

Halbjahresbericht
zum 31. Dezember 2017.

Deka-EuropaBond

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



„Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

Januar 2018

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-EuropaBond für den Zeitraum vom 1. Juli 2017 bis zum 31. Dezember 2017.

Die Kapitalmärkte und die Realwirtschaft setzten in den vergangenen sechs Monaten die seit mehr als einem Jahr andauernde starke Erholung fort. In einem Umfeld, das von einem weiter synchron verlaufenden kräftigen Aufschwung in den reiferen und einem weitgehend soliden Wachstum in den aufstrebenden Volkswirtschaften geprägt war, lagen die Wirtschaftsbarometer weit im expansiven Bereich. Die liquiditätsgetriebene Suche nach auskömmlichen Renditen und steigende Unternehmensgewinne überdeckten bestehende geldpolitische Risiken. Trotz verschiedener Maßnahmen einiger der wichtigsten Zentralbanken die akkommodierende Geldpolitik behutsam zurückzuschrauben, blieb der Inflationsdruck aus, was das bestehende Goldilocks-Szenario stützte.

Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen bewegte sich im Berichtszeitraum unter Schwankungen seitwärts. Nach einem Anstieg zu Beginn des dritten Quartals 2017 ging die Rendite wieder zurück und lag zuletzt mit 0,4 Prozent leicht unter ihrem Ausgangsniveau. Laufzeitgleiche US-Treasuries traten im Stichtagsvergleich auf der Stelle, die Rendite legte per saldo leicht auf 2,4 Prozent zu.

Während die US-amerikanischen sowie die asiatischen Aktienmärkte im vergangenen Halbjahr deutliche Kurssteigerungen aufwiesen (Dow Jones Industrial Average plus 15,8 Prozent, Nikkei 225 plus 13,6 Prozent), entwickelten sich die europäischen Börsen uneinheitlich. So verzeichneten der DAX sowie der EURO STOXX 50 vergleichsweise geringe Zuwächse von 4,8 Prozent bzw. 1,8 Prozent, spanische Aktien (IBEX 35) notierten sogar im negativen Bereich (minus 3,8 Prozent).

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Deka-EuropaBond im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 0,2 Prozent (in den Anteilklassen CF und AV) bzw. minus 0,1 Prozent (Anteilklasse TF).

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider



Steffen Selbach

Inhalt.

Anlagepolitik. Deka-EuropaBond	5
Anteilklassen im Überblick.	6
Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2017. Deka-EuropaBond	7
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2017. Deka-EuropaBond	8
Anhang. Deka-EuropaBond	19
Informationen der Verwaltung.	22
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.	23

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

Deka-EuropaBond

Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Deka-EuropaBond besteht in der Erzielung eines mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachses durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Hierzu sollen die Zins-, Kurs- und Währungschancen der europäischen Rentenmärkte einschließlich Zentral- und Osteuropas genutzt werden. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, überwiegend in verzinsliche Wertpapiere von Ausstellern aus ganz Europa zu investieren. Neben Investitionen in verzinsliche Wertpapiere von Ausstellern aus dem Euroraum sowie aus den übrigen Ländern Westeuropas können auch Investitionen in Anleihen aus Zentral- und Osteuropa getätigt werden. Die Anlagen erfolgen überwiegend in Staats- und Unternehmensanleihen sowie in besicherten verzinslichen Wertpapieren, z. B. Pfandbriefen. Der Fonds erwirbt Anleihen in Lokalwährung oder in Hartwährung (vornehmlich Euro). Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Der Fonds hat per saldo die akzentuierte Positionierung in Unternehmensanleihen leicht reduziert auf zuletzt 16,5 Prozent. Anlagen wurden vor allem in Anleihen guter Bonität (Investment Grade) getätigt und eine breite Streuung umgesetzt. Das Fondsmanagement nahm zudem regelmäßig an attraktiv ausgestatteten Neuemissionen teil.

Auf das Segment Staatsanleihen entfielen zum Stichtag über zwei Drittel des Fondsvermögens. Unter Ländergesichtspunkten bildeten Großbritannien und Polen die größten Engagements.

Zuletzt waren 95,8 Prozent des Fondsvermögens in Wertpapieren (inkl. Rentenfonds) investiert. Zur Feinststeuerung kamen verschiedene Derivate zum Einsatz. Die Zinssensitivität des Portfolios (Duration) wurde angesichts steigender Inflationserwartungen zunächst tendenziell verkürzt und im Dezember wieder verlängert.

Positive Effekte auf die Wertentwicklung lieferten unter anderem das Engagement in Unternehmensanleihen und Anleihen aus der Euro-Peripherie sowie die Steuerung der Duration. Nachteile ergaben sich hingegen aus dem Renditeanstieg an den Standardmärkten.

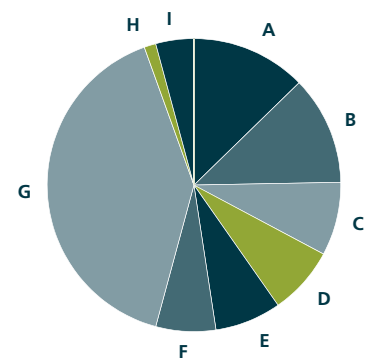
Wichtige Kennzahlen Deka-EuropaBond

Performance*	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Anteilklasse CF	0,2%	0,6%	0,8%
Anteilklasse TF	-0,1%	0,1%	0,3%
Anteilklasse AV	0,2%	0,6%	-

ISIN	
Anteilklasse CF	DE000DK091G0
Anteilklasse TF	DE0009771980
Anteilklasse AV	DE000DK2J878

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

Fondsstruktur Deka-EuropaBond



A	Polen	12,7%
B	Großbritannien	12,0%
C	Dänemark	8,1%
D	Ungarn	7,5%
E	Italien	7,3%
F	Frankreich	6,6%
G	Sonstige Länder	40,3%
H	Rentenfonds	1,3%
I	Barreserve, Sonstiges	4,2%

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

Deka-EuropaBond wies im Betrachtungszeitraum ein Plus von 0,2 Prozent in den Anteilklassen CF und AV auf. Die Anteilklasse TF verzeichnete eine Wertminderung um 0,1 Prozent. Das Fondsvolumen belief sich zum Stichtag auf 874,8 Mio. Euro.

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds Deka-EuropaBond können Anteilklassen gebildet werden, die sich hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind derzeit Anteile von drei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags, der Mindestanlagesumme und der Höhe der Verwaltungsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung „CF“, „TF“ und „AV“. Anteile, die bis zum 30. September 2007 unter der Bezeichnung „Deka-EuropaBond TF“ begeben wurden, werden seit dem 1. Oktober 2007 der Anteilklasse „TF“ zugeordnet.

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

Anteilklassen im Überblick				
	Mindestanlagesumme	Ausgabeaufschlag	Verwaltungsvergütung*	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	keine	3,00%	0,75% p.a.	Ausschüttung
Anteilklasse TF	keine	keiner	1,23% p.a.	Ausschüttung
Anteilklasse AV	5.000,- EUR	keiner	0,76% p.a.	Ausschüttung
* Der Verwaltungsvergütungssatz wird auf das durchschnittliche Fondsvermögen berechnet, das sich aus den Tageswerten zusammensetzt. Näheres ist im Verkaufsprospekt geregelt.				

Deka-EuropaBond

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2017.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	821.328.698,77	93,93
Belgien	28.535.495,50	3,27
Dänemark	70.570.097,98	8,06
Deutschland	10.075.758,00	1,15
Frankreich	57.153.731,50	6,56
Großbritannien	104.203.235,15	11,91
Irland	11.025.993,42	1,26
Island	755.921,25	0,09
Italien	63.107.803,00	7,21
Japan	6.872.919,50	0,78
Kasachstan	2.176.657,04	0,25
Kroatien	9.153.000,00	1,05
Litauen	4.175.850,00	0,48
Luxemburg	11.648.718,54	1,33
Mexiko	2.543.306,25	0,29
Niederlande	38.828.469,69	4,44
Norwegen	46.636.042,79	5,33
Österreich	2.825.199,50	0,32
Polen	110.174.431,85	12,59
Portugal	14.888.362,68	1,70
Rumänien	2.822.187,50	0,32
Schweden	45.294.468,33	5,19
Schweiz	405.084,00	0,05
Slowakei	6.142.815,00	0,70
Sonstige	32.862.103,48	3,75
Spanien	48.463.677,40	5,57
Tschechische Republik	15.923.509,47	1,82
Türkei	4.055.810,48	0,46
Ungarn	65.319.047,47	7,46
USA	4.689.002,00	0,54
2. Investmentanteile	10.935.108,00	1,25
Luxemburg	10.935.108,00	1,25
3. Derivate	-5.237.428,06	-0,61
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	34.372.962,44	3,91
5. Sonstige Vermögensgegenstände	15.400.545,66	1,75
II. Verbindlichkeiten	-1.993.825,03	-0,23
III. Fondsvermögen	874.806.061,78	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	821.328.698,77	93,93
CHF	14.581.896,51	1,67
CZK	12.557.899,47	1,44
DKK	70.570.097,98	8,06
EUR	357.675.885,78	40,95
GBP	96.020.420,96	10,97
HUF	62.206.172,47	7,10
KZT	2.176.657,04	0,25
NOK	46.636.042,79	5,33
PLN	107.615.003,23	12,29
SEK	38.719.250,33	4,44
TRY	4.055.810,48	0,46
USD	8.513.561,73	0,97
2. Investmentanteile	10.935.108,00	1,25
EUR	10.935.108,00	1,25
3. Derivate	-5.237.428,06	-0,61
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	34.372.962,44	3,91
5. Sonstige Vermögensgegenstände	15.400.545,66	1,75
II. Verbindlichkeiten	-1.993.825,03	-0,23
III. Fondsvermögen	874.806.061,78	100,00

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

Deka-EuropaBond

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2017.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								666.245.438,07	76,21
Verzinsliche Wertpapiere								666.245.438,07	76,21
EUR								307.058.460,28	35,16
FR0013296373	0,1250 % Agence Française Développement MTN 17/23		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 99,361	1.788.498,00	0,20
FR0013295722	1,5000 % APRR MTN 17/33		EUR	2.100.000	2.100.000	0	% 97,963	2.057.212,50	0,24
XS1730873731	0,9500 % ArcelorMittal S.A. MTN 17/23		EUR	2.450.000	2.450.000	0	% 99,495	2.437.627,50	0,28
XS1577953760	0,3210 % Asahi Group Holdings Ltd. Notes 17/21		EUR	2.300.000	2.300.000	0	% 99,927	2.298.309,50	0,26
FR0013236312	0,6250 % Auchan Holding S.A. MTN 17/22		EUR	1.800.000	0	0	% 101,091	1.819.629,00	0,21
FR0013231099	1,2500 % Autoroutes du Sud de la France MTN 17/27 ¹⁾		EUR	2.100.000	0	0	% 102,337	2.149.066,50	0,25
XS1134541306	3,9410 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und. ¹⁾		EUR	700.000	0	0	% 113,688	795.812,50	0,09
XS1117528189	1,7500 % Babcock International Grp PLC MTN 14/22		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 104,379	1.043.785,00	0,12
XS1346315200	1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 16/21 ¹⁾		EUR	5.100.000	0	0	% 102,561	5.230.585,50	0,60
XS1403619411	1,7500 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 16/26		EUR	4.000.000	0	0	% 104,950	4.198.000,00	0,48
XS1709328899	1,6250 % Bank Gospodarstwa Krajowego MTN 17/28		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 101,900	4.076.000,00	0,47
XS1055241373	3,5000 % BBVA Sub.Capital S.A.U. FLR MTN 14/24		EUR	700.000	0	0	% 104,144	729.008,00	0,08
XS1345331299	1,1250 % BNP Paribas S.A. MTN 16/23		EUR	1.275.000	0	0	% 103,497	1.319.586,75	0,15
XS1614416193	1,5000 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 17/25 ¹⁾		EUR	3.100.000	0	0	% 103,513	3.208.887,50	0,37
FR0013256369	1,0000 % Bpifrance Financement S.A. Obligations 17/27		EUR	4.500.000	0	0	% 102,113	4.595.085,00	0,53
IT0005314544	0,7500 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 17/22		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 99,440	2.983.200,00	0,34
XS0940293763	3,0000 % CEZ AS MTN 13/28		EUR	3.000.000	4.900.000	1.900.000	% 112,187	3.365.610,00	0,38
DE000CB83CF0	7,7500 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN 5.774 11/21		EUR	700.000	0	0	% 121,584	851.088,00	0,10
XS1637093508	0,6250 % Compass Group International BV MTN 17/24		EUR	3.000.000	0	1.550.000	% 99,304	2.979.105,00	0,34
FR0013236544	3,5000 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 17/29		EUR	2.000.000	2.000.000	1.900.000	% 113,730	2.274.600,00	0,26
FR0013247202	1,8750 % Edenred S.A. Notes 17/27		EUR	1.500.000	0	1.000.000	% 104,437	1.566.555,00	0,18
XS1551068676	1,5000 % ENI S.p.A. MTN 17/27 ¹⁾		EUR	2.000.000	0	0	% 101,490	2.029.790,00	0,23
EU000A1G0D05	1,4500 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/40 ¹⁾		EUR	7.500.000	7.500.000	0	% 102,050	7.653.750,00	0,87
EU000A18Z2D4	0,7500 % Europäische Union MTN 16/31		EUR	1.650.000	1.650.000	0	% 99,034	1.634.061,00	0,19
EU000A1Z99B9	0,7500 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) MTN 17/27		EUR	7.000.000	0	0	% 101,669	7.116.795,00	0,81
BE0002292614	1,7500 % FLUXYS Belgium S.A. Notes 17/27		EUR	1.800.000	2.300.000	500.000	% 100,327	1.805.877,00	0,21
PTGALLOM0004	1,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 17/23		EUR	3.900.000	3.900.000	0	% 99,795	3.892.005,00	0,44
XS0479541699	4,1250 % Gas Natural CM S.A. MTN 10/18		EUR	400.000	0	0	% 100,282	401.128,00	0,05
XS0856556807	5,0000 % Hannover Finance (Lux.) S.A. FLR Notes 12/43		EUR	1.500.000	0	0	% 120,796	1.811.940,00	0,21
FR0013287273	1,5000 % Iliad S.A. Obl. 17/24		EUR	700.000	2.300.000	1.600.000	% 100,469	703.283,00	0,08
XS0995102695	3,5000 % ING Bank N.V. MTN 13/23		EUR	500.000	0	0	% 103,050	515.250,00	0,06
XS1685542497	1,6250 % Italgas S.P.A. MTN 17/29		EUR	1.000.000	4.400.000	3.400.000	% 100,714	1.007.135,00	0,12
XS1525536840	2,0000 % ITV PLC Notes 16/23 ¹⁾		EUR	1.725.000	0	0	% 103,794	1.790.437,88	0,20
XS1485532896	0,6250 % Kon. KPN N.V. MTN 16/25		EUR	1.800.000	0	0	% 97,716	1.758.888,00	0,20
BE0000321308	4,2500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.61 11/21 ¹⁾		EUR	7.000.000	0	0	% 117,212	8.204.840,00	0,94
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25 ¹⁾		EUR	1.500.000	0	0	% 103,411	1.551.165,00	0,18
BE0000339482	0,2000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.79 16/23 ¹⁾		EUR	9.300.000	0	0	% 100,875	9.381.375,00	1,07
BE0000344532	1,4500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.84 17/37 ¹⁾		EUR	4.000.000	0	4.200.000	% 102,548	4.101.920,00	0,47
NL0012650469	0,0000 % Königreich Niederlande Anl. 17/24 ¹⁾		EUR	7.000.000	7.000.000	0	% 99,614	6.972.945,00	0,80
NL0012171458	0,7500 % Königreich Niederlande Anl. 17/27		EUR	8.050.000	8.050.000	0	% 102,159	8.223.799,50	0,94
ES00000128B8	0,7500 % Königreich Spanien Bonos 16/21 ¹⁾		EUR	5.850.000	0	0	% 102,536	5.998.356,00	0,69
ES0000012A97	0,4500 % Königreich Spanien Bonos 17/22		EUR	7.890.000	10.890.000	3.000.000	% 100,456	7.925.978,40	0,91
ES0000012411	5,7500 % Königreich Spanien Obl. 01/32		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 147,430	4.422.885,00	0,51
ES00000127Z9	1,9500 % Königreich Spanien Obligaciones 16/26		EUR	8.500.000	8.500.000	0	% 105,766	8.990.067,50	1,03
ES0000012A89	1,4500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/27		EUR	3.000.000	23.000.000	30.900.000	% 99,335	2.980.035,00	0,34
ES00000128Q6	2,3500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/33		EUR	4.000.000	7.500.000	3.500.000	% 102,203	4.088.120,00	0,47
DE000A2G5FA2	0,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 17/27 ¹⁾		EUR	9.300.000	9.300.000	0	% 99,190	9.224.670,00	1,05
FR0013262912	1,6250 % Lagardère S.C.A. Obl. 17/24		EUR	3.800.000	0	0	% 99,372	3.776.117,00	0,43
XS1693260702	0,7500 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 17/22		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 100,294	3.008.820,00	0,34
FR0013257623	0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 17/24 ¹⁾		EUR	2.950.000	0	0	% 101,203	2.985.473,75	0,34
XS1638816089	1,3750 % Nationwide Building Society MT Mortg.Cov.Bds 17/32		EUR	2.850.000	0	0	% 101,571	2.894.773,50	0,33
XS1508351357	0,1250 % PKO Bank Hipoteczny S.A. Mortg.Cov. MTN 16/22		EUR	1.500.000	0	0	% 98,925	1.483.875,00	0,17
XS1694212181	0,6250 % PSA Banque France S.A. MTN 17/22		EUR	1.450.000	1.450.000	0	% 100,018	1.450.261,00	0,17
XS1576838376	1,0000 % RELX Finance B.V. Notes 17/24		EUR	1.700.000	0	0	% 101,457	1.724.760,50	0,20
FR0010070060	4,7500 % Rep. Frankreich OAT 04/35 ¹⁾		EUR	3.400.000	0	0	% 155,997	5.303.881,00	0,61
FR0011883966	2,5000 % Rep. Frankreich OAT 14/30 ¹⁾		EUR	7.000.000	0	0	% 118,485	8.293.915,00	0,95
FR0013234333	1,7500 % Rep. Frankreich OAT 17/39		EUR	5.000.000	5.000.000	4.000.000	% 106,002	5.300.100,00	0,61
IE00BDHDPQ37	0,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 17/22 ¹⁾		EUR	8.500.000	8.500.000	0	% 99,895	8.491.032,50	0,97
IT0004286966	5,0000 % Republik Italien B.T.P. 07/39		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 131,913	3.957.390,00	0,45
IT0004889033	4,7500 % Republik Italien B.T.P. 13/28		EUR	2.500.000	0	0	% 125,353	3.133.825,00	0,36

Deka-EuropaBond

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
IT0005001547	3,7500 % Republik Italien B.T.P. 14/24		EUR	1.000.000	0	0	% 115,596	1.155.960,00	0,13
IT0005135840	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 15/22		EUR	5.500.000	0	0	% 103,334	5.683.370,00	0,65
IT0005162828	2,7000 % Republik Italien B.T.P. 16/47		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 91,625	2.748.735,00	0,31
IT0005246340	1,8500 % Republik Italien B.T.P. 17/24		EUR	3.100.000	0	0	% 103,631	3.212.545,50	0,37
IT0005282527	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 17/24		EUR	3.500.000	15.600.000	12.100.000	% 100,495	3.517.307,50	0,40
IT0005274805	2,0500 % Republik Italien B.T.P. 17/27		EUR	15.000.000	22.700.000	7.700.000	% 100,856	15.128.325,00	1,73
IT0005273013	3,4500 % Republik Italien B.T.P. 17/48		EUR	7.000.000	0	5.650.000	% 104,347	7.304.255,00	0,83
XS1713475306	2,7500 % Republik Kroatien Notes 17/30		EUR	9.000.000	9.000.000	0	% 101,700	9.153.000,00	1,05
XS1619567677	0,9500 % Republik Litauen MTN 17/27		EUR	4.100.000	4.100.000	7.400.000	% 101,850	4.175.850,00	0,48
PTOTEKOE0011	2,8750 % Republik Portugal Obr. 15/25		EUR	1.000.000	8.500.000	7.500.000	% 110,335	1.103.350,00	0,13
XS1599193403	2,3750 % Republik Rumänien MTN 17/27 Reg.S		EUR	2.750.000	2.750.000	7.000.000	% 102,625	2.822.187,50	0,32
FR0013290749	1,8750 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. MTN 17/37		EUR	1.700.000	1.700.000	0	% 100,945	1.716.065,00	0,20
XS1487315860	1,1250 % Santander UK Group Hldgs PLC MTN 16/23 ¹⁾		EUR	1.250.000	0	0	% 101,494	1.268.668,75	0,15
SK4120013400	2,0000 % Slowakei Anl. 17/47		EUR	2.700.000	2.700.000	0	% 105,000	2.835.000,00	0,32
SK4120012691	1,8750 % Slowakei MTN 17/37		EUR	3.150.000	0	350.000	% 105,010	3.307.815,00	0,38
FR0013053329	1,8750 % Soc.Autorout.Nord-I'Est France Obl. 15/26		EUR	2.500.000	0	0	% 106,407	2.660.175,00	0,30
BE6282459609	1,6250 % Solvay S.A. Notes 15/22		EUR	1.300.000	0	0	% 105,185	1.367.398,50	0,16
XS1693281534	0,7500 % Standard Chartered PLC FLR MTN 17/23		EUR	4.275.000	4.275.000	0	% 99,879	4.269.827,25	0,49
XS1720642138	0,6250 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 17/24		EUR	4.700.000	4.700.000	0	% 99,766	4.689.002,00	0,54
CH0336602930	1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG MTN 16/26		EUR	400.000	0	0	% 101,271	405.084,00	0,05
XS1696445516	1,7500 % Ungarn Bonds 17/27 ¹⁾		EUR	3.000.000	6.700.000	3.700.000	% 103,763	3.112.875,00	0,36
FR0013282571	0,8750 % Vivendi S.A. MTN 17/24		EUR	3.400.000	3.400.000	0	% 99,692	3.389.528,00	0,39
XS1499604905	0,5000 % Vodafone Group PLC MTN 16/24		EUR	2.300.000	0	0	% 98,122	2.256.794,50	0,26
AT000B121967	2,7500 % Volksbank Wien AG FLR Notes 17/27		EUR	1.000.000	5.000.000	4.000.000	% 99,505	995.050,00	0,11
XS1575992596	1,5000 % Wolters Kluwer N.V. Notes 17/27		EUR	1.000.000	0	0	% 102,232	1.022.320,00	0,12
CHF								14.581.896,51	1,67
CH0028622600	2,7500 % Commerzbank Finance&Covered Bd MT Let.d.G.P. 07/22		CHF	2.000.000	0	0	% 110,460	1.891.292,62	0,22
CH0025185676	3,0000 % EUROFIMA Anl. 06/26		CHF	8.700.000	0	0	% 124,315	9.259.051,10	1,06
CH0346828400	2,7500 % Gaz Capital S.A. MT LPN GAZPROM 16/21		CHF	1.000.000	0	0	% 104,730	896.591,87	0,10
CH0379268748	2,1000 % RZD Capital PLC LPN Russ.Railways 17/23		CHF	2.950.000	2.950.000	0	% 100,375	2.534.960,92	0,29
CZK								12.557.899,47	1,44
CZ0001003859	2,5000 % Tschechien Anl. 13/28		CZK	300.000.000	390.000.000	90.000.000	% 107,054	12.557.899,47	1,44
DKK								70.570.097,98	8,06
DK0009922320	4,5000 % Königreich Dänemark Anl. 07/39		DKK	125.000.000	35.000.000	0	% 169,300	28.422.636,04	3,24
DK0009922676	3,0000 % Königreich Dänemark Anl. 10/21		DKK	40.000.000	0	0	% 112,855	6.062.868,92	0,69
DK0009923054	1,5000 % Königreich Dänemark Anl. 12/23		DKK	150.000.000	0	0	% 108,860	21.930.926,11	2,51
DK0009923567	0,5000 % Königreich Dänemark Anl. 17/27		DKK	105.000.000	0	0	% 100,365	14.153.666,91	1,62
GBP								96.020.420,96	10,97
XS1475051162	1,1770 % BP Capital Markets PLC MTN 16/23		GBP	3.300.000	0	0	% 98,294	3.660.961,94	0,42
XS1637093920	2,0000 % Compass Group PLC MTN 17/29		GBP	1.500.000	0	0	% 98,834	1.673.215,62	0,19
GB0032452392	4,2500 % Großbritannien Treasury Stock 03/36		GBP	13.000.000	0	0	% 140,713	20.645.837,57	2,36
GB00B00NY175	4,7500 % Großbritannien Treasury Stock 04/38		GBP	3.200.000	0	0	% 153,342	5.538.168,44	0,63
GB00B128DP45	4,2500 % Großbritannien Treasury Stock 06/46		GBP	4.500.000	0	0	% 155,863	7.916.113,63	0,90
GB00B24FF097	4,7500 % Großbritannien Treasury Stock 07/30		GBP	4.000.000	0	0	% 139,380	6.292.408,75	0,72
GB00B52WS153	4,5000 % Großbritannien Treasury Stock 09/34		GBP	7.500.000	0	0	% 142,293	12.044.804,29	1,38
GB00B6460505	4,2500 % Großbritannien Treasury Stock 10/40		GBP	3.000.000	0	0	% 147,253	4.985.863,75	0,57
GB00B8KP6M44	1,2500 % Großbritannien Treasury Stock 13/18 ¹⁾		GBP	7.000.000	0	0	% 100,512	7.940.949,41	0,91
GB00BN65R313	3,5000 % Großbritannien Treasury Stock 14/45		GBP	3.350.000	0	0	% 136,727	5.169.583,64	0,59
GB00BDCHBW80	1,5000 % Großbritannien Treasury Stock 16/47		GBP	9.250.000	16.500.000	9.250.000	% 94,218	9.836.255,11	1,12
GB00BD0XH204	1,7500 % Großbritannien Treasury Stock 17/57		GBP	4.250.000	0	0	% 103,712	4.974.786,12	0,57
XS1596727609	1,5000 % Volkswagen Fin. Services N.V. MTN 17/21		GBP	1.875.000	0	0	% 100,573	2.128.330,91	0,24
XS1596735701	2,2500 % Volkswagen Fin. Services N.V. MTN 17/25		GBP	2.825.000	0	0	% 100,776	3.213.141,78	0,37
HUF								62.206.172,47	7,10
HU0000402235	7,5000 % Ungarn Bonds S.20/A 04/20		HUF	2.000.000.000	0	0	% 119,694	7.718.832,12	0,88
HU0000403258	1,0000 % Ungarn Notes S.20/C 17/20		HUF	2.000.000.000	2.000.000.000	0	% 101,318	6.533.799,80	0,75
HU0000403266	1,7500 % Ungarn Notes S.22/B 17/22		HUF	2.500.000.000	2.500.000.000	0	% 103,088	8.309.889,24	0,95
HU0000403340	2,7500 % Ungarn Notes S.26/D 17/26		HUF	4.000.000.000	4.000.000.000	0	% 106,557	13.743.305,33	1,57
HU0000403118	3,0000 % Ungarn Notes S.27/A 16/27		HUF	7.400.000.000	11.400.000.000	4.000.000.000	% 108,549	25.900.345,98	2,95
KZT								2.176.657,04	0,25
XS1734574137	9,5000 % CJSC Dvlpmnt Bk of Kazakhstan MTN 17/20		KZT	858.000.000	858.000.000	0	% 100,988	2.176.657,04	0,25
NOK								42.586.764,44	4,87
NO0010646813	2,0000 % Königreich Norwegen Anl. 12/23		NOK	40.000.000	0	80.000.000	% 104,351	4.241.027,02	0,48
NO0010732555	1,7500 % Königreich Norwegen Anl. 15/25		NOK	100.000.000	0	0	% 102,486	10.413.074,51	1,19
NO0010757925	1,5000 % Königreich Norwegen Anl. 16/26		NOK	40.000.000	0	0	% 100,102	4.068.319,10	0,47
NO0010786288	1,7500 % Königreich Norwegen Anl. 17/27		NOK	90.000.000	90.000.000	90.000.000	% 101,539	9.285.169,25	1,06
NO0010752702	2,3500 % Stadt Oslo Anl. 15/24		NOK	33.000.000	0	0	% 101,621	3.407.294,72	0,39
NO0010752124	2,6000 % Stadt Oslo Anl. 15/25		NOK	30.000.000	0	0	% 102,690	3.130.140,57	0,36
NO0010811227	2,3000 % Stadt Oslo Anl. 17/27		NOK	80.000.000	80.000.000	0	% 98,934	8.041.739,27	0,92
PLN								7.198.446,38	0,82
XS1622379698	3,0000 % European Investment Bank MTN 17/24		PLN	30.000.000	0	0	% 100,080	7.198.446,38	0,82

Deka-EuropaBond

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
SEK								38.719.250,33	4,44
SE0005676608	2,5000 % Königreich Schweden Loan Nr.1058 14/25		SEK	60.000.000	60.000.000	0	% 115,646	7.051.304,07	0,81
SE0007125927	1,0000 % Königreich Schweden Loan Nr.1059 14/26		SEK	180.000.000	380.000.000	200.000.000	% 104,030	19.029.201,20	2,18
SE0009496367	0,7500 % Königreich Schweden Loan Nr.1060 17/28		SEK	90.000.000	90.000.000	115.000.000	% 99,970	9.143.226,61	1,05
SE0002829192	3,5000 % Königreich Schweden Obl. Nr.1053 09/39		SEK	25.000.000	10.000.000	0	% 137,589	3.495.518,45	0,40
TRY								4.055.810,48	0,46
TRT150120T16	10,5000 % Republik Türkei Bonds 10/20		TRY	10.000.000	0	0	% 95,783	2.119.163,25	0,24
TRT240227T17	11,0000 % Republik Türkei Bonds 17/27		TRY	9.000.000	9.000.000	0	% 97,260	1.936.647,23	0,22
USD								8.513.561,73	0,97
XS0424860947	9,2500 % Gaz Capital S.A. LPN GAZPROM 09/19 Reg.S		USD	1.000.000	0	0	% 108,044	902.811,78	0,10
XS0805570354	4,9500 % Gaz Capital S.A. MT LPN GAZPROM 12/22 Reg.S		USD	1.300.000	0	0	% 104,853	1.138.992,27	0,13
XS1085735899	5,1250 % Republik Portugal MTN 14/24 Reg.S		USD	7.200.000	7.200.000	0	% 107,571	6.471.757,68	0,74
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								148.464.519,85	16,97
Verzinsliche Wertpapiere								148.464.519,85	16,97
EUR								48.047.963,00	5,50
XS1718281808	1,6080 % Zi Rete Gas S.p.A. MTN Tr.2 17/27		EUR	6.600.000	6.600.000	0	% 100,131	6.608.613,00	0,76
BE6242927075	2,1250 % Apetra N.V. Notes 12/20		EUR	2.000.000	0	0	% 106,146	2.122.920,00	0,24
PTBCPWOM0034	4,5000 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR MT Obl.17/27		EUR	3.400.000	3.400.000	0	% 100,625	3.421.250,00	0,39
XS1731106347	2,7500 % Cemex S.A.B. de C.V. Notes 17/24 Reg.S		EUR	2.525.000	2.525.000	0	% 100,725	2.543.306,25	0,29
XS1720053229	0,2500 % Ferrari N.V. Notes 17/21		EUR	2.650.000	2.650.000	0	% 99,306	2.631.609,00	0,30
XS1722898431	1,7500 % NE Property Coöperatief U.A. MTN 17/24		EUR	3.700.000	5.700.000	2.000.000	% 97,855	3.620.635,00	0,41
XS1032997568	2,0000 % Nordea Bank AB MTN 14/21		EUR	4.300.000	0	0	% 106,026	4.559.118,00	0,52
XS1734689620	1,0000 % OMV AG MTN 17/26		EUR	1.850.000	1.850.000	0	% 98,927	1.830.149,50	0,21
XS1729879822	1,3750 % Prosegur Cash S.A. MTN 17/26		EUR	4.700.000	4.700.000	0	% 98,204	4.615.588,00	0,53
XS1738511978	0,5000 % Republik Island MTN 17/22		EUR	750.000	750.000	0	% 100,790	755.921,25	0,09
XS1591523755	2,7500 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 17/22		EUR	1.000.000	0	2.800.000	% 102,887	1.028.865,00	0,12
XS1384064587	3,2500 % Santander Issuances S.A.U. MTN 16/26		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 110,270	1.984.851,00	0,23
XS1548444816	3,1250 % Santander Issuances S.A.U. MTN 17/27		EUR	1.000.000	0	1.300.000	% 109,708	1.097.075,00	0,13
XS1511589605	1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken FLR MTN 16/28		EUR	2.000.000	0	1.800.000	% 100,805	2.016.100,00	0,23
XS1621087516	1,4130 % Sumitomo Mitsui Financ. Group MTN 17/27 ¹⁾		EUR	4.500.000	0	0	% 101,658	4.574.610,00	0,52
XS1699951767	0,7500 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. MTN 17/22		EUR	4.650.000	4.650.000	0	% 99,728	4.637.352,00	0,53
PLN								100.416.556,85	11,47
PLPKOHP00058	2,6900 % PKO Bank Hipoteczny S.A. Mortg.Cov. MTN 17/21		PLN	30.000.000	0	0	% 99,500	7.156.728,76	0,82
PL0000108510	1,5000 % Republik Polen Bonds S.0420 15/20		PLN	45.000.000	0	0	% 99,145	10.696.792,06	1,22
PL0000108916	2,0000 % Republik Polen Bonds S.0421 15/21		PLN	20.000.000	0	0	% 99,353	4.764.103,67	0,54
PL0000105391	5,7500 % Republik Polen Bonds S.0429 08/29		PLN	11.000.000	0	0	% 124,635	3.287.024,38	0,38
PL0000109153	1,7500 % Republik Polen Bonds S.0721 16/21		PLN	22.400.000	0	0	% 98,328	5.280.748,04	0,60
PL0000108197	3,2500 % Republik Polen Bonds S.0725 14/25		PLN	32.000.000	0	0	% 101,060	7.753.530,41	0,89
PL0000108866	2,5000 % Republik Polen Bonds S.0726 15/26		PLN	49.000.000	0	0	% 94,790	11.135.989,83	1,27
PL0000109427	2,5000 % Republik Polen Bonds S.0727 16/27		PLN	27.000.000	0	65.500.000	% 93,580	6.057.829,25	0,69
PL0000106126	5,2500 % Republik Polen Bonds S.1020 10/20		PLN	73.000.000	0	0	% 108,908	19.061.315,30	2,18
PL0000106670	5,7500 % Republik Polen Bonds S.1021 11/21		PLN	55.000.000	0	0	% 112,725	14.864.597,57	1,70
PL0000107264	4,0000 % Republik Polen Bonds S.1023 12/23		PLN	40.500.000	0	0	% 106,671	10.357.897,58	1,18
Neuemissionen								4.049.278,35	0,46
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen								4.049.278,35	0,46
Verzinsliche Wertpapiere								4.049.278,35	0,46
NOK								4.049.278,35	0,46
NO0010811276	2,0000 % Kommunalbanken AS MTN 17/27		NOK	40.000.000	40.000.000	0	% 99,633	4.049.278,35	0,46
Nichtnotierte Wertpapiere								2.569.462,50	0,29
Verzinsliche Wertpapiere								2.569.462,50	0,29
EUR								2.569.462,50	0,29
XS1043520144	3,0800 % SB Capital S.A. LP MTN Sberbank 14/19		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 102,779	2.569.462,50	0,29
Wertpapier-Investmentanteile								10.935.108,00	1,25
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								10.935.108,00	1,25
EUR								10.935.108,00	1,25
LU0347181306	Deka-OptiMix Europa CF		ANT	87.600	0	0	EUR 124,830	10.935.108,00	1,25
Summe Wertpapiervermögen ²⁾								832.263.806,77	95,18

Deka-EuropaBond

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								733.558,72	0,08
	EURO Bobl Future (FGBM) März 18	XEUR	EUR	-56.000.000				384.150,00	0,04
	EURO Bund Future (FGBL) März 18	XEUR	EUR	27.000.000				9.700,00	0,00
	EURO Buxl Future (FGBX) März 18	XEUR	EUR	5.400.000				-41.380,00	-0,00
	EURO-BTP Future (FBTP) März 18	XEUR	EUR	-10.500.000				80.450,00	0,01
	Long Gilt Future (FLG) März 18	IFEU	GBP	29.000.000				-77.281,28	-0,01
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) März 18	XEUR	EUR	-43.500.000				377.920,00	0,04
Optionsrechte								226.200,00	0,03
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte								226.200,00	0,03
	EURO Bund Future (FGBL) Put Feb. 18 160,50	XEUR	EUR	Anzahl -300			EUR 0,120	-36.000,00	-0,00
	EURO Bund Future (FGBL) Put Feb. 18 161	XEUR	EUR	Anzahl -480			EUR 0,190	-91.200,00	-0,01
	EURO Bund Future (FGBL) Put Feb. 18 162	XEUR	EUR	Anzahl -300			EUR 0,410	-123.000,00	-0,01
	EURO Bund Future (FGBL) Put Feb. 18 162,50	XEUR	EUR	Anzahl 300			EUR 0,580	174.000,00	0,02
	EURO Bund Future (FGBL) Put Feb. 18 163	XEUR	EUR	Anzahl 480			EUR 0,630	302.400,00	0,03
Summe Zins-Derivate							EUR	959.758,72	0,11
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)								1.923.481,50	0,24
Offene Positionen									
	AUD/EUR 1.720.360,00	OTC						24.953,11	0,00
	AUD/JPY 7.200.000,00	OTC						88.331,29	0,01
	AUD/USD 14.346.711,34	OTC						168.597,76	0,02
	CAD/EUR 28.044.347,00	OTC						217.968,35	0,02
	CHF/EUR 6.192.381,00	OTC						5.447,21	0,00
	CZK/EUR 725.485.588,00	OTC						-173.932,13	-0,02
	DKK/EUR 167.986.801,00	OTC						-14.838,66	-0,00
	GBP/EUR 45.000.000,00	OTC						494.450,61	0,06
	GBP/JPY 6.700.000,00	OTC						115.303,66	0,01
	GBP/USD 21.658.957,36	OTC						226.640,78	0,03
	JPY/EUR 68.529.273,00	OTC						-7.474,54	-0,00
	NOK/EUR 236.999.265,40	OTC						44.036,16	0,01
	NZD/EUR 301.700,00	OTC						5.508,39	0,00
	RON/EUR 11.700.000,00	OTC						-2.104,57	-0,00
	RUB/USD 119.368.221,00	OTC						58.807,61	0,01
	SEK/EUR 586.373.780,00	OTC						364.014,52	0,05
	TRY/EUR 73.476.874,00	OTC						668.461,54	0,07
	TRY/USD 11.784.536,70	OTC						78.635,92	0,01
	USD/EUR 86.972.821,26	OTC						-538.868,75	-0,05
	ZAR/EUR 13.380.793,00	OTC						99.543,24	0,01
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								-1.399.287,48	-0,17
Offene Positionen									
	AUD/JPY 7.200.000,00	OTC						-158.668,02	-0,02
	AUD/USD 14.504.569,28	OTC						-271.456,85	-0,03
	CAD/USD 29.854.126,00	OTC						-275.327,09	-0,03
	CZK/EUR 131.900.000,00	OTC						-5.022,49	-0,00
	DKK/EUR 77.075.933,20	OTC						1.835,12	0,00
	GBP/EUR 750.000,00	OTC						-2.939,97	-0,00
	GBP/JPY 6.700.000,00	OTC						-244.507,87	-0,03
	GBP/USD 17.425.928,84	OTC						-180.767,28	-0,02
	HUF/EUR 2.868.188.085,00	OTC						-78.240,20	-0,01
	NOK/EUR 282.486.063,00	OTC						142.679,77	0,02
	PLN/EUR 156.640.458,00	OTC						-415.811,36	-0,05
	RON/EUR 34.455.480,00	OTC						-18.316,24	-0,00
	RUB/USD 135.283.610,00	OTC						-36.692,63	-0,00
	SEK/EUR 349.884.635,00	OTC						-416.434,40	-0,05
	TRY/EUR 21.602.718,00	OTC						-232.183,97	-0,03
	USD/EUR 114.165.245,40	OTC						792.566,00	0,08
Optionsrechte								63.725,40	0,00
Optionsrechte auf Devisen (Kauf)								63.725,40	0,00
	CALL USD/PUT ILS 3,60 01/18	OTC	USD	52.500.000			% 0,003	1.184,89	0,00
	PUT AUD/CALL JPY 83,75 01/18	OTC	AUD	41.000.000			% 0,024	6.497,27	0,00
	PUT EUR/CALL JPY 130,00 01/18	OTC	EUR	36.000.000			% 0,040	14.288,04	0,00
	PUT EUR/CALL NOK 9,60 01/18	OTC	EUR	60.000.000			% 0,070	41.755,20	0,00
Summe Devisen-Derivate							EUR	587.919,42	0,07

Deka-EuropaBond

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsswaps (Erhalten/Zahlen)								-3.451.916,28	-0,41
IRS 0.195% CHF / LIBCHFM06 CHF / JPM_LDN 15.04.2027	OTC	CHF		12.000.000				6.181,77	0,00
IRS 0.331% EUR / EURIBORM06 EUR / MERRILL_LDN 15.08.2025	OTC	EUR		40.000.000				-812.250,14	-0,09
IRS 0.86682% GBP / LIBGBPM06 GBP / JPM_LDN 19.02.2019	OTC	GBP		100.000.000				453.664,29	0,05
IRS 2,17 % CHF / LIBOR02-6M / CSFBINT_LDN 23.12.2020	OTC	CHF		10.000.000				655.577,41	0,07
IRS 3,9% GBP/6-Monats-LIBOR / DBK_FRA 28.05.2019	OTC	GBP		10.480.000				-561.647,75	-0,06
IRS 6-Monats-EURIBOR / 1,89% EUR / DGZ_FRA 04.02.2023	OTC	EUR		10.500.000				-1.031.689,97	-0,12
IRS EURIBORM06 EUR / 0.473% EUR / GOLDINT_LDN 15.02.2025	OTC	EUR		56.000.000				111.539,45	0,01
IRS EURIBORM06 EUR / 0.6845% EUR / JPM_LDN 23.01.2024	OTC	EUR		30.000.000				-660.769,54	-0,08
IRS EURIBORM06 EUR / 1.414% EUR / DGZ_FRA 08.03.2047	OTC	EUR		6.000.000				33.995,64	0,00
IRS EURIBORM06 EUR / 1.65% EUR / DGZ_FRA 29.05.2023	OTC	EUR		10.000.000				-797.781,46	-0,09
IRS LIBGBPM06 GBP / 1.53% GBP / JPM_LDN 19.02.2027	OTC	GBP		25.000.000				-848.735,98	-0,10
Credit Default Swaps (CDS)								-3.210.137,80	-0,37
Protection Buyer								-3.553.157,10	-0,41
CDS Barclays Bank PLC682 06DABK / BNP_LDN 20.12.2021	OTC	EUR		10.000.000				-254.358,89	-0,03
CDS Credit Agricole S.A.977 FH49GG / CITIGMX_LDN 20.12.2021	OTC	EUR		6.500.000				-222.515,88	-0,03
CDS Credit Agricole S.A.977 FH49GG / CSFBINT_LDN 20.12.2021	OTC	EUR		2.000.000				-68.466,42	-0,01
CDS Credit Agricole S.A.977 FH49GG / CSFBINT_LDN 20.12.2021	OTC	EUR		2.000.000				-68.466,42	-0,01
CDS EDP-Energias de Portuga X3DGB7 / BNP_LDN 20.12.2021	OTC	EUR		2.600.000				-479.601,21	-0,05
CDS EDP-Energias de Portuga X3DGB7 / MERRILL_LDN 20.12.2021	OTC	EUR		2.000.000				-368.924,00	-0,04
CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S28 V1 5Y / GOLDINT_LDN 20.12.2022	OTC	EUR		13.500.000				-1.681.296,57	-0,19
CDS Lloyds Bank PLC9730 GLA88B / BNP_LDN 20.06.2021	OTC	EUR		5.000.000				-132.234,95	-0,02
CDS Wells Fargo + Co.1365 / BNP_LDN 20.12.2020	OTC	USD		15.000.000				-277.292,76	-0,03
Protection Seller								343.019,30	0,04
CDS UBS AG2161 HPHB2JAG6 / BNP_LDN 20.12.2021	OTC	EUR		-10.000.000				343.019,30	0,04
Inflation Swaps (IFS)								-123.052,12	-0,01
Protection Seller								-123.052,12	-0,01
IFS France CPI Ex-Tobacco EUR / 1,415% EUR / DTBKLDN_FRA 15.02.2022	OTC	STK		15.000.000				-123.052,12	-0,01
Summe Swaps								-6.785.106,20	-0,79
Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR		28.785.192,24			% 100,000	28.785.192,24	3,28
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale		CZK		138.463,38			% 100,000	5.414,12	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK		241.780,37			% 100,000	32.472,70	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP		372.446,25			% 100,000	420.358,74	0,05
DekaBank Deutsche Girozentrale		HUF		147.426.961,38			% 100,000	475.363,83	0,05
DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK		203.221,36			% 100,000	20.648,28	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		PLN		809,56			% 100,000	194,10	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK		605.636,74			% 100,000	61.546,26	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF		253.891,83			% 100,000	217.356,39	0,02
DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY		5.863,00			% 100,000	43,51	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD		1.563,43			% 100,000	929,18	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		RON		17.029.932,51			% 100,000	3.654.256,70	0,42
DekaBank Deutsche Girozentrale		TRY		963.347,09			% 100,000	213.136,96	0,02
DekaBank Deutsche Girozentrale		USD		581.679,65			% 100,000	486.049,43	0,06
Summe Bankguthaben								34.372.962,44	3,91
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahen Fonds								34.372.962,44	3,91

Deka-EuropaBond

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	5.812.388,79				5.812.388,79	0,66
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	2.414.765,25				2.414.765,25	0,27
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	12.431,83				12.431,83	0,00
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	6.928,08				6.928,08	0,00
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	1.225.827,12				1.225.827,12	0,14
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	78.204,59				78.204,59	0,01
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	5.850.000,00				5.850.000,00	0,67
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	15.400.545,66	1,75
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		MXN	-0,01			% 100,000	-0,00	-0,00
	Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						EUR	-0,00	-0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-6.091,62				-6.091,62	-0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-357.004,49				-357.004,49	-0,04
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-850.728,92				-850.728,92	-0,10
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-780.000,00				-780.000,00	-0,09
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-1.993.825,03	-0,23
Fondsvermögen									
	Umlaufende Anteile Klasse CF						EUR	874.806.061,78	100,00
	Umlaufende Anteile Klasse TF						STK	2.117.396	
	Umlaufende Anteile Klasse AV						STK	15.194.332	
	Anteilwert Klasse CF						STK	14.500	
	Anteilwert Klasse TF						EUR	113,68	
	Anteilwert Klasse AV						EUR	41,64	
							EUR	100,21	

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

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

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR befristet	unbefristet	gesamt
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
1,2500 % Autoroutes du Sud de la France MTN 17/27	EUR	800.000	818.692,00	
3,9410 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und.	EUR	500.000	568.437,50	
1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 16/21	EUR	300.000	307.681,50	
1,5000 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 17/25	EUR	1.624.000	1.681.043,01	
1,5000 % ENI S.p.A. MTN 17/27	EUR	1.106.000	1.122.473,88	
1,4500 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/40	EUR	7.477.000	7.630.278,50	
1,2500 % Großbritannien Treasury Stock 13/18	GBP	6.000.000	6.806.528,07	
2,0000 % ITV PLC Notes 16/23	EUR	1.525.000	1.582.850,88	
4,2500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.61 11/21	EUR	7.000.000	8.204.840,00	
0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25	EUR	1.500.000	1.551.165,00	
0,2000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.79 16/23	EUR	5.300.000	5.346.375,00	
1,4500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.84 17/37	EUR	4.000.000	4.101.920,00	
0,0000 % Königreich Niederlande Anl. 17/24	EUR	6.240.850	6.216.729,12	
0,7500 % Königreich Spanien Bonos 16/21	EUR	4.850.000	4.972.996,00	
0,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 17/27	EUR	4.522.000	4.485.371,80	
0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 17/24	EUR	170.964	173.019,85	
4,7500 % Rep. Frankreich OAT 04/35	EUR	3.000.000	4.679.895,00	
2,5000 % Rep. Frankreich OAT 14/30	EUR	6.968.393	8.256.465,60	
0,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 17/22	EUR	8.500.000	8.491.032,50	
1,1250 % Santander UK Group Hldgs PLC MTN 16/23	EUR	19.000	19.283,77	
1,4130 % Sumitomo Mitsui Financ. Group MTN 17/27	EUR	4.500.000	4.574.610,00	
1,7500 % Ungarn Bonds 17/27	EUR	3.000.000	3.112.875,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		84.704.563,98	84.704.563,98

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.12.2017

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88602	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,44565	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,84205	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	9,84035	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,16809	= 1 Euro (EUR)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	4,51985	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,17090	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	25,57450	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	310,13500	= 1 Euro (EUR)

Deka-EuropaBond

Rumänien, Leu	(RON)	4,66030	= 1 Euro (EUR)
Russische Föderation, Rubel	(RUB)	68,82415	= 1 Euro (EUR)
Kasachstan, Tenge	(KZT)	398,07500	= 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	14,75870	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,19675	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,50033	= 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso	(MXN)	23,57800	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	134,75000	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,53272	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,68260	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

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				
CZK				
CZ0001001796	4,2000 % Tschechien Anl. S.49 03/36	CZK	0	25.000.000
CZ0001001945	4,7000 % Tschechien Anl. S.55 07/22	CZK	220.000.000	220.000.000
DKK				
DK0009923138	1,7500 % Königreich Dänemark Anl. 14/25	DKK	0	140.000.000
EUR				
XS1685798370	0,8750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Notes 17/24	EUR	3.525.000	3.525.000
XS1577951715	1,1510 % Asahi Group Holdings Ltd. Notes 17/25	EUR	2.225.000	2.225.000
XS1699732704	0,6250 % ASB Finance Ltd. (Ldn Branch) MT Mtg Cov.Nts 17/24	EUR	2.400.000	2.400.000
XS1664644710	1,1250 % B.A.T. Capital Corp. MTN 17/23	EUR	2.125.000	2.125.000
XS1664644983	2,2500 % B.A.T. Intl Finance PLC MTN 17/30	EUR	4.375.000	4.375.000
XS1640827843	0,5000 % Bank of Queensland Ltd. MT Mortg.Cov.Bds 17/22	EUR	3.925.000	3.925.000
XS1678970291	2,0000 % Barclays PLC FLR MTN 17/28	EUR	4.525.000	4.525.000
XS1637333748	1,5000 % British Telecommunications PLC MTN 17/27	EUR	0	3.275.000
IT0005273567	1,5000 % Cassa Depositi e Prestiti SpA MTN 17/24	EUR	0	10.000.000
XS1685806900	3,0000 % CEZ AS MTN Tr.2 17/28	EUR	4.900.000	4.900.000
FR0013264421	1,5000 % Coentr.d.Trans.d'Elec.SA (CTE) Obl. 17/28	EUR	0	4.200.000
DE000CZ40L63	1,1250 % Commerzbank AG MTN Anl. S.883 17/24	EUR	0	7.900.000
DE000CZ40LD5	4,0000 % Commerzbank AG Nachr. MTN S.865 16/26	EUR	0	500.000
DE000CZ40LW5	4,0000 % Commerzbank AG T2 Nachr. MTN S.874 17/27	EUR	0	2.200.000
CH0343366842	1,2500 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 17/25	EUR	4.800.000	4.800.000
XS1300465926	2,7500 % Davide Campari-Milano S.p.A. Notes 15/20	EUR	0	1.694.000
XS1626600040	1,5000 % Deutsche Bahn Finance GmbH MTN 17/32	EUR	0	4.550.000
XS1557095616	1,3750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/27	EUR	0	2.000.000
XS1652512457	1,3750 % DS Smith PLC MTN 17/24	EUR	3.575.000	3.575.000
XS1706921951	0,8750 % Esselunga S.p.A. Notes 17/23	EUR	775.000	775.000
XS1706922256	1,8750 % Esselunga S.p.A. Notes 17/27	EUR	1.225.000	1.225.000
EU000A1GODY0	0,8750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/27	EUR	6.800.000	6.800.000
EU000A1GODW4	1,8000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/48	EUR	9.300.000	9.300.000
EU000A1GODN3	2,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/56	EUR	6.400.000	6.400.000
BE0001764183	0,3750 % Flämische Gemeinschaft MTN 16/26	EUR	2.300.000	2.300.000
BE0002283522	0,3750 % Flämische Gemeinschaft MTN Tr.2 17/26	EUR	0	2.300.000
XS1040508167	2,2500 % Imperial Brands Finance PLC MTN 14/21	EUR	0	3.000.000
XS1156024116	4,7500 % Intesa Sanpaolo Vita S.p.A. FLR Notes 14/Und. ¹⁾	EUR	0	2.000.000
XS1578294081	1,1250 % Italgas S.P.A. MTN 17/24	EUR	0	3.000.000
BE0000337460	1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.77 16/26	EUR	0	2.000.000
ES0000012157	4,7000 % Königreich Spanien Bonos 09/41	EUR	8.000.000	13.000.000
ES00000127H7	1,1500 % Königreich Spanien Bonos 15/20	EUR	0	6.000.000
ES00000127A2	1,9500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/30	EUR	0	6.000.000
ES00000128C6	2,9000 % Königreich Spanien Obligaciones 16/46	EUR	0	7.250.000
DE000NRWOKF4	1,5500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1439 17/48	EUR	0	5.800.000
DE000NRWOKM0	1,7500 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1445 17/57	EUR	2.825.000	2.825.000
XS1685653302	0,8750 % London Stock Exchange GroupPLC MTN 17/24	EUR	1.725.000	1.725.000
IT0005315046	1,2500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Mortg.Cov.MTN 17/29	EUR	4.550.000	4.550.000
XS1284570626	1,3750 % Merck Financial Services GmbH MTN 15/22	EUR	0	1.000.000
XS1645494375	1,0000 % National Grid North Amer. Inc. MTN 17/24	EUR	1.500.000	1.500.000
XS1673097710	1,6250 % Nederlandse Waterschapsbank NV MTN 17/48	EUR	4.150.000	4.150.000
FI4000261201	1,5000 % Neste Oyj Notes 17/24	EUR	0	2.000.000
XS1707075328	1,2500 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 17/29	EUR	2.450.000	2.450.000
FR0013245586	2,0000 % Peugeot S.A. MTN 17/24	EUR	0	1.300.000
FR0010171975	4,0000 % Rep. Frankreich OAT 05/55	EUR	4.500.000	4.500.000
FR0013250560	1,0000 % Rep. Frankreich OAT 16/27	EUR	9.100.000	21.600.000
FR0013286192	0,7500 % Rep. Frankreich OAT 17/28	EUR	15.000.000	15.000.000
FR0013257524	2,0000 % Rep. Frankreich OAT 17/48	EUR	0	6.000.000
FI4000278551	0,5000 % Republik Finnland Bonds 17/27	EUR	13.000.000	13.000.000

Deka-EuropaBond

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1647481206	2,1500 % Republik Indonesien MTN 17/24 Reg.S	EUR	1.400.000	1.400.000
IE00BV8C9418	1,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 16/26	EUR	6.000.000	6.000.000
IT0005172322	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 16/23	EUR	3.000.000	3.000.000
IT0005177909	2,2500 % Republik Italien B.T.P. 16/36	EUR	0	6.000.000
XS1501554874	0,3750 % Republik Lettland MTN 16/26	EUR	0	1.500.000
AT0000A1XML2	2,1000 % Republik Österreich MTN 17/17	EUR	4.500.000	4.500.000
XS1584894650	1,3750 % Republik Polen MTN 17/27	EUR	0	5.000.000
PTOTETOEO012	2,8750 % Republik Portugal Obr. 16/26	EUR	5.000.000	5.000.000
PTOTEUOE0019	4,1250 % Republik Portugal Obr. 17/27	EUR	26.000.000	26.000.000
SI0002103677	1,7500 % Republik Slowenien Bonds 16/40	EUR	0	6.000.000
SI0002103685	1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27	EUR	1.350.000	9.350.000
XS1637276848	2,7500 % Republik Zypern MTN 17/24	EUR	0	5.600.000
DE000A1R0U23	2,1250 % SAP SE MTN 12/19	EUR	0	2.300.000
XS1327531486	1,6250 % SKF AB Notes 15/22	EUR	0	2.000.000
SK4120010430	1,3750 % Slowakei Anl. 15/27	EUR	0	2.000.000
XS1648462023	2,2500 % SNCF Réseau MTN 17/47	EUR	4.500.000	4.500.000
XS1684385161	3,1250 % SoftBank Group Corp. Notes 17/25	EUR	5.575.000	5.575.000
XS1684385591	4,0000 % SoftBank Group Corp. Notes 17/29	EUR	2.400.000	2.400.000
XS1582205040	1,1250 % Statkraft AS MTN 17/25	EUR	0	2.750.000
XS1698218523	2,3750 % Telecom Italia S.p.A. MTN 17/27	EUR	2.475.000	2.475.000
XS1591694481	2,9950 % TenneT Holding B.V. FLR Securit. 17/Und.	EUR	0	900.000
XS1652866002	1,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA MTN 17/27	EUR	5.450.000	5.450.000
XS1651071877	1,4000 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 17/26	EUR	2.250.000	2.250.000
FR0012881555	2,2000 % Transport et Infrs.Gaz France Obl. 15/25	EUR	0	1.600.000
XS1623404412	0,8500 % U.S. Bancorp MTN 17/24	EUR	0	3.225.000
FR0013246733	1,4960 % Veolia Environnement S.A. MTN 17/26	EUR	0	2.900.000
XS1642590480	1,3750 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 17/25	EUR	6.575.000	6.575.000
GBP				
XS1664647499	2,1250 % B.A.T. Capital Corp. MTN 17/25	GBP	2.300.000	2.300.000
XS1573156681	1,8750 % Deutsche Bank AG MTN 17/20	GBP	0	4.800.000
XS0435179618	7,7500 % Imperial Brands Finance PLC MTN 09/19	GBP	0	1.500.000
XS0451790280	5,7500 % Kon. KPN N.V. MTN 09/29	GBP	0	800.000
HUF				
HU0000402433	6,5000 % Ungarn Bonds S.19/A 08/19	HUF	0	2.000.000.000
HU0000402631	5,5000 % Ungarn Notes S.18/A 13/18	HUF	0	2.250.000.000
HU0000402953	3,5000 % Ungarn Notes S.20/B 14/20	HUF	0	2.500.000.000
RON				
RO1227DBN011	5,8000 % Republik Rumänien Bonds 12/27	RON	30.500.000	30.500.000
RO1722DBN045	3,4000 % Republik Rumänien Bonds 17/22	RON	21.000.000	21.000.000
SEK				
SE0003784461	3,5000 % Königreich Schweden Obl. Nr.1054 11/22	SEK	100.000.000	100.000.000
SE0004517290	2,2500 % Königreich Schweden Obl. Nr.1056 12/32	SEK	105.000.000	140.000.000
SE0004869071	1,5000 % Königreich Schweden Obl. Nr.1057 11/23	SEK	0	55.000.000
TRY				
TRT140218T10	6,3000 % Republik Türkei Bonds 13/18	TRY	0	27.000.000
TRT100719T18	8,5000 % Republik Türkei Bonds 14/19	TRY	0	10.000.000
USD				
USU05526AK11	3,5570 % B.A.T. Capital Corp. Notes 17/27 Reg.S	USD	7.450.000	7.450.000
USU05526AM76	4,5400 % B.A.T. Capital Corp. Notes 17/47 Reg.S	USD	2.175.000	2.175.000
XS0995679619	5,8750 % Republik Serbien Treasury Bonds 13/18 Reg.S	USD	0	2.500.000
US900123CM05	5,7500 % Republik Türkei Notes 17/47	USD	2.400.000	2.400.000
USH4209UAG16	2,8590 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG FLR Notes 17/23 R.S	USD	3.650.000	3.650.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
ES0200002022	0,8000 % Adif - Alta Velocidad Obl. 17/23	EUR	0	6.000.000
IT0005277451	0,8750 % Bco di Desio e della Brianza Mortg.Cov. MTN 17/24	EUR	2.750.000	2.750.000
PTCMGTOM0029	0,8750 % Caixa Económica Montepio Geral MT Obr. Hip. 17/22	EUR	3.000.000	3.000.000
XS1614722806	1,1250 % Caixabank S.A. MTN 17/24	EUR	0	3.400.000
XS1468525057	2,3750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 16/24	EUR	0	1.800.000
XS1616917800	1,3750 % CNH Industrial Finance Euro.SA MTN 17/22	EUR	0	2.750.000
XS1693959931	2,1250 % CPI PROPERTY GROUP S.A. MTN 17/24	EUR	2.250.000	2.250.000
XS1677912393	1,8750 % Fastighets AB Balder Notes 17/26	EUR	2.200.000	2.200.000
XS1640492994	1,1000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 17/24	EUR	0	2.950.000
XS1314238459	2,7500 % Iren S.p.A. MTN 15/22	EUR	0	650.000
XS1198103456	3,0000 % Mexiko MTN 15/45	EUR	0	2.200.000
XS1369323149	3,3750 % Mexiko MTN 16/31	EUR	0	2.500.000
XS1486520403	1,0000 % Nordea Bank AB FLR MTN 16/26	EUR	0	1.000.000
XS1691349952	2,0650 % NorteGas Energia Distribuc.SAU MTN 17/27	EUR	3.050.000	3.050.000
XS1264601805	1,1000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/18	EUR	0	2.000.000
XS1617859464	1,0000 % Swedbank AB FLR MTN 17/27	EUR	0	3.600.000
XS1580469895	4,4500 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. FLR MTN 17/27	EUR	0	2.050.000

Deka-EuropaBond

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
PLN				
PL0000109492	2,2500 % Republik Polen Bonds S.0422 16/22	PLN	0	40.000.000
PL0000105441	5,5000 % Republik Polen Bonds S.1019 08/19	PLN	0	25.000.000
RUB				
RU000A0JXFM1	7,7000 % Russische Föderation Bonds S.26221RMFS 17/33	RUB	510.000.000	510.000.000
USD				
XS1577950402	4,2150 % Coca Cola Icecek A.S. Bonds 17/24 Reg.S	USD	1.125.000	1.125.000
USP3143NAY06	3,6250 % Corp.Nacion.del Cobre de Chile Notes 17/27 Reg.S	USD	4.500.000	4.500.000
USN6945AAK36	5,9990 % Petrobras Global Finance B.V. Notes 17/28 Reg.S	USD	6.925.000	6.925.000
XS1496463297	5,3750 % Türkiye Ihracat Kredi Bankasi Bonds 16/23 Reg.S	USD	0	7.700.000
XS1577952952	7,3750 % Ukraine Notes 17/32 Reg.S	USD	2.575.000	2.575.000
Geldmarktpapiere				
NOK				
NO0010779598	1,3000 % Stadt Oslo Cert. of Dep. 16/17	NOK	0	65.000.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 10 Year US Treasury Notes (10,0), Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Euro Buxl Futures (30,0), Euro Schatz (2,0), Long Gilt (10,0))	EUR	1.375.021
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 10 Year US Treasury Notes (10,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Euro Buxl Futures (30,0), EuroBTP Italian Gov. (10,0), EuroOAT French Gov. Bond (10,0), Long Gilt (10,0))	EUR	1.125.665
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Swaps (Swaptions)		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): SWP Long Pay ITraxxECr28 MOST_LDN 20.12.2017)	EUR	213
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	57.050
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))	EUR	602.285
Währungsderivate		
Optionsrechte auf Devisen-Derivate		
Optionsrechte auf Devisen		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):		
AUD/NZD	EUR	256
AUD/USD	EUR	205
EUR/PLN	EUR	220
EUR/USD	EUR	417
GBP/USD	EUR	126
USD/CAD	EUR	157
USD/JPY	EUR	135
USD/KRW	EUR	872
USD/TRY	EUR	256
USD/TWD	EUR	263
USD/ZAR	EUR	419
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):		
AUD/JPY	EUR	274
EUR/NOK	EUR	253
EUR/SEK	EUR	292
EUR/USD	EUR	161
GBP/USD	EUR	812
USD/INR	EUR	196
USD/JPY	EUR	491
Verkaufte Kaufoptionen (Call):		
USD/KRW	EUR	150
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	27.542
AUD/JPY	EUR	75.730
AUD/NZD	EUR	131.967
AUD/USD	EUR	43.560
CAD/EUR	EUR	20.805
CAD/USD	EUR	23.975
CHF/EUR	EUR	32.815
CZK/EUR	EUR	125.846
DKK/EUR	EUR	25.205

Deka-EuropaBond

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
GBP/EUR	EUR	311.559
GBP/USD	EUR	166.136
HKD/EUR	EUR	13
HKD/USD	EUR	33.728
HUF/EUR	EUR	97.435
INR/USD	EUR	253.957
JPY/EUR	EUR	40.451
JPY/USD	EUR	224.366
KRW/USD	EUR	213.481
NOK/EUR	EUR	200.127
NOK/USD	EUR	22.838
NZD/EUR	EUR	11.310
NZD/USD	EUR	33.129
PLN/EUR	EUR	159.239
RON/EUR	EUR	9.560
RUB/USD	EUR	56.943
SEK/EUR	EUR	327.465
TRY/EUR	EUR	24.156
TRY/USD	EUR	26.894
USD/EUR	EUR	260.704
ZAR/EUR	EUR	805
ZAR/USD	EUR	89.693
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	26.235
AUD/JPY	EUR	76.309
AUD/NZD	EUR	141.286
AUD/USD	EUR	53.050
CAD/EUR	EUR	1.511
CAD/USD	EUR	42.568
CHF/EUR	EUR	24.046
CZK/EUR	EUR	96.549
DKK/EUR	EUR	22.506
GBP/EUR	EUR	242.136
GBP/USD	EUR	158.684
HKD/USD	EUR	25.296
HUF/EUR	EUR	68.637
INR/USD	EUR	254.072
JPY/EUR	EUR	40.022
JPY/USD	EUR	223.545
KRW/USD	EUR	224.503
NOK/EUR	EUR	211.622
NOK/USD	EUR	7.080
NZD/AUD	EUR	17.665
NZD/EUR	EUR	11.136
NZD/USD	EUR	24.063
PLN/EUR	EUR	201.782
RON/EUR	EUR	9.456
RUB/USD	EUR	56.915
SEK/EUR	EUR	224.023
TRY/EUR	EUR	15.708
TRY/USD	EUR	28.234
USD/EUR	EUR	275.414
ZAR/EUR	EUR	229
ZAR/USD	EUR	91.133
Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)		
Credit Default Swaps (CDS)		
Protection Buyer:	EUR	37.000
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S27 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S28 V1 5Y, CDS Volkswagen AG13 9BAEC8)		
Protection Seller:	EUR	15.000
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S28 V1 5Y)		
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	730.847
(Basiswert(e): 0,0000 % Königreich Niederlande Anl. 17/24, 0,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 17/22, 0,2000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.79 16/23, 0,2500 % Ferrari N.V. Notes 17/21, 0,3210 % Asahi Group Holdings Ltd. Notes 17/21, 0,3750 % Republik Lettland MTN 16/26, 0,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 17/27, 0,5000 % Republik Finnland Bonds 17/27, 0,5000 % Vodafone Group PLC MTN 16/24, 0,6250 % Auchan Holding S.A. MTN 17/22, 0,6250 % Kon. KPN N.V. MTN 16/25, 0,6250 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 17/24, 0,7500 % Königreich Spanien Bonos 16/21, 0,7500 % LeasePlan Corporation N.V. MTN 17/22, 0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 17/24, 0,7500 % Rep. Frankreich OAT 17/28, 0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25, 0,8750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Notes 17/24, 0,8750 % Esselunga S.p.A. Notes 17/23, 0,8750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/27, 0,8750 % Vivendi S.A. MTN 17/24, 0,9500 % ArcelorMittal S.A. MTN 17/23, 1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. MTN 16/21, 1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.77 16/26, 1,0000 % National Grid North Amer. Inc. MTN 17/24, 1,0000 % Nordea Bank AB FLR MTN 16/26, 1,0000 % Rep. Frankreich OAT 16/27, 1,0000 % Swedbank AB FLR MTN 17/27, 1,1250 % B.A.T. Capital Corp. MTN 17/23, 1,1250 % BNP Paribas S.A. MTN 16/23, 1,1250 % CaixaBank S.A. MTN 17/24, 1,1250 % Commerzbank AG MTN Anl. S.883 17/24, 1,1250 % Santander UK Group Hldgs PLC MTN 16/23, 1,1500 % Königreich		

Deka-EuropaBond

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<p>Spanien Bonos 15/20, 1,2500 % Autoroutes du Sud de la France MTN 17/27, 1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27, 1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG MTN 16/26, 1,3750 % Nationwide Building Society MT Mortg.Cov.Bds 17/32, 1,3750 % Republik Polen MTN 17/27, 1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken FLR MTN 16/28, 1,3750 % Slowakei Anl. 15/27, 1,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA MTN 17/27, 1,3750 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 17/25, 1,4000 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 17/26, 1,4130 % Sumitomo Mitsui Financ. Group MTN 17/27, 1,4500 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/40, 1,4500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.84 17/37, 1,4500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/27, 1,5000 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 17/25, 1,5000 % British Telecommunications PLC MTN 17/27, 1,5000 % ENI S.p.A. MTN 17/27, 1,5000 % Volkswagen Fin. Services N.V. MTN 17/21, 1,6250 % Solvay S.A. Notes 15/22, 1,7500 % Babcock International Grp PLC MTN 14/22, 1,7500 % NE Property Coöperatief U.A. MTN 17/24, 1,7500 % Rep. Frankreich OAT 17/39, 1,7500 % Republik Slowenien Bonds 16/40, 1,7500 % Ungarn Bonds 17/27, 1,8000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/48, 1,8750 % Deutsche Bank AG MTN 17/20, 1,8750 % Edenred S.A. Notes 17/27, 1,8750 % Esselunga S.p.A. Notes 17/27, 1,8750 % Slowakei MTN 17/37, 1,8750 % Soc.Autorout.Nord-l'Est France Obl. 15/26, 1,9500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/30, 2,0000 % Barclays PLC FLR MTN 17/28, 2,0000 % ITV PLC Notes 16/23, 2,0000 % Nordea Bank AB MTN 14/21, 2,0000 % Rep. Frankreich OAT 17/48, 2,2000 % Transport et Infrast.Gaz France Obl. 15/25, 2,3500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/33, 2,3750 % Cellnex Telecom S.A. MTN 16/24, 2,3750 % Republik Rumänien MTN 17/27 Reg.S, 2,5000 % Rep. Frankreich OAT 14/30, 2,5000 % Republik Polen Bonds S.0727 16/27, 2,7500 % Davide Campari-Milano S.p.A. Notes 15/20, 2,7500 % Iren S.p.A. MTN 15/22, 2,7500 % Republik Kroatien Notes 17/30, 2,7500 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 17/22, 2,9000 % Königreich Spanien Obligaciones 16/46, 3,2500 % Republik Polen Bonds S.0725 14/25, 3,5000 % BBVA Sub.Capital S.A.U. FLR MTN 14/24, 3,5000 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 17/29, 3,5000 % ING Bank N.V. MTN 13/23, 3,9410 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und., 4,0000 % Commerzbank AG Nachr. MTN S.865 16/26, 4,0000 % Commerzbank AG T2 Nachr. MTN S.874 17/27, 4,0000 % Rep. Frankreich OAT 05/55, 4,0000 % Republik Polen Bonds S.1023 12/23, 4,1250 % Republik Portugal Obr. 17/27, 4,7000 % Königreich Spanien Bonos 09/41, 5,0000 % Hannover Finance (Lux.) S.A. FLR Notes 12/43, 5,2500 % Republik Polen Bonds S.1020 10/20, 5,3750 % Türkiye İhracat Kredi Bankası Bonds 16/23 Reg.S, 5,7500 % Republik Polen Bonds S.1021 11/21, 7,7500 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN S.774 11/21, 7,7500 % Imperial Brands Finance PLC MTN 09/19)</p>		

Deka-EuropaBond

Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF	STK	2.117.396
Umlaufende Anteile Klasse TF	STK	15.194.332
Umlaufende Anteile Klasse AV	STK	14.500
Anteilwert Klasse CF	EUR	113,68
Anteilwert Klasse TF	EUR	41,64
Anteilwert Klasse AV	EUR	100,21

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen / Investmentanteile

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate

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

Bankguthaben

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

Derivate

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

Sonstiges

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

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	84.704.563,98	9,68

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	51.841.657,45	Deutschland
Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme	32.862.906,53	Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	84.704.563,98

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

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

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

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

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

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

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

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

Deka-EuropaBond

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

Restlaufzeit 1-7 Tage
unbefristet

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

33.879.388,20
61.452.898,00

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

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds
Kostenanteil des Fonds
Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

96.492,76
47.204,98
47.204,98

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00
48,92
48,92

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 Bruttoleiheinsatz.

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.

Verleihe Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

10,18% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds")

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

Wertpapier-Darlehen

BNP Paribas S.A.

Erste Abwicklungsanstalt

FMS Wertmanagement

Fresenius SE & Co. KGaA

Berlin Hyp AG

Diageo Finance PLC

Nordrhein-Westfalen, Land

Essity AB

Philip Morris International Inc.

SpareBank 1 Boligkreditt AS

absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR

16.087.267,50
15.801.324,15
7.828.034,04
6.853.823,10
6.404.796,40
4.729.431,01
3.465.201,72
3.141.145,07
1.977.621,76
1.589.437,93

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

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

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer

Clearstream Banking Frankfurt

Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus

J.P.Morgan AG Frankfurt

3
34.196.597,04 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
33.879.388,20 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
27.256.300,96 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

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

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten/Depots

Sammelkonten/Depots

andere Konten/Depots

Verwahrt bestimmt Empfänger

0,00%
0,00%
0,00%
0,00%

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

Frankfurt am Main, den 2. Januar 2018
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 gestalten-
de Deka-FondsSparplan ab einer Mindestanlage von 25,– Euro. Im Rahmen eines auf die eigenen Bedürfnisse abgestimmten Deka-Auszahlplans lässt sich das so aufgebaute Vermögen später gezielt nutzen.
- Für alle, die regelmäßig für ein Kind sparen möchten, ist der Deka-JuniorPlan besonders geeignet. Mit Beträgen ab monatlich 25,– Euro wird für den Vermögensaufbau chancenreich und breit gestreut in Investmentfonds angelegt und dank eines professionellen Anlagemanagements langfristig hohe Ertragsmöglichkeiten genutzt sowie Risiken im Vergleich zu Anlagen in Einzeltiteln spürbar reduziert.

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

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

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

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

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben

gezeichnetes und
eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.
(Stand: 31. Dezember 2016)

Alleingesellschafterin

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Rüdiger

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

Mitglied des Aufsichtsrates der
Deka Immobilien GmbH,
Frankfurt am Main

und der

Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin

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;

Mitglied des Aufsichtsrates der
S Broker Management AG,
Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der
Ostsächsischen Sparkasse Dresden,
Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse,
Münster

Peter Scherkamp, München

(Stand 01. Januar 2018)

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)

Vorsitzender des Aufsichtsrates der
Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin

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

Vorsitzender des Aufsichtsrats der
Deka International S.A.,
Luxemburg

und der

International Fund Management S.A.,
Luxemburg

Steffen Selbach

Mitglied des Aufsichtsrates der
bevestor GmbH,
Frankfurt am Main

(Stand 01. Januar 2018)

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sonder- vermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squire
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Eigenkapital

gezeichnetes und eingezahltes

Kapital: EUR 447,9 Mio.

Eigenmittel: EUR 5.366 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2016)

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft
sowie Wertpapiergeschäft

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