. Frankreich OAT 11/22, 2,3750 % Bilfinger SE IHS 12/19, 2,3750 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 14/19, 2,3750 % EDP Finance B.V. MTN 16/23, 2,3750 % Metrovacesa S.A. MTN 16/22, 2,3750 % mFinance France S.A. MTN 14/19, 2,3750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. Notes 17/24 Reg.S, 2,3750 % Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O MT Cov. Bds 16/21, 2,5000 % DVB Bank SE MTN IHS 12/17, 2,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 12/22, 2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 13/20, 2,7080 % Total S.A. FLR MTN 16/Und., 2,7500 % Allied Irish Banks PLC MTN 14/19, 2,7500 % Anglo American Capital PLC MTN 12/19, 2,7500 % Hammerson PLC Bonds 12/19, 2,7500 % Iren S.p.A. MTN 15/22, 2,7500 % Königreich Spanien Bonos 14/19, 2,7500 % Königreich Spanien Bonos 14/24, 2,8500 % Deutsche Bank AG Senior Notes 16/19, 2,8750 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 14/20, 2,8750 % Comunidad Autónoma de Madrid Bonos 14/19, 2,8750 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 14/18, 2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA Notes 13/20 Reg.S, 2,8750 % Ldsbk Baden-Württemb. Nachr. MTN Schuldv. 16/26, 2,8750 % Poste Vita S.p.A. Notes 14/19, 2,8750 % Republik Indonesien MTN 14/21 Reg.S, 2,8750 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. MTN 14/19, 3,0000 % Continental AG MTN 13/18, 3,0000 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 16/21, 3,0000 % Telecom Italia S.p.A. MTN 16/25, 3,1250 % Caixabank S.A. Bonos 13/18, 3,1250 % Cellnex Telecom S.A. MTN 15/22, 3,1250 % Vonovia Finance B.V. Anl. 13/19, 3,2500 % Bank of Ireland (The Gov.&Co.) MTN 14/19, 3,2500 % UniCredit S.p.A. MTN 14/21, 3,2500 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 11/18, 3,3750 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 13/24, 3,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 14/24, 3,5000 % BANKIA S.A. Bonos 14/19, 3,5000 % BBVA Sub.Capital S.A.U. FLR MTN 14/24, 3,7500 % Königreich Niederlande Anl. 06/23, 3,7500 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 17/24, 3,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 16/Und., 3,8500 % Republik Portugal Obl. 05/21, 3,8750 % Allianz SE Subord. MTN 16/Und., 3,8750 % Repsol Intl Finance B.V. FLR Securit.15/Und., 3,8750 % Republik Zypern MTN 15/22, 3,8750 % Tschechien MTN 12/22, 3,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 13/23, 3,9940 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. MTN 12/20, 4,0000 % AYT Cedula Ca.Gl.-FTA-S.XI AB Notes 06/16, 4,0000 % Commerzbank AG T2 Nachr. MTN S.874 17/27, 4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 10/18, 4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 12/17, 4,0000 % Telecom Italia S.p.A. MTN 12/20, 4,0000 % Ungarn Notes 14/19, 4,1250 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 14/26, 4,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 12/22, 4,1250 % K+S Aktiengesellschaft Anl. 13/21, 4,2500 % ING Bank N.V. MTN 12/17, 4,2500 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. FLR MTN 16/26, 4,3750 % Ball Corp. Notes 15/23, 4,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23, 4,5000 % Nordea Bank AB MTN 10/20, 4,6250 % Republik Rumänien MTN 13/20, 4,6250 % Republik Zypern MTN 10/20, 4,6880 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 10/20, 4,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 07/17, 4,7500 % Republik Zypern MTN 14/19, 4,7500 % Telecom Italia S.p.A. MTN 11/18, 4,8000 % Republik Portugal Obr. 10/20, 5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 09/19, 5,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 10/20, 5,2500 % OMV AG FLR Notes 15/Und., 5,2500 % Republik Serbien Notes 12/17 Reg.S, 5,3500 % Intesa Sanpaolo Vita S.p.A. Notes 13/18, 5,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 09/25, 5,5000 % Mexiko MTN 04/20, 5,8500 % Königreich Spanien Bonos 11/22, 6,1250 % Republik Litauen Bonds 11/21 Reg.S, 6,3750 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN S.773 11/19)

DekaTresor

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	6.204.914
Anteilwert	EUR	87,20

Angaben zu Bewertungsverfahren

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgt durch die Verwaltungsgesellschaft auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch (§ 168) und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und -Bewertungsverordnung (KARBV).

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen / Investmentanteile

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate

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

Bankguthaben

Der Wert von Bankguthaben, Einlagezertifikaten 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	in % des Fondsvermögens
85.123.778,73	15,73

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale
Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
47.079.116,49	Deutschland
38.044.662,24	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
85.123.778,73

Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten

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

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

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

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

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR
GBP

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

Restlaufzeit 1-7 Tage
unbefristet

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
43.196.580,23
48.770.691,70

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	60.445,12	100,00
Kostenanteil des Fonds	29.618,08	49,00
Ertragsanteil der KVG	29.618,08	49,00

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

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

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

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

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

16,59% (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
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	8.398.606,11
Sociedad de Gestion de Activos Proc. de la Reestr. Bancaria S.A.	7.432.945,78
3M Co.	4.467.159,67
Barclays PLC	4.038.922,74
Citigroup Inc.	3.806.708,53
FMS Wertmanagement	3.105.729,18
Nordrhein-Westfalen, Land	2.898.371,06
LfA Förderbank Bayern	2.814.075,82
Barclays Bank PLC	2.623.403,70
NRW Städtelanleihe 2	2.616.896,65

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	23.620.842,41 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus	39.157.657,49 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
J.P.Morgan AG Frankfurt	29.188.772,03 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.

Frankfurt am Main, den 1. März 2017

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Informationen der Verwaltung.

Das DekaBank Depot – Service rund um Ihre Investmentfonds –

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

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

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

- Deka-ZukunftsPlan: Die individuelle Vorsorgelösung mit intelligentem Anlagekonzept – auch mit Riester-Förderung.
- Deka-BonusRente: Bietet Ihnen alle Vorteile einer Riester-Lösung und eröffnet zudem zusätzliche Renditechancen an den Wertpapiermärkten.
- Deka-BasisRente: Kombiniert als Rürup-Lösung die Vorteile einer staatlich geförderten Investmentanlage mit dem Wachstumspotenzial einer optimierten Vermögensstruktur.

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

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

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben

gezeichnetes und
eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.
(Stand: 31. Dezember 2015)

Alleingeschäftlerin

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Rüdiger

Vorsitzender des Vorstandes der
DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;

Vorsitzender des Aufsichtsrates der
Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin;

Mitglied des Aufsichtsrates der
Deka Immobilien GmbH,
Frankfurt am Main

Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better

Mitglied des Vorstandes der
DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;

Stellvertretende Vorsitzende des
Aufsichtsrates der
Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin

und der

Deka Immobilien GmbH,
Frankfurt am Main

und der

Deka Immobilien Investment GmbH,
Frankfurt am Main

und der

WestInvest Gesellschaft für
Investmentfonds mbH,
Düsseldorf

und der

S Broker AG & Co. KG,
Wiesbaden

Mitglied des
Verwaltungsrates der DekaBank
Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A.,
Luxemburg

Mitglieder

Dr. Fritz Becker

Mitglied des Aufsichtsrates der
Augsburger Aktienbank AG,
Augsburg

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der
Ostsächsischen Sparkasse Dresden,
Dresden

und der

Sachsen-Finanzgruppe,
Dresden

Jörg Munning

Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse,
Münster

Heinz-Jürgen Schäfer
Offenbach

(Stand 9. Januar 2017)

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)

Thomas Ketter

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

und der

International Fund Management S.A.,
Luxemburg

und der

Dealis Fund Operations S.A.,
Luxemburg

Dr. Ulrich Neugebauer

Mitglied des Aufsichtsrates der
S-PensionsManagement GmbH,
Köln

und der

Sparkassen Pensionsfonds AG,
Köln

und der

Sparkassen Pensionskasse AG,
Köln

Michael Schmidt

Thomas Schneider

Mitglied des Aufsichtsrates der
Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin

Steffen Selbach

(Stand 1. Januar 2017)

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sonder- vermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squaire
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Eigenkapital

gezeichnetes und eingezahltes

Kapital: EUR 447,9 Mio.

Eigenmittel: EUR 5.319 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2015)

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft
sowie Wertpapiergeschäft

Vertreter in der Schweiz

ACOLIN Fund Services AG
Affolternstrasse 56
8050 Zürich
Schweiz

Zahlstelle in der Schweiz

NPB Neue Privat Bank AG
Limmatquai 1/am Bellevue
8001 Zürich
Schweiz

Das Domizil des Fonds ist Deutschland.
Dieses Dokument darf in und von der
Schweiz aus nur an qualifizierte Anleger,
gemäß Art. 10 Abs. 3, 3bis und 3ter KAG,
vertrieben werden.

Mit Bezug auf die in und von der Schweiz
aus vertriebenen Fondsanteile sind Erfül-
lungsort und Gerichtsstand am Sitz des
Vertreters in der Schweiz begründet. Die
maßgebenden Dokumente sowie der
Jahres- und Halbjahresbericht können
beim Vertreter in der Schweiz kostenlos
bezogen werden.

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt

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