

# Halbjahresbericht zum 30. Juni 2019. Frankfurter-Sparrent Deka

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

Verwaltungsgesellschaft: Deka Investment GmbH

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2019

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Frankfurter-Sparrent Deka für den Zeitraum vom 1. Januar 2019 bis zum 30. Juni 2019.

Das abgelaufene Berichtshalbjahr war geprägt von einer starken Aufwärtsbewegung an den internationalen Aktienmärkten, an der auch die europäischen Börsen partizipierten. Wenig beeindruckt von den global schwelenden Handelskonflikten verlieh die Aussicht auf weitere geldpolitische Lockerungen durch die EZB und US-Notenbank den Kapitalmärkten neue Impulse. Auf nationaler Ebene wurde die Entwicklung auch nicht durch die Abkühlung des ifo Geschäftsklimas beeinträchtigt.

Aus der Erwartung sinkender Zinsen resultierten eine erfreuliche Entwicklung am Rentenmarkt und deutlich nachgebende Renditen. US-Treasuries mit 10-jähriger Laufzeit rentierten zum Ende des Berichtszeitraums mit nur noch 2,0 Prozent. Die Rendite laufzeitgleicher Bundesanleihen bewegte sich seit Anfang Mai durchgehend im negativen Bereich und sank zuletzt auf minus 0,3 Prozent.

Politische Unsicherheiten beeindruckten die Aktienmärkte auf Halbjahressicht nur kurzfristig. An der Wall Street erreichte der marktbreite S&P 500 im Juni ein neues Rekordhoch. Auch die Märkte in Europa verzeichneten kontinuierliche Kurssteigerungen. Der Nikkei 225 in Japan folgte in geringerer Ausprägung dem positiven Gesamttrend.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



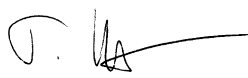
Stefan Keitel (Vorsitzender)



Dr. Ulrich Neugebauer  
(stv. Vorsitzender)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2019	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2019	7
Anhang	17
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	18

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

# Frankfurter-Sparinrent Deka Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Frankfurter-Sparinrent Deka ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, überwiegend in verzinsliche Wertpapiere zu investieren. Anleihen europäischer Aussteller bilden den Anlageschwerpunkt. Dabei werden insbesondere Unternehmensanleihen, Anleihen öffentlicher Aussteller (z.B. Staatsanleihen) sowie besicherte verzinsliche Wertpapiere (z.B. Pfandbriefe und Covered Bonds) erworben. Das Fondsmanagement investiert darüber hinaus auch in fremde Währungen und globale Anleihen (auch aus Schwellenländern/Emerging Markets). Es werden auch Anleihen von Ausstellern beigemischt, die eine geringere Schuldnerqualität aufweisen. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden. Dieser Fonds darf mehr als 35 Prozent des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland sowie des Landes Hessen investieren.

Das Fondsmanagement hat in der Berichtsperiode die Rentenanlagen etwas erhöht. Ein Schwerpunkt lag dabei weiterhin auf Unternehmensanleihen, die teilweise über besondere Ausstattungsmerkmale verfügten. Das Engagement in Corporate Bonds wurde dabei im Laufe der Berichtsperiode geringfügig zurückgenommen. Zum Stichtag umfasste der Bestand rund 42,3 Prozent des Fondsvolumens.

Der Bestand an Staatsanleihen erfuhr hingegen per saldo eine leichte Aufstockung auf zuletzt 25,3 Prozent vom Fondsvolumen. Daneben befanden sich weiterhin Pfandbriefe und Anleihen halbstaatlicher Emittenten im Bestand. Zur Steuerung des Portfolios kamen zudem Renten- und Zins-Derivate (z.B. Optionen, Zinsterminkontrakte) sowie Credit Default Swaps und Zinsswaps zum Einsatz. Die Zinssensitivität des Portfolios (Duration) wurde aktiv gesteuert.

In der Länderstruktur führte zum Stichtag Spanien vor Deutschland und Portugal die Aufstellung an. Über den Einsatz von Devisentermingeschäften wurden Währungskursrisiken partiell abgesichert oder aktive Positionierungen in Fremdwährungen vorgenommen.

Frankfurter-Sparinrent Deka verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 3,3 Prozent. Der Anteilpreis lag zuletzt bei 52,00 Euro.

## Wichtige Kennzahlen

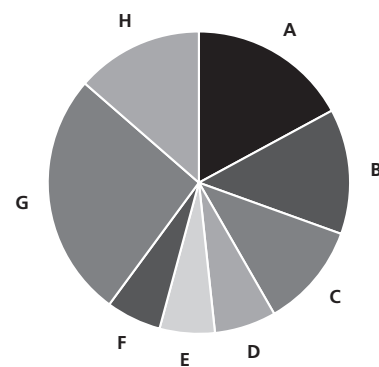
### Frankfurter-Sparinrent Deka

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	3,3%	1,6%	1,1%
<b>ISIN</b>	DE0008479981		

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

## Fondsstruktur

### Frankfurter-Sparinrent Deka



<b>A</b>	Spanien	17,1%
<b>B</b>	Deutschland	13,4%
<b>C</b>	Portugal	11,2%
<b>D</b>	Tschechien	6,6%
<b>E</b>	Italien	5,9%
<b>F</b>	Frankreich	5,9%
<b>G</b>	Sonstige Länder	26,3%
<b>H</b>	Barreserve, Sonstiges	13,6%

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

# Frankfurter-Sparinrent Deko

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2019.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>33.523.727,89</b>	<b>89,41</b>
Belgien	558.414,00	1,49
Brasilien	90.256,43	0,24
Dänemark	357.152,00	0,96
Deutschland	4.992.906,90	13,32
Frankreich	2.186.667,50	5,83
Großbritannien	507.334,00	1,35
Indonesien	216.820,00	0,58
Irland	1.186.427,25	3,17
Italien	2.441.315,96	6,51
Kroatien	664.858,52	1,77
Litauen	313.796,00	0,84
Luxemburg	637.189,95	1,70
Mazedonien	232.155,00	0,62
Mexiko	157.162,50	0,42
Niederlande	1.518.460,02	4,05
Norwegen	304.521,00	0,81
Österreich	869.986,09	2,33
Polen	836.625,13	2,23
Portugal	4.135.568,26	11,02
Rumänien	165.750,00	0,44
Russische Föderation	214.250,00	0,57
Schweden	305.034,00	0,81
Slowakei	205.252,00	0,55
Sonstige	580.492,18	1,55
Spanien	6.370.552,52	16,98
Tschechische Republik	2.439.714,48	6,51
Türkei	309.021,00	0,82
USA	496.695,20	1,33
Zypern	229.350,00	0,61
<b>2. Derivate</b>	<b>-602.488,65</b>	<b>-1,59</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>4.446.169,90</b>	<b>11,87</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>2.459.988,10</b>	<b>6,57</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-2.349.650,69</b>	<b>-6,26</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>37.477.746,55</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>33.523.727,89</b>	<b>89,41</b>
CHF	570.011,66	1,52
CZK	1.291.039,48	3,44
EUR	29.750.741,56	79,35
GBP	671.610,56	1,79
USD	1.240.324,63	3,31
<b>2. Derivate</b>	<b>-602.488,65</b>	<b>-1,59</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>4.446.169,90</b>	<b>11,87</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>2.459.988,10</b>	<b>6,57</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-2.349.650,69</b>	<b>-6,26</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>37.477.746,55</b>	<b>100,00</b>

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

# Frankfurter-Sparinrent Deka

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2019.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>29.151.430,87</b>	<b>77,75</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>29.151.430,87</b>	<b>77,75</b>
<b>EUR</b>								<b>25.846.850,31</b>	<b>68,94</b>
XS1799545329	1,8750 % ACS Servicios Comun.y Ener.SL MTN 18/26	EUR		400.000	0	100.000	% 102,463	409.852,00	1,09
XS1843441491	1,5000 % ADLER Real Estate AG Anl. 19/22	EUR		200.000	200.000	0	% 101,210	202.419,00	0,54
XS2008921947	0,6250 % Aegon Bank N.V. Non-Preferred Nts 19/24	EUR		150.000	150.000	0	% 100,715	151.071,75	0,40
FR0013426368	1,1250 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 19/34	EUR		200.000	300.000	100.000	% 101,649	203.298,00	0,54
XS1799975765	1,5000 % AIB Group PLC MTN 18/23	EUR		300.000	0	200.000	% 102,705	308.115,00	0,82
XS2003442436	1,2500 % AIB Group PLC MTN 19/24	EUR		200.000	350.000	150.000	% 100,999	201.997,00	0,54
XS1325125158	4,1250 % Allied Irish Banks PLC FLR MTN 15/25	EUR		100.000	100.000	0	% 104,836	104.836,00	0,28
XS1678372472	0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Non-Pref. MTN 17/22	EUR		300.000	0	0	% 101,835	305.503,50	0,82
XS2013745703	1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Non-Pref. MTN 19/26	EUR		200.000	200.000	0	% 101,545	203.090,00	0,54
PTBCPWOM0034	4,5000 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR MT Obl. 17/27	EUR		100.000	200.000	100.000	% 101,500	101.500,00	0,27
XS1876076040	1,6250 % Banco de Sabadell S.A. MTN 18/24	EUR		300.000	100.000	0	% 103,589	310.767,00	0,83
XS1991397545	1,7500 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR		100.000	300.000	200.000	% 101,722	101.722,00	0,27
XS1557268221	1,3750 % Banco Santander S.A. 2nd Ranking Notes 17/22	EUR		400.000	0	0	% 103,445	413.778,00	1,10
XS1872038218	1,3750 % Bank of Ireland Group PLC MTN 18/23	EUR		175.000	0	100.000	% 102,105	178.683,75	0,48
XS2002496409	3,1250 % BayWa AG Notes 19/24	EUR		225.000	225.000	0	% 102,875	231.468,75	0,62
DE000A2YNQW7	4,5000 % Bilfinger SE Anl. 19/24	EUR		200.000	200.000	0	% 104,823	209.645,00	0,56
DE0001135226	4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 03/34	EUR		300.000	350.000	500.000	% 173,752	521.254,50	1,39
DE0001135366	4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 08/40	EUR		180.000	180.000	0	% 197,748	355.946,40	0,95
DE0001102374	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25	EUR		250.000	0	0	% 106,424	266.058,75	0,71
DE0001102440	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 18/28	EUR		900.000	0	0	% 108,027	972.243,00	2,60
PTCMGTOM0029	0,8750 % Caixa Económica Montepio Geral MT Obr. Hip. 17/22	EUR		300.000	0	0	% 102,612	307.836,00	0,82
XS1897489578	1,7500 % Caixaabank S.A. Non-Preferred MTN 18/23	EUR		400.000	200.000	0	% 104,341	417.364,00	1,11
XS1991190361	1,5000 % Ceske Drah AS Notes 19/26	EUR		250.000	250.000	0	% 103,288	258.218,75	0,69
XS1529934801	1,4230 % CETIN Finance B.V. MTN 16/21	EUR		400.000	0	0	% 102,897	411.588,00	1,10
XS0940293763	3,0000 % CEZ AS MTN 13/28	EUR		250.000	250.000	0	% 115,045	287.611,25	0,77
XS1912656375	0,8750 % CEZ AS MTN 18/22	EUR		200.000	0	0	% 102,533	205.065,00	0,55
DE000CB83CF0	7,7500 % Commerzbank AG LT2 Nachr. MTN S.774 11/21	EUR		200.000	0	0	% 112,532	225.064,00	0,60
DE000CZ40N46	1,1250 % Commerzbank AG MTN Anl. S.932 19/26	EUR		300.000	300.000	0	% 100,643	301.929,00	0,81
DE000CZ40M21	0,5000 % Commerzbank AG MTN IHS S.903 18/23	EUR		200.000	0	275.000	% 101,353	202.705,00	0,54
DE000CZ40NM2	0,5000 % Commerzbank AG MTN IHS S.920 18/21	EUR		100.000	0	300.000	% 101,413	101.412,50	0,27
DE000CZ40N04	0,6250 % Commerzbank AG MTN IHS S.928 19/24	EUR		225.000	225.000	0	% 101,792	229.032,00	0,61
XS1943474483	0,6250 % Corporación Andina de Fomento MTN 19/24	EUR		400.000	400.000	0	% 100,884	403.536,00	1,08
XS2016807864	0,5000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Non-Pref. MTN 19/24	EUR		300.000	300.000	0	% 100,336	301.006,50	0,80
FR0011318120	3,5000 % Crédit Agricole S.A. Obligations 12/22	EUR		300.000	0	0	% 111,332	333.994,50	0,89
XS1957541953	1,3750 % Danske Bank AS Non-Preferred MTN 19/22	EUR		200.000	200.000	0	% 102,388	204.776,00	0,55
DE000A2LQNG6	0,7500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35304 19/23	EUR		200.000	200.000	0	% 101,784	203.567,00	0,54
PTEDPUOM0024	5,3750 % EDP - Energias de Portugal SA FLR Securities 15/75	EUR		300.000	0	0	% 107,875	323.625,00	0,86
FR0013368545	2,0000 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 18/30	EUR		100.000	0	200.000	% 111,038	111.038,00	0,30
FR0013428513	1,3750 % Engie S.A. MTN 19/39	EUR		300.000	300.000	0	% 101,334	304.000,50	0,81
XS1811024543	1,6590 % EP Infrastructure a.s. Notes 18/24	EUR		400.000	200.000	0	% 99,445	397.780,00	1,06
BE0001784389	1,5000 % Flämische Gemeinschaft MTN 18/38	EUR		300.000	0	0	% 112,245	336.735,00	0,90
BE0001790444	1,5000 % Flämische Gemeinschaft MTN 19/44	EUR		200.000	200.000	0	% 110,840	221.679,00	0,59
XS1554373677	2,1250 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/27 3	EUR		100.000	0	100.000	% 109,012	109.012,00	0,29

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS1936208419	2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 19/29		EUR	200.000	200.000	0	% 114,327	228.654,00	0,61
PTGALLOM0004	1,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 17/23		EUR	300.000	100.000	100.000	% 101,375	304.125,00	0,81
XS0449850980	4,9000 % Generalitat de Catalunya MTN 09/21		EUR	250.000	0	0	% 108,006	270.015,00	0,72
ES0000095879	4,2200 % Generalitat de Catalunya Obl. 05/35		EUR	200.000	200.000	0	% 120,453	240.906,00	0,64
PTCPEDOM0000	4,2500 % Infraestruturas de Portugal SA Bonds 06/21		EUR	300.000	0	0	% 109,670	329.010,00	0,88
XS1576220484	0,7500 % ING Groep N.V. MTN 17/22		EUR	200.000	0	0	% 102,054	204.108,00	0,54
XS1873219304	2,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MT Preferred Nts 18/23		EUR	200.000	200.000	0	% 105,013	210.025,00	0,56
XS1330300341	1,1250 % ISS Global A/S MTN 15/21		EUR	150.000	0	0	% 101,584	152.376,00	0,41
XS1960248919	1,0900 % JPMorgan Chase & Co. FLR MTN 19/27		EUR	200.000	300.000	100.000	% 103,292	206.583,00	0,55
ES0000012F43	0,6000 % Königreich Spanien Bonos 19/29		EUR	200.000	340.000	140.000	% 101,516	203.032,00	0,54
ES0000012E69	1,8500 % Königreich Spanien Bonos 19/35		EUR	500.000	600.000	100.000	% 114,336	571.680,00	1,53
ES0000012852	0,6500 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 17/27		EUR	200.000	200.000	0	% 115,920	231.840,17	0,62
ES0000012A89	1,4500 % Königreich Spanien Obligaciones 17/27		EUR	100.000	0	0	% 109,990	109.990,00	0,29
DE000A2DAR65	0,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 17/27		EUR	400.000	150.000	0	% 106,323	425.290,00	1,13
DE000A2LQSN2	0,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 19/29		EUR	200.000	600.000	400.000	% 107,509	215.018,00	0,57
XS1646530565	2,0000 % Lietuvos energija UAB MTN 17/27		EUR	200.000	200.000	0	% 106,017	212.034,00	0,57
XS1876097715	1,0580 % mBank S.A. MTN 18/22		EUR	325.000	0	0	% 101,739	330.650,13	0,88
XS1769041192	1,3750 % Novartis Finance S.A. Notes 18/30		EUR	225.000	0	0	% 108,128	243.286,88	0,65
XS1729879822	1,3750 % Prosegur Cash S.A. MTN 17/26		EUR	200.000	100.000	0	% 101,187	202.373,00	0,54
XS1432493879	2,6250 % Republik Indonesien MTN 16/23 Reg.S		EUR	200.000	200.000	0	% 108,410	216.820,00	0,58
IT0004848831	5,5000 % Republik Italien B.T.P. 12/22		EUR	200.000	200.000	0	% 115,078	230.156,00	0,61
IT0004953417	4,5000 % Republik Italien B.T.P. 13/24		EUR	100.000	300.000	200.000	% 114,633	114.632,50	0,31
IT0005344335	2,4500 % Republik Italien B.T.P. 18/23		EUR	300.000	300.000	0	% 105,397	316.191,00	0,84
IT0005366007	1,0000 % Republik Italien B.T.P. 19/22		EUR	500.000	500.000	0	% 100,636	503.180,00	1,34
IT0005311508	0,7180 % Republik Italien FLR C.C.T. 17/25		EUR	200.000	0	100.000	% 95,165	190.329,00	0,51
XS1117298916	3,0000 % Republik Kroatien Notes 15/25		EUR	200.000	100.000	0	% 114,677	229.354,00	0,61
XS1428088626	3,0000 % Republik Kroatien Notes 17/27		EUR	200.000	200.000	0	% 116,925	233.850,00	0,62
XS2013677864	0,5000 % Republik Litauen MTN 19/29		EUR	100.000	275.000	175.000	% 101,762	101.762,00	0,27
XS1452578591	5,6250 % Republik Mazedonien Bonds 16/23 Reg.S		EUR	200.000	200.000	0	% 116,078	232.155,00	0,62
AT0000A1XML2	2,1000 % Republik Österreich MTN 17/17		EUR	250.000	250.000	0	% 155,435	388.587,50	1,04
PTOTESOE0007	4,1000 % Republik Portugal Obl. 06/37		EUR	400.000	600.000	200.000	% 149,870	599.480,00	1,60
PTOTEKOE0011	2,8750 % Republik Portugal Obr. 15/25		EUR	300.000	0	0	% 117,842	353.526,00	0,94
PTOTEBOE0020	4,1000 % Republik Portugal Obr. 15/45		EUR	270.000	270.000	0	% 158,716	428.531,85	1,14
PTOTETOE0012	2,8750 % Republik Portugal Obr. 16/26		EUR	450.000	250.000	0	% 119,369	537.158,25	1,43
PTOTEXOE0024	1,9500 % Republik Portugal Obr. 19/29		EUR	400.000	1.000.000	600.000	% 114,367	457.468,00	1,22
XS1970549561	3,5000 % Republik Rumänien MTN 19/34 Reg.S		EUR	150.000	250.000	100.000	% 110,500	165.750,00	0,44
XS0503454166	5,1250 % Republik Türkei Notes 10/20		EUR	300.000	100.000	0	% 103,007	309.021,00	0,82
XS1457553367	3,7500 % Republik Zypern MTN 16/23		EUR	200.000	0	0	% 114,675	229.350,00	0,61
RU000A0ZVE6	2,8750 % Russische Föderation Notes 18/25 Reg.S		EUR	200.000	200.000	0	% 107,125	214.250,00	0,57
XS1993969515	1,7500 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB MTN 19/25		EUR	300.000	525.000	225.000	% 101,678	305.034,00	0,81
XS1849525057	0,7500 % Santander Bank Polska S.A. MTN 18/21		EUR	500.000	0	0	% 101,195	505.975,00	1,35
XS1781346801	0,7500 % Santander Consumer Bank AS MTN 18/23		EUR	200.000	0	0	% 101,762	203.524,00	0,54
XS1874127902	1,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 18/30		EUR	225.000	0	0	% 107,847	242.654,63	0,65
XS1955187932	1,7500 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 19/39		EUR	200.000	200.000	0	% 110,086	220.172,00	0,59
SK4120014184	2,2500 % Slowakei Anl. 18/68		EUR	160.000	320.000	160.000	% 128,283	205.252,00	0,55
XS1039826422	2,6250 % SNCF Réseau MTN 14/25		EUR	200.000	0	0	% 117,577	235.154,00	0,63
XS1516271290	0,3750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA MTN 16/22		EUR	100.000	0	200.000	% 100,997	100.997,00	0,27
XS1961772560	1,7880 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 19/29		EUR	100.000	500.000	400.000	% 108,134	108.134,00	0,29
XS1575979148	2,0000 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC FLR MTN 17/23		EUR	200.000	0	0	% 103,258	206.515,00	0,55
FR0013332988	1,1250 % Unibail-Rodamco SE MTN 18/25		EUR	100.000	0	0	% 104,895	104.895,00	0,28

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS137486555	2,0000 % UniCredit S.p.A. MTN 16/23		EUR	200.000	200.000	0	% 104,179	208.358,00	0,56
AT0000A27LQ1	1,7500 % voestalpine AG MTN 19/26		EUR	200.000	425.000	225.000	% 102,307	204.613,00	0,55
XS1806457211	0,8750 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 18/23		EUR	100.000	0	0	% 101,200	101.200,00	0,27
<b>CHF</b>								<b>570.011,66</b>	<b>1,52</b>
CH0028622600	2,7500 % Commerzbank Finance&Covered Bd MT Let.d.G.P. 07/22		CHF	300.000	0	0	% 108,500	293.226,07	0,78
CH0025662831	3,3750 % Kommunalkred. Austria AG (NEU) MTN 06/26		CHF	250.000	0	0	% 122,900	276.785,59	0,74
<b>CZK</b>								<b>1.291.039,48</b>	<b>3,44</b>
CZ0001001796	4,2000 % Tschechien Anl. S.49 03/36		CZK	5.000.000	10.000.000	5.000.000	% 134,363	264.170,70	0,70
CZ0001001945	4,7000 % Tschechien Anl. S.55 07/22		CZK	15.000.000	6.000.000	0	% 110,045	649.079,86	1,73
CZ0001004600	0,4500 % Tschechien Bonds S.97 15/23		CZK	10.000.000	0	0	% 96,076	377.788,92	1,01
<b>GBP</b>								<b>671.610,56</b>	<b>1,79</b>
XS0096272355	5,2500 % Königreich Spanien MTN 99/29		GBP	200.000	200.000	0	% 124,706	273.613,35	0,74
XS0089572316	6,0000 % Republik Italien MTN 98/28		GBP	300.000	300.000	0	% 117,991	393.997,21	1,05
<b>USD</b>								<b>771.918,86</b>	<b>2,06</b>
XS2018639539	3,5000 % Black Sea Trade & Developmt Bk Notes 19/24		USD	200.000	200.000	0	% 100,750	176.956,18	0,47
US226775AG97	6,0000 % Republik Kroatien Notes 13/24 144A		USD	200.000	200.000	0	% 114,812	201.654,52	0,54
XS1085735899	5,1250 % Republik Portugal MTN 14/24 Reg.S		USD	400.000	400.000	0	% 111,965	393.308,16	1,05
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>4.097.849,77</b>	<b>10,93</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>4.097.849,77</b>	<b>10,93</b>
<b>EUR</b>								<b>3.629.444,00</b>	<b>9,68</b>
ES0465936054	0,7500 % ABANCA Corporación Bancaria SA Cédulas Hip. 19/29		EUR	300.000	500.000	200.000	% 102,167	306.501,00	0,82
ES0413900558	0,8750 % Banco Santander S.A. Mortg.Cov. MTN 19/31		EUR	200.000	400.000	200.000	% 104,779	209.558,00	0,56
ES0414950644	4,1250 % BANKIA S.A. Cédulas Hip. 06/36		EUR	300.000	0	100.000	% 150,518	451.554,00	1,20
ES0313307219	1,0000 % Bankia S.A. Non-Preferred Bonos 19/24		EUR	100.000	100.000	0	% 100,581	100.580,50	0,27
ES0313307201	0,8750 % Bankia S.A. Preferred Bonos 19/24		EUR	200.000	400.000	200.000	% 101,863	203.726,00	0,54
ES0313679K13	0,8750 % Bankinter S.A. Preferred Bonos 19/24		EUR	100.000	100.000	0	% 102,750	102.750,00	0,27
ES0205045018	1,5000 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 17/23		EUR	400.000	0	0	% 103,268	413.072,00	1,10
ES0305045009	1,3750 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 19/24		EUR	200.000	300.000	100.000	% 102,576	205.151,00	0,55
XS2019976070	0,7500 % Enxsis Holding N.V. MTN 19/31		EUR	100.000	100.000	0	% 100,201	100.200,50	0,27
XS1843434017	0,3750 % Fiserv Inc. Notes 19/23		EUR	100.000	100.000	0	% 100,628	100.628,00	0,27
XS2018637327	1,1250 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 19/27		EUR	100.000	100.000	0	% 100,677	100.677,00	0,27
FR0013430741	0,6250 % Klépierre S.A. MTN 19/30		EUR	400.000	400.000	0	% 98,384	393.536,00	1,05
XS1974394758	2,8750 % Mexiko MTN 19/39		EUR	150.000	275.000	125.000	% 104,775	157.162,50	0,42
XS2021471433	0,3750 % Motability Operations Grp PLC MTN 19/26		EUR	300.000	300.000	0	% 100,273	300.819,00	0,80
FR0013430840	1,6250 % UMG Groupe VYV Obl. 19/29		EUR	200.000	200.000	0	% 99,873	199.745,00	0,53
XS2013626010	1,6250 % Zurich Finance (Ireland) DAC MTN 19/39		EUR	275.000	275.000	0	% 103,194	283.783,50	0,76
<b>USD</b>								<b>468.405,77</b>	<b>1,25</b>
US105756CA66	4,5000 % Brasilien Bonds 19/29		USD	100.000	300.000	200.000	% 102,775	90.256,43	0,24
US29278GAJ76	4,6250 % ENEL Finance Intl N.V. Notes 18/25 144A		USD	200.000	200.000	0	% 107,416	188.665,14	0,50
US912810RW09	0,8750 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 17/47		USD	200.000	200.000	0	% 107,883	189.484,20	0,51
<b>Neuemissionen</b>								<b>274.447,25</b>	<b>0,73</b>
<b>Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen</b>								<b>274.447,25</b>	<b>0,73</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>274.447,25</b>	<b>0,73</b>
<b>EUR</b>								<b>274.447,25</b>	<b>0,73</b>
XS2021993212	1,6250 % UniCredit S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 19/25		EUR	275.000	275.000	0	% 99,799	274.447,25	0,73
<b>Summe Wertpapiervermögen<sup>1)</sup></b>							<b>EUR</b>	<b>33.523.727,89</b>	<b>89,41</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Zins-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>									
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 19		XEUR	EUR	-1.600.000				-7.140,00	-0,02
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 19		XEUR	EUR	-400.000				-7.080,00	-0,02



# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	EURO Buxl Future (FGBX) Sep. 19	XEUR	EUR	-700.000				-12.380,00	-0,03
	EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 19	XEUR	EUR	-400.000				-18.160,00	-0,05
	Long Gilt Future (FLG) Sep. 19	IFEU	GBP	-500.000				-166,96	0,00
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 19	XEUR	EUR	-2.600.000				-50.270,00	-0,13
	<b>Summe Zins-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-95.196,96</b>	<b>-0,25</b>
	<b>Devisen-Derivate</b>								
	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
	<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>							<b>-555,31</b>	<b>0,01</b>
	<b>Offene Positionen</b>								
	CHF/USD 365.742,00		OTC					1.911,31	0,01
	JPY/USD 163.500.000,00		OTC					-786,92	0,00
	NOK/USD 12.975.000,00		OTC					-1.679,70	0,00
	<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>							<b>-339,09</b>	<b>0,00</b>
	<b>Offene Positionen</b>								
	CAD/USD 986.693,00		OTC					-3.103,22	-0,01
	CHF/EUR 558.639,00		OTC					1.269,32	0,00
	CHF/USD 725.737,50		OTC					1.360,92	0,00
	CZK/EUR 30.412.179,00		OTC					-7.418,93	-0,02
	GBP/EUR 600.000,00		OTC					781,57	0,00
	JPY/USD 162.023.978,00		OTC					3.812,25	0,01
	NOK/EUR 2.442.190,00		OTC					99,14	0,00
	NOK/USD 12.772.441,06		OTC					3.252,47	0,01
	NZD/USD 750.000,00		OTC					-2.912,45	0,00
	PLN/EUR 2.052.722,00		OTC					-176,38	0,00
	RON/EUR 1.089.478,00		OTC					529,80	0,00
	USD/EUR 1.410.000,00		OTC					2.166,42	0,01
	<b>Optionsrechte</b>							<b>54.375,57</b>	<b>0,15</b>
	<b>Optionsrechte auf Devisen (Kauf)</b>							<b>54.375,57</b>	<b>0,15</b>
	CALL NZD/PUT USD 0,66500 06/19		OTC NZD	1.500.000			% 0,865	7.642,66	0,02
	CALL USD/PUT JPY 112,00000 11/19		OTC USD	2.000.000			% 0,163	2.858,84	0,01
	PUT GBP/CALL USD 1,22500 08/19		OTC GBP	2.500.000			% 0,085	2.371,12	0,01
	PUT PLN/CALL HUF 75,10000 06/19		OTC PLN	7.000.000			% 0,000	0,00	0,00
	PUT USD/CALL CAD 1,33000 08/19		OTC USD	1.500.000			% 1,840	24.237,89	0,06
	PUT USD/CALL CHF 0,98000 08/19		OTC USD	1.500.000			% 1,311	17.265,06	0,05
	<b>Optionsrechte auf Devisen (Verkauf)</b>							<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
	CALL NZD/PUT USD 0,68500 06/19		OTC NZD	-1.500.000			% 0,000	0,00	0,00
	<b>Summe Devisen-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>53.481,17</b>	<b>0,16</b>
	<b>Swaps</b>								
	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
	<b>Zinsswaps</b>							<b>-412.256,18</b>	<b>-1,10</b>
	<b>(Erhalten/Zahlen)</b>								
	IRS 2.115% USD / LIBUSD03 USD / CITIGMX_LDN 25.11.2026		OTC USD	1.200.000				17.859,74	0,05
	IRS BUBORM06 HUF / 0.899% HUF / JPM_LDN 31.01.2021		OTC HUF	200.000.000				-5.123,91	-0,01
	IRS BUBORM06 HUF / 1.555% HUF / JPM_LDN 14.02.2022		OTC HUF	150.000.000				-11.891,06	-0,03
	IRS EURIBORM03 EUR / 0.383% EUR / DGZ_FRA 30.01.2023		OTC EUR	2.000.000				-60.732,11	-0,16
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.019% EUR / DGZ_FRA 21.10.2022		OTC EUR	2.000.000				-24.545,88	-0,07
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.166% EUR / DGZ_FRA 11.02.2022		OTC EUR	4.000.000				-62.100,66	-0,17
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.277% EUR / DGZ_FRA 29.01.2022		OTC EUR	4.000.000				-75.604,58	-0,20
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.29% EUR / DBK_FRA 21.07.2022		OTC EUR	2.500.000				-58.763,50	-0,16
	IRS EURIBORM06 EUR / 0.473% EUR / GOLDINT_LDN 15.02.2025		OTC EUR	2.900.000				-115.150,27	-0,31
	IRS LIBUSD03 USD / 2.39% USD / CITIGMX_LDN 25.11.2046		OTC USD	500.000				-16.203,95	-0,04
	<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>							<b>-154.514,68</b>	<b>-0,42</b>
	<b>Protection Buyer</b>							<b>-154.514,68</b>	<b>-0,42</b>
	CDS CDX.EM. S26 V2 5Y / CSFBINT_LDN 20.12.2021		OTC USD	600.000				2.366,09	0,01
	CDS CDX.EM. S29 V1 5Y / MERRILL_LDN 20.06.2023		OTC USD	500.000				8.988,72	0,02
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S29 V2 5Y / CITIGMX_LDN 20.06.2023		OTC EUR	400.000				-33.664,07	-0,09
	CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S30 V2 5Y / MERRILL_LDN 20.12.2023		OTC EUR	500.000				-47.914,84	-0,13
	CDS ITRAXX EUROPE S30 V2 5Y / GOLDINT_LDN 20.12.2023		OTC EUR	2.500.000				-59.612,08	-0,16
	CDS Lloyds Bank PLC9730 GLA88B / BNP_LDN 20.06.2021		OTC EUR	600.000				-9.833,34	-0,03
	CDS Statoil ASA MTN / BNP_LDN 20.12.2022		OTC EUR	500.000				-14.845,16	-0,04
	<b>Optionsrechte</b>								
	<b>Optionsrechte auf Credit Default Swaps (CDS)</b>							<b>5.998,00</b>	<b>0,02</b>
	<b>Payer Swap</b>							<b>5.998,00</b>	<b>0,02</b>

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
SWP Long Pay CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S31 V1 5Y_275_CITIGMX_LDN_17.07.2019		OTC	EUR	2.000.000			% 0,375	7.500,00	0,02
SWP Short Pay CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S31 V1 5_325_CITIGMX_LDN_17.07.2019		OTC	EUR	-2.000.000			% 0,075	-1.502,00	0,00
<b>Summe Swaps</b>							<b>EUR</b>	<b>-560.772,86</b>	<b>-1,50</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			EUR	4.392.520,35			% 100,000	4.392.520,35	11,73
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			HUF	0,28			% 100,000	0,00	0,00
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			NOK	0,01			% 100,000	0,00	0,00
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			SEK	5.194,80			% 100,000	491,96	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			SGD	0,01			% 100,000	0,01	0,00
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			TRY	0,75			% 100,000	0,11	0,00
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			USD	60.530,24			% 100,000	53.157,32	0,14
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			ZAR	2,38			% 100,000	0,15	0,00
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>4.446.169,90</b>	<b>11,87</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>4.446.169,90</b>	<b>11,87</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche			EUR	270.567,61				270.567,61	0,72
Forderungen aus Wertpapiergeschäften			EUR	1.926.582,82				1.926.582,82	5,15
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	2.837,67				2.837,67	0,01
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	260.000,00				260.000,00	0,69
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>2.459.988,10</b>	<b>6,57</b>
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>									
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			CHF	-8.437,50			% 100,000	-7.600,91	-0,02
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			JPY	-1,00			% 100,000	-0,01	0,00
<b>Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale			GBP	-110.970,58			% 100,000	-123.518,17	-0,33
<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-131.119,09</b>	<b>-0,35</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften			EUR	-121.009,44				-121.009,44	-0,32
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften			EUR	-2.073.653,13				-2.073.653,13	-5,53
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-23.869,03				-23.869,03	-0,06
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-2.218.531,60</b>	<b>-5,91</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>37.477.746,55</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>720.744,000</b>	
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>52,00</b>	
<b>Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 432.108,00</b>									

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

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

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2019

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,89842 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,69645 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	10,55940 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,11007 = 1 Euro (EUR)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	6,56235 = 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,25255 = 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	25,43100 = 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	323,85500 = 1 Euro (EUR)
Rumänien, Leu	(RON)	4,72975 = 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	16,08800 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,13870 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,49085 = 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,54050 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	122,57500 = 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,69700 = 1 Euro (EUR)

# Frankfurter-Sparinrent Deko

## 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>CHF</b>				
CH0124855328	2,6250 % SNCF Réseau MTN 11/31	CHF	0	200.000
<b>CZK</b>				
CZ0001002851	3,8500 % Tschechien Anl. S.61 10/21	CZK	0	10.000.000
CZ0001005375	2,7500 % Tschechien Bonds S.105 18/29	CZK	10.000.000	10.000.000
<b>EUR</b>				
XS1967635621	1,5000 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 19/24	EUR	200.000	200.000
XS1967636199	3,0000 % Abertis Infraestructuras S.A. MTN 19/31	EUR	100.000	100.000
XS1933815455	1,3750 % ABN AMRO Bank N.V. Cov. MTN 19/34	EUR	400.000	400.000
XS1917577931	0,2500 % ABN AMRO Bank N.V. Preferred MTN 18/21	EUR	0	325.000
XS1935139995	0,8750 % ABN AMRO Bank N.V. Preferred MTN 19/24	EUR	400.000	400.000
FR0013399029	1,7500 % ACCOR S.A. Bonds 19/26	EUR	200.000	200.000
XS1953778807	0,5000 % Achmea Bank N.V. MT Mortg.Cov. Bds 19/26	EUR	400.000	400.000
FR0013428067	0,6250 % Air Liquide Finance MTN 19/30	EUR	200.000	200.000
XS1202664386	1,3750 % Allied Irish Banks PLC MTN 15/20	EUR	0	200.000
BE6312822628	1,6500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. MTN 19/31	EUR	200.000	200.000
XS1935204641	0,5000 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. Mortg.Cov. MTN 19/24	EUR	225.000	225.000
BE6311694010	1,0000 % Argenta Spaarbank N.V. Preferred Notes 19/24	EUR	400.000	400.000
XS1941841311	3,8750 % Assicurazioni Generali S.p.A. MTN 19/29	EUR	200.000	200.000
XS1649193403	1,8750 % ATF Netherlands B.V. MTN 17/26	EUR	0	200.000
FR0013416146	2,3750 % Auchan Holding S.A. MTN 19/25	EUR	400.000	400.000
FR0013406154	0,7500 % AXA Bank Europe SCF MT Obl.Fonc. 19/29	EUR	300.000	300.000
XS1956973967	1,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Non-Pref. MTN 19/24	EUR	200.000	200.000
IT0005321663	1,0000 % Banco BPM S.p.A. MT Mortg. Cov. Bds 18/25	EUR	0	400.000
XS1960684063	2,0000 % Banco BPM S.p.A. MTN 19/22	EUR	475.000	475.000
XS1918887156	5,3750 % Banco de Sabadell S.A. FLR MTN 18/28	EUR	0	100.000
XS1751004232	1,1250 % Banco Santander S.A. Non-Pref. MTN 18/25	EUR	0	200.000
XS1998215393	0,4000 % Baxter International Inc. Notes 19/24	EUR	475.000	475.000
IT0005359507	2,0000 % Bca Monte dei Paschi di Siena Mortg.Cov. MTN 19/24	EUR	250.000	250.000
XS1975757789	2,3750 % Bca Pop. di Sondrio S.c.p.A. Preferred MTN 19/24	EUR	350.000	350.000
FR0013398070	2,1250 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 19/27	EUR	100.000	100.000
XS1992927902	1,2310 % BP Capital Markets PLC MTN 19/31	EUR	150.000	150.000
IT0005365710	1,1250 % BPER Banca S.p.A. Mortg.Cov. MTN 19/26	EUR	175.000	175.000
FR0013412947	0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Preferred MTN 19/26	EUR	400.000	400.000
XS1565131213	3,5000 % Caixabank S.A. FLR MTN 17/27	EUR	0	200.000
XS1968846532	1,1250 % Caixabank S.A. Preferred MTN 19/26	EUR	400.000	400.000
XS2009011771	0,8000 % Capital One Financial Corp. Notes 19/24	EUR	175.000	175.000
XS1901137361	2,1250 % Celanese US Holdings LLC Notes 18/27	EUR	0	300.000
XS1996435688	1,0000 % CEPESA Finance S.A.U. MTN 19/25	EUR	300.000	300.000
XS1415366720	1,8750 % Ceske Drah AS Notes 16/23	EUR	0	200.000
FR0013399680	2,7500 % CNP Assurances S.A. Obl. 19/29	EUR	200.000	200.000
XS1995781546	1,0000 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 19/27	EUR	225.000	225.000
XS1958646082	0,5000 % Colgate-Palmolive Co. Bonds 19/26	EUR	200.000	200.000
DE000CZ40NP5	1,2500 % Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P30 19/34	EUR	400.000	400.000
DE000CZ40KG0	0,2500 % Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P6 15/22	EUR	0	300.000
DE000CZ40NG4	1,2500 % Commerzbank AG MTN IHS S.915 18/23	EUR	0	200.000
XS0478074924	4,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. MTN 10/20	EUR	0	250.000
XS1991126431	1,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. Non-Preferred MTN 19/31	EUR	200.000	200.000
IT0005366288	1,0000 % Credit Agricole Italia S.p.A. MT Mtg.Cov.Bds 19/27	EUR	100.000	100.000
XS1958307461	1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Non-Pref. MTN 19/29	EUR	200.000	200.000
FR0013421369	1,1250 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 19/29	EUR	200.000	200.000
FR0013407418	3,3750 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 19/31	EUR	300.000	300.000
FR0013414091	1,6250 % Crédit Mutuel Arkéa Non-Preferred MTN 19/26	EUR	200.000	200.000
XS0981442931	2,7500 % CRH Finland Services Oyj MTN 13/20	EUR	0	200.000
XS1967697738	2,5000 % Danske Bank AS FLR MTN 19/29	EUR	125.000	125.000
XS1963849440	1,6250 % Danske Bank AS Non-Preferred MTN 19/24	EUR	150.000	150.000
DE000DB5DCS4	2,3750 % Deutsche Bank AG MTN 13/23	EUR	0	300.000
DE000DL19UC0	1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 18/23	EUR	0	300.000
DE000DL19UR8	1,8750 % Deutsche Bank AG MTN 19/22	EUR	500.000	500.000
DE000A2TSD2	1,7500 % Deutsche Telekom AG MTN 19/31	EUR	150.000	150.000
FR0013385655	1,8750 % Edenred S.A. Notes 18/26	EUR	0	400.000
XS1953833750	1,1250 % Elisa Oyj MTN 19/26	EUR	250.000	250.000
XS1981060624	1,8750 % ERG S.p.A. MTN 19/25	EUR	150.000	150.000
XS2000538343	0,8750 % Erste Group Bank AG Non Preferred MTN 19/26	EUR	200.000	200.000
XS1982725159	0,3750 % Erste Group Bank AG Pref. MTN 19/24	EUR	100.000	100.000
EU000A19XC51	1,2500 % Europäische Union MTN 18/33	EUR	0	175.000
EU000A1U9936	1,8500 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) MTN 15/55	EUR	0	325.000

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1938387237	0,6250 % European Investment Bank MTN 19/29	EUR	200.000	200.000
FR0013422623	2,2500 % Eutelsat S.A. Bonds 19/27	EUR	300.000	300.000
XS1954697923	1,2500 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) MTN 19/22	EUR	125.000	125.000
XS1843436228	1,5000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 19/27	EUR	250.000	250.000
XS1767930826	0,1000 % Ford Motor Credit Co. LLC FLR MTN 18/22	EUR	0	100.000
XS1767930586	1,3550 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 18/25	EUR	100.000	430.000
XS1956028168	0,8750 % Fortum Oyj MTN 19/23	EUR	175.000	175.000
XS1554373248	1,5000 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 17/24 2	EUR	0	200.000
XS1936208252	1,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 19/25	EUR	200.000	200.000
XS1612542669	0,3750 % General Electric Co. Notes 17/22	EUR	0	200.000
XS1910851242	1,5000 % Grenke Finance PLC MTN 18/23	EUR	0	200.000
XS1956014531	1,6250 % Grenke Finance PLC MTN 19/24	EUR	250.000	250.000
GR0114031561	3,4500 % Griechenland Notes 19/24	EUR	250.000	250.000
GR0124035693	3,8750 % Griechenland Notes 19/29	EUR	300.000	300.000
XS1960589155	1,8750 % Heathrow Funding Ltd. FLR MTN S.A 19/36	EUR	500.000	500.000
XS1958655745	2,1250 % Heimstaden Bostad AB MTN 19/23	EUR	175.000	175.000
XS1713466495	3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. FLR Notes 19/Und.	EUR	150.000	150.000
FR0013331188	0,6250 % Iliad S.A. Obl. 18/21	EUR	0	300.000
XS1935128956	2,6250 % Immofinanz AG Notes 19/23	EUR	300.000	300.000
XS1915152000	0,7500 % Instituto de Credito Oficial MTN 18/23	EUR	0	400.000
IT0005365231	0,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MT Hyp.-Pfe. 19/24	EUR	300.000	300.000
XS1197351577	1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 15/22	EUR	0	300.000
XS1945110861	1,7500 % Intl Business Machines Corp. Notes 19/31	EUR	150.000	150.000
XS1649668792	1,3750 % Invitalia S.P.A. Notes 17/22 Reg.S	EUR	0	200.000
XS1023541847	2,8750 % Israel MTN 14/24	EUR	0	200.000
XS2013618421	0,8750 % ISS Global A/S MTN 19/26	EUR	200.000	200.000
BE0000347568	0,9000 % Königreich Belgien Obl. Lin. 19/29	EUR	350.000	350.000
BE0000348574	1,7000 % Königreich Belgien Obl. Lin. 19/50	EUR	225.000	225.000
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25	EUR	0	400.000
BE0000340498	2,1500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.80 16/66	EUR	150.000	350.000
NL0012171458	0,7500 % Königreich Niederlande Anl. 17/27	EUR	500.000	500.000
ES00000128E2	3,4500 % Königreich Spanien Bonos 16/66	EUR	490.000	490.000
ES0000012B62	0,3500 % Königreich Spanien Bonos 18/23	EUR	400.000	400.000
ES0000012E51	1,4500 % Königreich Spanien Bonos 19/29	EUR	400.000	400.000
FR0013286838	1,0000 % La Banque Postale Non-Pref. MTN 17/24	EUR	0	300.000
DE000NRW0LQ9	2,1500 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1479 19/19	EUR	250.000	250.000
XS0468940068	5,8750 % Landesbank Berlin AG Nachr. MTN IHS 09/19	EUR	0	400.000
DE000LB13HZ5	2,2000 % Ldsbk Baden-Württemb. SMT T2 MTN 19/29	EUR	300.000	300.000
XS1963836892	1,3490 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Bonds 19/26	EUR	100.000	100.000
XS1963837197	1,9790 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Bonds 19/30	EUR	100.000	100.000
IT0005339186	1,1250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Mortg.Cov.MTN 18/24	EUR	200.000	200.000
XS1551000364	0,7500 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 17/20	EUR	0	100.000
XS1973750869	1,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Preferred MTN 19/25	EUR	200.000	200.000
XS1960678685	2,2500 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 19/39	EUR	100.000	100.000
XS2011260531	1,6250 % Merck KGaA FLR Sub.Anl. 19/79	EUR	100.000	100.000
XS1979259220	0,3750 % Metropolitan Life Global Fdg I MTN 19/24	EUR	325.000	325.000
XS2002491517	1,0000 % NatWest Markets PLC MTN 19/24	EUR	175.000	175.000
XS1877512258	1,0000 % NIBC Bank N.V. MT Mortg.Cov. Bds 18/28	EUR	0	200.000
XS1978668298	2,0000 % NIBC Bank N.V. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	200.000	200.000
XS1960685383	2,0000 % Nokia Oyj MTN 19/26	EUR	200.000	200.000
XS1974922442	1,1250 % Norsk Hydro ASA Bonds 19/25	EUR	200.000	200.000
XS1974922525	2,0000 % Norsk Hydro ASA Bonds 19/29	EUR	150.000	150.000
DK0009522732	0,8750 % Nykredit Realkredit A/S MTN 19/24	EUR	325.000	325.000
XS1917590876	0,7500 % OMV AG MTN 18/23	EUR	0	150.000
FR0013413887	2,3750 % Orange S.A. FLR MTN 19/Und.	EUR	200.000	200.000
XS2015267953	0,6250 % PSA Banque France S.A. MTN 19/24	EUR	150.000	150.000
XS1917591411	1,0000 % Raiffeisen Bank Intl AG Pref. MTN S.166 18/23	EUR	0	200.000
XS1942629061	0,8750 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG MTN 19/29	EUR	200.000	200.000
FR0013412699	0,7500 % RCI Banque S.A. MTN 19/23	EUR	275.000	275.000
BE6313647149	1,2500 % Région Wallonne MTN 19/34	EUR	200.000	200.000
FR0011427848	0,2500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 13/24	EUR	0	100.000
FR0013238268	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 17/28	EUR	200.000	200.000
FR0013404969	1,5000 % Rep. Frankreich OAT 18/50	EUR	350.000	350.000
IE00BH35Q895	1,1000 % Republik Irland Treasury Bonds 19/29	EUR	450.000	450.000
IE00BH35QB22	1,5000 % Republik Irland Treasury Bonds 19/50	EUR	350.000	350.000
IT0005348443	2,3000 % Republik Italien B.T.P. 18/21	EUR	250.000	250.000
IT0005358806	3,3500 % Republik Italien B.T.P. 18/35	EUR	650.000	650.000
IT0005363111	3,8500 % Republik Italien B.T.P. 18/49	EUR	550.000	550.000
IT0005370306	2,1000 % Republik Italien B.T.P. 19/26	EUR	500.000	500.000
IT0005365165	3,0000 % Republik Italien B.T.P. 19/29	EUR	200.000	200.000
IT0005377152	3,1000 % Republik Italien B.T.P. 19/40	EUR	500.000	500.000
IT0005350514	0,0000 % Republik Italien C.T.Z. 18/20	EUR	0	300.000
IT0005252520	0,8680 % Republik Italien FLR C.C.T. 17/24	EUR	0	200.000
IT0005188120	0,1000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 16/22	EUR	300.000	300.000
IT0005246134	1,3000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 16/28	EUR	200.000	200.000
XS1028953989	3,8750 % Republik Kroatien Notes 14/22	EUR	0	300.000
XS1843434876	1,1250 % Republik Kroatien Notes 19/29	EUR	300.000	300.000
XS1953056253	1,8750 % Republik Lettland MTN 19/49	EUR	650.000	650.000
XS1619567677	0,9500 % Republik Litauen MTN 17/27	EUR	200.000	200.000
XS2013678086	1,6250 % Republik Litauen MTN 19/49	EUR	150.000	150.000

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
PTOTVMOE0000	1,0000 % Republik Portugal FLR Obr. 18/25	EUR	200.000	200.000
PTOTEQOE0015	5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24	EUR	0	200.000
PTOTEROE0014	3,8750 % Republik Portugal Obr. 14/30	EUR	150.000	150.000
PTOTEUOE0019	4,1250 % Republik Portugal Obr. 17/27	EUR	200.000	200.000
XS1599193403	2,3750 % Republik Rumänien MTN 17/27 Reg.S	EUR	200.000	200.000
XS1968706876	4,6250 % Republik Rumänien MTN 19/49 Reg.S	EUR	150.000	150.000
SI0002103685	1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27	EUR	0	200.000
SI0002103842	1,1875 % Republik Slowenien Bonds 19/29	EUR	300.000	300.000
XS1227247191	3,8750 % Republik Zypern MTN 15/22	EUR	0	400.000
XS1314321941	4,2500 % Republik Zypern MTN 15/25	EUR	300.000	500.000
XS1883942648	2,3750 % Republik Zypern MTN 18/28	EUR	150.000	300.000
XS1956050923	2,7500 % Republik Zypern MTN 19/34	EUR	350.000	350.000
XS1989383788	2,7500 % Republik Zypern MTN 19/49	EUR	200.000	200.000
XS1413580579	1,0000 % Santander Consumer Finance SA MTN 16/21	EUR	0	200.000
XS1956025651	1,0000 % Santander Consumer Finance SA MTN 19/24	EUR	200.000	200.000
DE000A2TSTF5	1,2500 % SAP SE IHS 18/28	EUR	0	400.000
DE000A2YB7A7	1,8750 % Schaeffler AG MTN 19/24	EUR	100.000	100.000
DE000A2YB7B5	2,8750 % Schaeffler AG MTN 19/27	EUR	150.000	150.000
XS2015240083	1,5000 % SLP Finance S.a.r.l. Notes 19/26	EUR	125.000	125.000
XS1986416268	0,8750 % Sika Capital B.V. Notes 19/27	EUR	200.000	200.000
XS1986416698	1,5000 % Sika Capital B.V. Notes 19/31	EUR	100.000	100.000
XS1951095329	2,6250 % Soc.p.l.Gest.d.Attiv.-SGA SpA MTN 19/24	EUR	450.000	450.000
FR0013403441	1,2500 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	200.000	200.000
XS1002121454	6,5000 % Stichting AK Rabobank Cert. FLR Cert. 14/Und.	EUR	0	100.000
XS1945947635	1,2500 % Sydbank AS Non-Preferred MTN 19/22	EUR	225.000	225.000
FR0013414158	1,0000 % Synd. Transports Ile de France MTN 19/34	EUR	200.000	200.000
XS1946004451	1,0690 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 19/24	EUR	100.000	100.000
XS1382368113	2,5000 % The Royal Bk of Scotld Grp PLC MTN 16/23	EUR	0	250.000
DE000A2TEDB8	2,8750 % thyssenkrupp AG MTN 19/24	EUR	500.000	500.000
XS1843435501	1,5000 % TLG IMMOBILIEN AG Anl. 19/26	EUR	600.000	600.000
XS1974787480	1,7500 % Total S.A. FLR MTN 19/Und.	EUR	175.000	175.000
XS1887498282	1,2500 % Ungarn Bonds 18/25	EUR	0	300.000
FR0013405040	1,7500 % Unibail-Rodamco SE MTN 19/34	EUR	200.000	200.000
DE000HV2ASK2	0,8500 % UniCredit Bank AG HVB MTN-Hyp.-Pfe. S.2055 19/34	EUR	300.000	300.000
XS1953271225	4,8750 % UniCredit S.p.A. FLR MTN 19/29	EUR	350.000	350.000
XS1979446843	1,5000 % Unio.di Banche Italiane S.p.A. Preferred MTN 19/24	EUR	250.000	250.000
XS2001183164	1,5000 % Vesteda Finance B.V. MTN 19/27	EUR	100.000	100.000
XS1888179477	3,1000 % Vodafone Group PLC FLR Cap. Sec. 18/79	EUR	0	100.000
AT000B121967	2,7500 % Volksbank Wien AG FLR Notes 17/27	EUR	0	100.000
AT000B122031	0,3750 % Volksbank Wien AG Schuldv. 19/26	EUR	200.000	200.000
XS1972548231	1,5000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 19/24	EUR	350.000	350.000
XS1944390597	2,5000 % Volkswagen Bank GmbH MTN 19/26	EUR	200.000	200.000
XS1995748172	0,1000 % Volvo Treasury AB MTN 19/22	EUR	100.000	100.000
DE000A2RWZZ6	1,8000 % Vonovia Finance B.V. MTN 19/25	EUR	100.000	100.000
SK4000015475	0,5000 % Vseobecna MT Mortg. Cov. Bds 19/29	EUR	200.000	200.000
XS1987097430	0,5000 % Wells Fargo & Co. MTN 19/24	EUR	250.000	250.000
XS1978200472	0,3750 % Westpac Banking Corp. Mortg. Cov. MTN 19/26	EUR	400.000	400.000
<b>GBP</b>				
XS1841745612	1,3750 % BASF SE MTN 18/22	GBP	0	100.000
XS1992928116	1,8270 % BP Capital Markets PLC MTN 19/25	GBP	125.000	125.000
XS1950866720	3,8750 % Deutsche Bank AG MTN 19/24	GBP	200.000	200.000
XS1982100643	1,7500 % Diageo Finance PLC MTN 19/26	GBP	100.000	100.000
XS0846486040	4,7500 % London Stock Exchange Group PLC MTN 12/21	GBP	0	200.000
XS1979281158	2,5000 % Verizon Communications Inc. Notes 19/31	GBP	100.000	100.000
FR0013409166	2,2500 % VINCI S.A. MTN 19/27	GBP	300.000	300.000
<b>USD</b>				
US71567RAL06	3,9000 % Perusah.Pen.SBSN Indonesia III MTN 19/24 Reg.S	USD	200.000	200.000
US465410AH18	6,8750 % Republik Italien Debts 93/23	USD	100.000	300.000
XS1953916290	4,7500 % Republik Usbekistan MTN 19/24 Reg.S	USD	200.000	200.000
XS1958649854	8,2500 % Yapi Ve Kredi Bankasi A.S. MTN 19/24 Reg.S	USD	250.000	250.000
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES0211845294	2,5000 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 14/25	EUR	0	200.000
XS1989708836	3,3750 % ASR Nederland N.V. FLR Bonds 19/49	EUR	100.000	100.000
ES0422714040	1,0000 % Cajamar Caja Rural, S.C.Créd. Cédulas Hipot. 15/20	EUR	0	200.000
XS1981054221	1,1250 % Coca-Cola European Partn. PLC Notes 19/29	EUR	225.000	225.000
ES0000106635	1,1250 % Comun. Autónoma del País Vasco Obligaciones 19/29	EUR	200.000	200.000
ES0001348244	1,5490 % Comun.Autón.d.Islas Baleares Obl. 19/28	EUR	475.000	475.000
ES0000101701	3,2500 % Comunidad Autónoma de Madrid Bonos 16/46	EUR	0	200.000
ES0000101909	1,5710 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 19/29	EUR	400.000	400.000
ES0205045000	1,6250 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 15/22	EUR	0	500.000
XS1991034825	3,5000 % eircom Finance DAC Notes 19/26 Reg.S	EUR	150.000	150.000
XS2001315766	1,3750 % Euronet Worldwide Inc. Notes 19/26	EUR	350.000	350.000
XS1963830002	3,1250 % Faurecia S.A. Notes 19/26	EUR	100.000	100.000
XS1999730374	0,1000 % Korea Housing Fin.Corp. (KHFC) Mrt.Cv.Bds 19/24 RS	EUR	300.000	300.000
XS1972557737	0,5000 % LG Chem Ltd. Notes 19/23 Reg.S	EUR	200.000	200.000
ES0224244071	1,6250 % Mapfre S.A. Obl. 16/26	EUR	100.000	300.000
XS1974394675	1,6250 % Mexiko MTN 19/26	EUR	300.000	300.000

# Frankfurter-Sparinrent Deka

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1843442622	1,7500 % Nasdaq Inc. Notes 19/29	EUR	150.000	150.000
XS1172947902	1,8750 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 15/22	EUR	0	350.000
XS1991219442	0,8750 % Philippinen Bonds 19/27	EUR	150.000	150.000
XS1969645255	3,1250 % PPF Arena 1 B.V. MTN 19/26	EUR	350.000	350.000
XS2012546714	1,4500 % Republik Indonesien Notes 19/26	EUR	150.000	150.000
XS1487498922	3,0000 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 16/21	EUR	200.000	200.000
XS1968706520	1,4500 % Scentre Management Ltd. MTN 19/29	EUR	150.000	150.000
SK4000015400	0,1250 % Slovenská Sporitelna AS MT Mortg.Cov.Bds 19/26	EUR	400.000	400.000
XS1915511411	2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. Notes Tr.2 19/26 RS	EUR	100.000	100.000
XS1963116964	2,5340 % Swiss Re Finance (Lux) S.A. FLR Notes 19/50	EUR	100.000	100.000
<b>USD</b>				
XS1992085867	4,2500 % ENI S.p.A. Notes 19/29 Reg.S	USD	200.000	200.000
US91087BAF76	4,5000 % Mexiko Notes 19/29	USD	200.000	200.000
US71654QCP54	6,5000 % Petróleos Mexicanos (PEMEX) Notes 18/29	USD	0	100.000
US912810QV35	0,7500 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 12/42	USD	0	220.000
US912828UF54	1,1250 % U.S. Treasury Notes 12/19	USD	0	1.000.000
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES0213307004	4,0000 % BANKIA S.A. FLR Obl. 14/24	EUR	200.000	200.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY))	EUR	5.182
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO-BTP Future (FBTP), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), SHORT EURO-BTP Future (FBTS), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))	EUR	38.712
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	3.675
<b>Währungsderivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Devisen</b>		
<b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
AUD/USD	EUR	2
EUR/USD	EUR	6
GBP/USD	EUR	32
NZD/USD	EUR	11
USD/CAD	EUR	4
USD/PLN	EUR	7
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
AUD/JPY	EUR	18
AUD/USD	EUR	12
EUR/GBP	EUR	41
EUR/HUF	EUR	60
EUR/JPY	EUR	18
EUR/NOK	EUR	42
EUR/USD	EUR	21
GBP/CHF	EUR	6
GBP/USD	EUR	33
NZD/USD	EUR	9
USD/JPY	EUR	31
USD/NOK	EUR	21
<b>Verkaufte Kaufoptionen (Call):</b>		
GBP/USD	EUR	18
<b>Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
AUD/JPY	EUR	2
EUR/GBP	EUR	37
EUR/HUF	EUR	60
EUR/JPY	EUR	3
EUR/NOK	EUR	17
GBP/USD	EUR	27
USD/JPY	EUR	4

**Devisentermingeschäfte**  
**Devisenterminkontrakte (Verkauf)**

# Frankfurter-Sparinrent Deko

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	EUR	19
AUD/JPY	EUR	1.318
AUD/USD	EUR	3.189
CAD/USD	EUR	329
CHF/EUR	EUR	3.191
CHF/GBP	EUR	292
CHF/USD	EUR	329
CZK/EUR	EUR	10.372
GBP/CHF	EUR	283
GBP/EUR	EUR	3.852
HUF/EUR	EUR	2.359
JPY/EUR	EUR	996
JPY/USD	EUR	3.318
NOK/EUR	EUR	7.607
NOK/SEK	EUR	512
NOK/USD	EUR	2.977
NZD/USD	EUR	3.687
PLN/EUR	EUR	3.029
PLN/USD	EUR	2.003
RON/EUR	EUR	1.145
SEK/EUR	EUR	399
TRY/EUR	EUR	0
USD/EUR	EUR	13.767
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	EUR	37
AUD/JPY	EUR	1.333
AUD/USD	EUR	3.177
CAD/USD	EUR	329
CHF/EUR	EUR	3.694
CHF/GBP	EUR	1.418
CHF/USD	EUR	329
CZK/EUR	EUR	11.542
GBP/CHF	EUR	1.416
GBP/EUR	EUR	2.907
HUF/EUR	EUR	1.843
JPY/EUR	EUR	1.021
JPY/USD	EUR	3.321
NOK/EUR	EUR	7.394
NOK/USD	EUR	3.012
NZD/EUR	EUR	9
NZD/USD	EUR	3.689
PLN/EUR	EUR	3.512
PLN/USD	EUR	1.995
RON/EUR	EUR	1.375
SEK/EUR	EUR	410
USD/EUR	EUR	14.415
<b>Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)</b>		
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>		
<b>Protection Buyer:</b>		
(Basiswert(e): CDS People's Republic of China)	EUR	447

# Frankfurter-Sparrent Deka

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	720.744
Anteilwert	EUR	52,00

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

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

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

#### Bankguthaben

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

#### Derivate

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

#### Sonstiges

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

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

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

---

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2019  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---



# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

## Sitz

Frankfurt am Main

## Gründungsdatum

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

## Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2018

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

## Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

Peter Scherkamp, München

## Geschäftsführung

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

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Squaire  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale  
Main Tower  
Neue Mainzer Straße 52 - 58  
60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

**Rechtsform**

rechtsfähige Anstalt des öffentlichen Rechts

**Sitz**

Frankfurt am Main und Erfurt

**Haupttätigkeit**

Geschäftsbank, Retailbank, Verbundbank und öffentliche Förderbank

Stand: 30. Juni 2019

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

**Überreicht durch:**

Frankfurter Sparkasse AG  
Neue Mainzer Straße 47-53  
60255 Frankfurt am Main  
Deutschland



**Deka Investment GmbH**

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

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

