

Halbjahresbericht
zum 31. März 2024.
Deka-RentenReal

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. März 2024

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-RentenReal für den Zeitraum vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024.

Der Rückgang der Teuerungsraten im Berichtszeitraum sorgte für eine deutliche Entlastung an den Finanzmärkten. Dennoch hat sich in Deutschland die Wirtschaftsdynamik merklich abgekühlt, was sich in einer Schrumpfung des Bruttoinlandsprodukts im Jahr 2023 niederschlug. Auch die Konjunktur in Euroland findet nur schwer aus ihrer Schwächephase heraus. Positiv ausgefallene Konjunkturindikatoren im ersten Quartal 2024 lassen jedoch auf eine Erholung im laufenden Jahr hoffen. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin die Wirtschaftslage in den USA. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik konzentrierte sich weiterhin auf die Inflations-Bekämpfung, wobei sich die Tonlage zum Jahresende 2023 spürbar abmilderte. Während die Fed das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent beibehielt, erhöhte die EZB noch im September den Hauptrefinanzierungssatz auf 4,50 Prozent. Mit ersten Anzeichen für ein Ende des Zinserhöhungs-Zyklus entfernten sich die Verzinsungen ab November wieder sichtlich von ihren zuvor erreichten Höchstständen, bevor im ersten Quartal 2024 insbesondere die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und wieder ansteigende Renditen sorgten. Die Verzinsung 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende März bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,2 Prozent.

An den Aktienmärkten spiegelten sich ab November die Zinssenkungserwartungen in signifikanten Kursanstiegen wider, sodass die wichtigsten Aktienindizes im Berichtszeitraum mehrheitlich erfreuliche Zuwächse verzeichneten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten auf ein neues Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Lediglich der chinesische Aktienmarkt litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. März 2024	6
Vermögensaufstellung zum 31. März 2024	7
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

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-RentenReal Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist die Erwirtschaftung eines regelmäßigen, inflationsgeschützten Ertrages in Euro. Dieser Ertrag bemisst sich am realen Zinssatz, das heißt, an dem um die Inflationsrate bereinigten Nominalzins. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds zu mindestens 70% in verzinsliche, inflationsindexierte Wertpapiere an. Ergänzend können auch nicht-inflationsgeschützte Wertpapiere beigemischt werden. Erworben werden Anleihen staatlicher oder staatsnaher Emittenten. Durch die globale Ausrichtung des Fonds sollen dabei die unterschiedlichen Zins- und Inflationserwartungen ausgenutzt werden. Investitionen erfolgen nahezu vollständig in auf Euro lautende Wertpapiere oder in gegenüber Euro abgesicherte Wertpapiere fremder Währung.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental orientierte Investmentansatz kombiniert gezielt "Top-Down" sowie "Bottom-Up"-Elemente. Die Basis stellt die Analyse makroökonomischer sowie (geo)politischer Parameter dar, ergänzt durch qualitative sowie quantitative fundamentale Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände, z.B. Bonitätsanalyse der Emittenten, relativer Vergleich der Wertpapiere mit anderen korrespondierenden Ausstellern. Um den Erfolg des Aktienaushwahlprozesses bezüglich der Erreichung des Anlagezieles zu bewerten, wird der Index 85% ICE BofA 1-10 Year Global Inflation-Linked Government Excluding Japan Index hedged in EUR, 15% ICE 10 BofA Global Government Index hedged in EUR¹⁾ verwendet. Die initiale und kontinuierliche Wertpapierauswahl erfolgt im Rahmen des beschriebenen Investmentansatzes unabhängig von diesem Referenzwert und damit verbundenen quantitativen oder qualitativen Einschränkungen.

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35 % des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland, Frankreichs, Großbritanniens und der USA investieren.

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Wichtige Kennzahlen

Deka-RentenReal

Performance*	6 Monate
	2,8%
ISIN	DE000DK0AYK1

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

1) Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Index-Marke stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

Deka-RentenReal

Vermögensübersicht zum 31. März 2024.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	99.742.357,70	99,21
Australien	915.822,75	0,91
Belgien	65.180,00	0,06
Deutschland	4.890.541,52	4,85
Frankreich	8.995.416,52	8,93
Großbritannien	9.744.905,19	9,69
Irland	1.635.549,00	1,63
Italien	5.579.872,50	5,56
Kanada	1.699.843,53	1,69
Österreich	181.817,50	0,19
Schweden	998.990,32	0,98
Sonstige	526.380,00	0,52
Spanien	3.310.049,35	3,29
USA	61.197.989,52	60,91
2. Derivate	-136.379,54	-0,12
3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	702.911,28	0,67
4. Sonstige Vermögensgegenstände	2.365.895,75	2,35
II. Verbindlichkeiten	-2.126.399,92	-2,11
III. Fondsvermögen	100.548.385,27	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	99.742.357,70	99,21
AUD	915.822,75	0,91
CAD	1.699.843,53	1,69
EUR	24.695.901,60	24,54
GBP	10.233.809,98	10,18
SEK	998.990,32	0,98
USD	61.197.989,52	60,91
2. Derivate	-136.379,54	-0,12
3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	702.911,28	0,67
4. Sonstige Vermögensgegenstände	2.365.895,75	2,35
II. Verbindlichkeiten	-2.126.399,92	-2,11
III. Fondsvermögen	100.548.385,27	100,00

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

Deka-RentenReal

Vermögensaufstellung zum 31. März 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								37.230.963,34	37,00
Verzinsliche Wertpapiere								37.230.963,34	37,00
EUR								24.695.901,60	24,54
DE0001102341	2,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/46 ¹⁾	EUR		200.000	0	0	100,114	200.228,00	0,20
DE0001102598	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/38 ¹⁾	EUR		200.000	200.000	0	82,725	165.450,00	0,16
DE000BU2Z007	2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 23/33	EUR		500.000	700.000	200.000	100,155	500.775,00	0,50
DE0001030724	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. Gruene 20/50	EUR		500.000	0	0	53,237	266.185,00	0,26
DE0001030559	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 14/30	EUR		1.400.000	0	0	125,942	1.763.187,81	1,75
DE0001030567	0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 15/26	EUR		850.000	0	0	122,209	1.038.777,78	1,03
DE0001030583	0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 21/33	EUR		400.000	0	0	116,758	467.033,14	0,46
EU000A1G0D70	1,2500 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/33	EUR		600.000	0	0	87,730	526.380,00	0,52
BE0000350596	0,4000 % Königreich Belgien Obl. Lin. 20/40	EUR		100.000	0	0	65,180	65.180,00	0,06
ES0000012B39	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 18/28	EUR		500.000	500.000	0	94,519	472.595,00	0,47
ES00000127C8	1,0000 % Königreich Spanien Bonos Ind. Infiación 14/30	EUR		1.000.000	0	0	124,463	1.244.625,63	1,24
ES00000128S2	0,6500 % Königreich Spanien Bonos Ind. Infiación 17/27	EUR		800.000	800.000	800.000	122,520	980.156,39	0,97
ES0000012C12	0,7000 % Königreich Spanien Bonos Ind. Infiación 17/33	EUR		400.000	800.000	400.000	117,686	470.744,33	0,47
ES0000012G42	1,2000 % Königreich Spanien Obligaciones 20/40	EUR		200.000	0	0	70,964	141.928,00	0,14
FR0000188799	3,1500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 02/32	EUR		100.000	200.000	100.000	185,139	185.138,52	0,18
FR011008705	1,8500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 10/27 ¹⁾	EUR		1.800.000	0	500.000	138,103	2.485.845,47	2,47
FR011982776	0,7000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 14/30	EUR		750.000	0	250.000	125,910	944.325,48	0,94
FR013410552	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 19/29	EUR		1.350.000	0	0	116,522	1.573.047,61	1,56
FR013519253	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 20/26	EUR		700.000	0	0	116,243	813.698,60	0,81
FR014003N51	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 21/32	EUR		1.600.000	0	0	108,891	1.742.257,84	1,73
FR012993103	1,5000 % Rep. Frankreich OAT 15/31 ¹⁾	EUR		1.000.000	0	500.000	92,500	925.000,00	0,92
FR013154044	1,2500 % Rep. Frankreich OAT 16/36	EUR		150.000	0	150.000	82,880	124.320,00	0,12
FR013515806	0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40	EUR		300.000	0	0	67,261	201.783,00	0,20
IE00BKFVCS68	0,2000 % Republik Irland Treasury Bonds 20/27	EUR		700.000	1.500.000	800.000	92,762	649.334,00	0,65
IE000LQ7YWY4	2,6000 % Republik Irland Treasury Bonds 24/34	EUR		1.000.000	1.500.000	500.000	98,622	986.215,00	0,98
IT0005398406	2,4500 % Republik Italien B.T.P. 19/50	EUR		100.000	0	0	74,088	74.088,00	0,07
IT0005588881	1,8000 % Republik Italien Infl.Idx Lkd B.T.P. 23/36	EUR		700.000	700.000	0	100,308	702.156,00	0,70
IT0005138828	1,2500 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 15/32	EUR		600.000	0	0	121,612	729.671,68	0,73
IT0005246134	1,3000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 16/28	EUR		950.000	0	0	123,661	1.174.776,20	1,17
IT0005387052	0,4000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 19/30	EUR		1.800.000	0	300.000	112,645	2.027.618,55	2,02
IT0005415416	0,6500 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 20/26	EUR		750.000	0	0	116,208	871.562,07	0,87
AT0000A10683	2,4000 % Republik Österreich Bundesanl. 13/34	EUR		100.000	0	0	96,216	96.215,50	0,10
AT0000A2CQD2	0,0000 % Republik Österreich MTN 20/30	EUR		100.000	0	0	85,602	85.602,00	0,09
AUD								551.577,61	0,55
AU0000XCLWV6	2,5000 % Commonwealth of Australia Infl.Lkd Bds S.Cl 10/30	AUD		600.000	0	0	152,758	551.577,61	0,55
GBP								10.233.809,98	10,18
GB00B128DH60	1,2500 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 06/27	GBP		700.000	0	0	203,522	1.664.406,36	1,66
GB00B3D4VD98	1,2500 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 08/32	GBP		900.000	0	100.000	189,692	1.994.532,53	1,98
GB00B3Y1JG82	0,1250 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 11/29	GBP		700.000	0	0	158,990	1.300.217,55	1,29
GB00BY5F144	0,1250 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 15/26	GBP		700.000	0	0	145,732	1.191.797,50	1,19
GB00BZ1NTB69	0,1250 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 18/28	GBP		900.000	0	300.000	136,034	1.430.337,37	1,42
GB00BNNGP551	0,1250 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 21/31	GBP		300.000	0	0	129,222	452.905,96	0,45
GB0008932666	4,1250 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 92/30	GBP		250.000	0	0	344,370	1.005.806,38	1,00

Deka-RentenReal

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
GB00BZB26Y51	1,7500 % Großbritannien Treasury Stock 16/37		GBP	800.000	0	0	% 75,420	704.901,54	0,70
XS2744169637	3,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 24/29		GBP	425.000	425.000	0	% 98,466	488.904,79	0,49
SEK								998.990,32	0,98
SE0013748258	0,1250 % Koenigreich Schweden In.Ind.Lkd.Obl. Nr.3114 19/30		SEK	5.000.000	5.000.000	0	% 117,053	507.236,77	0,50
SE0000556599	3,5000 % Königreich Schweden Inf.Ind.Lkd.Obl. Nr.3104 98/28		SEK	1.000.000	0	0	% 178,948	155.090,44	0,15
SE0005703550	1,0000 % Königreich Schweden Inf.Ind.Lkd.Obl. Nr.3109 14/25		SEK	3.000.000	0	0	% 129,484	336.663,11	0,33
USD								750.683,83	0,75
US912810FD55	3,6250 % U.S. Treasury Inflation-Ind. Bonds 98/28		USD	400.000	0	1.150.000	% 202,516	750.683,83	0,75
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								61.890.521,25	61,59
Verzinsliche Wertpapiere								61.890.521,25	61,59
AUD								364.245,14	0,36
AU000XCLWAV1	0,7500 % Commonwealth of Australia Inf.Lkd Bds S.Cl 17/27		AUD	500.000	0	0	% 121,053	364.245,14	0,36
CAD								1.078.970,42	1,07
CA135087VS05	4,2500 % Canada Inflation-Ind. Bonds 95/26		CAD	400.000	0	0	% 192,755	525.231,79	0,52
CA135087WV25	4,0000 % Canada Inflation-Ind. Bonds 99/31		CAD	400.000	0	0	% 203,217	553.738,63	0,55
USD								60.447.305,69	60,16
US912810RV26	3,0000 % U.S. Treasury Bonds 17/47		USD	950.000	0	500.000	% 78,680	692.667,07	0,69
US912810FQ68	3,3750 % U.S. Treasury Inflation-Ind. Bonds 01/32		USD	1.200.000	0	0	% 191,996	2.135.063,05	2,12
US912810FS25	2,0000 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 06/26		USD	300.000	0	800.000	% 154,561	429.694,68	0,43
US912810PS15	2,3750 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 07/27		USD	700.000	1.000.000	1.300.000	% 153,951	998.664,97	0,99
US912828S505	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 16/26		USD	750.000	0	0	% 123,183	856.149,52	0,85
US912828V491	0,3750 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 17/27		USD	3.400.000	900.000	0	% 121,652	3.832.984,63	3,81
US9128283R96	0,5000 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 18/28		USD	5.750.000	750.000	0	% 118,192	6.297.880,68	6,27
US9128287D64	0,2500 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 19/29		USD	3.000.000	500.000	500.000	% 111,023	3.086.547,21	3,07
US91282CAQ42	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 20/25		USD	5.750.000	0	5.550.000	% 115,296	6.143.587,93	6,12
US91282CCA71	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 21/26		USD	3.900.000	0	0	% 112,555	4.067.870,92	4,06
US91282CBF77	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 21/31		USD	2.000.000	0	4.250.000	% 105,177	1.949.352,39	1,94
US91282CCM10	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 21/31		USD	2.450.000	250.000	0	% 101,615	2.307.082,11	2,29
US91282CEJ62	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 22/27		USD	8.850.000	0	0	% 102,859	8.435.765,95	8,40
US91282CFR79	1,6250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 22/27		USD	2.250.000	0	0	% 103,006	2.147.740,71	2,14
US91282CDX65	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 22/32		USD	200.000	200.000	0	% 96,994	179.768,58	0,18
US91282CEZ05	0,6250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 22/32		USD	400.000	0	0	% 96,032	355.970,46	0,35
US912810TE82	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 22/52		USD	900.000	0	100.000	% 64,787	540.343,21	0,54
US91282CGW55	1,2500 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 23/28		USD	2.600.000	2.600.000	0	% 99,777	2.404.038,40	2,39
US91282CJH51	2,3750 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 23/28		USD	8.700.000	8.700.000	0	% 102,954	8.300.420,61	8,27
US91282CGK18	1,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 23/33		USD	3.550.000	3.300.000	2.750.000	% 96,882	3.187.208,72	3,17
US91282CJY84	1,7500 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 24/34		USD	1.300.000	1.300.000	0	% 98,811	1.190.383,12	1,18
US9128286B18	2,6250 % U.S. Treasury Notes 19/29		USD	700.000	0	5.300.000	% 93,062	603.685,94	0,60
US91282CBL46	1,1250 % U.S. Treasury Notes S.B-2031 21/31		USD	400.000	0	800.000	% 82,129	304.434,83	0,30
Nichtnotierte Wertpapiere								620.873,11	0,62
Verzinsliche Wertpapiere								620.873,11	0,62
CAD								620.873,11	0,62
CA32117DAD62	2,8500 % First Nations Finance Auth. Debts 21/32		CAD	1.000.000	0	0	% 91,142	620.873,11	0,62
Summe Wertpapiervermögen							EUR	99.742.357,70	99,21
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									

Deka-RentenReal

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
								-24.227,66	-0,02
	10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Juni 24	XEUR	EUR	1.700.000				9.710,00	0,01
	10-YR Canadian Gov.Bond Future (CGB) Juni 24	XMOD	CAD	1.900.000				2.200,32	0,00
	30-YR Canadian Gov.Bond Future (LGB) Juni 24	XMOD	CAD	-500.000				-5.926,57	-0,01
	EURO Bobl Future (FGBM) Juni 24	XEUR	EUR	-100.000				-200,00	0,00
	EURO Bund Future (FGBL) Juni 24	XEUR	EUR	3.400.000				9.260,00	0,01
	EURO Buxl Future (FGBX) Juni 24	XEUR	EUR	-1.100.000				-14.300,00	-0,01
	EURO Schatz Future (FGBS) Juni 24	XEUR	EUR	900.000				-180,00	0,00
	EURO-BTP Future (FBTP) Juni 24	XEUR	EUR	-1.600.000				-14.080,00	-0,01
	Five-Year US Treasury Note Future (FV) Juni 24	XCBT	USD	-1.500.000				-1.020,82	0,00
	Long Gilt Future (FLG) Juni 24	IFEU	GBP	1.300.000				13.622,21	0,01
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Juni 24	XEUR	EUR	-2.000.000				3.250,00	0,00
	SGX Mini Jap. Government Bond Future (SJB) Juni 24	XSES	JPY	-210.000.000				-926,13	0,00
	Ten-Year Commonw. Treas. Bonds Future (XT) Juni 24	XSFE	AUD	2.000.000				-2.810,15	0,00
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Juni 24	XCBT	USD	4.500.000				17.375,59	0,02
	Three-Year Commonw. Treas. Bd Future (YT) Juni 24	XSFE	AUD	-5.900.000				4.590,75	0,00
	Two-Year US Treasury Note Future (TU) Juni 24	XCBT	USD	6.800.000				1.476,90	0,00
	Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB) Juni 24	XCBT	USD	-3.500.000				-54.762,07	-0,05
	Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) Juni 24	XCBT	USD	2.600.000				20.546,62	0,02
	US Treasury Long Bond Future (US) Juni 24	XCBT	USD	-900.000				-12.054,31	-0,01
	Summe Zins-Derivate						EUR	-24.227,66	-0,02
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)									
Offene Positionen									
	AUD/EUR 200.000,00	OTC						-350,19	0,00
	JPY/EUR 96.000.000,00	OTC						-6.529,49	-0,01
	NZD/EUR 4.000.000,00	OTC						-34.503,60	-0,03
	USD/EUR 2.300.000,00	OTC						4.589,92	0,00
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
	AUD/EUR 1.450.000,00	OTC						6.219,79	0,01
	CAD/EUR 2.400.000,00	OTC						4.547,73	0,00
	CHF/EUR 530.000,00	OTC						16.315,31	0,02
	CNH/USD 6.000.000,00	OTC						879,54	0,00
	GBP/EUR 9.000.000,00	OTC						-15.363,95	-0,02
	JPY/CHF 82.000.000,00	OTC						-1.688,33	0,00
	NZD/EUR 4.200.000,00	OTC						75.444,98	0,08
	SEK/EUR 11.600.000,00	OTC						17.648,87	0,02
	USD/EUR 69.136.458,60	OTC						-251.487,29	-0,24
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Devisen (Kauf)									
	CALL USD/HKD 7,82000 22.04.2024	OTC	USD	4.000.000			% 0,081	2.986,86	0,00
	Summe Devisen-Derivate						EUR	-181.289,85	-0,17
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsswaps									
(Erhalten/Zahlen)									
	IRS 0,316% JPY / TONAR JPY / CITIGLMD_FRA 18.07.2028	OTC	JPY	200.000.000				-4.718,85	0,00
	IRS 0,945% JPY / TONAR JPY / CITIGLMD_FRA 14.07.2038	OTC	JPY	200.000.000				-13.890,84	-0,01
	IRS 3,7111% USD / SOFR USD / BNP_PAR 15.02.2054	OTC	USD	2.500.000				21.364,22	0,02
Credit Default Swaps (CDS)									
Protection Seller									
	CDS ITRAXX EUROPE S41 V1 5Y / JPMORGAN_FRA 20.06.2029	OTC	EUR	-4.250.000				92.811,08	0,09
	Summe Swaps						EUR	69.137,97	0,07
Inflation Swaps (IFS)									
Protection Seller									
	IFS Euro HICP Ex-Tobacco EUR / 2,167% EUR / CITIGLMD_FRA 15.12.2028	OTC	STK	4.000.000				-26.427,64	-0,03
	Summe Swaps						EUR	69.137,97	0,07
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CZK	79.308,97			% 100,000	3.129,86	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	41.002,58			% 100,000	5.498,24	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HUF	356.903,08			% 100,000	903,37	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	6.870,90			% 100,000	587,30	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		PLN	20.797,53			% 100,000	4.816,36	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	242.174,39			% 100,000	145.739,81	0,14
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	31.386,88			% 100,000	21.381,22	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	4.410,32			% 100,000	4.510,59	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	18.309,95			% 100,000	21.391,25	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	2.435.019,00			% 100,000	14.907,21	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		MXN	244.110,32			% 100,000	13.632,88	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	129.740,64			% 100,000	71.717,55	0,07

Deka-RentenReal

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	425.916,07			% 100,000	394.695,64	0,39
	Summe Bankguthaben						EUR	702.911,28	0,67
	Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR	702.911,28	0,67
	Sonstige Vermögensgegenstände								
	Zinsansprüche		EUR	373.861,17				373.861,17	0,37
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	738.752,39				738.752,39	0,73
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	176,67				176,67	0,00
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	123,12				123,12	0,00
	Forderungen aus Devisenspots		EUR	1.252.982,40				1.252.982,40	1,25
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	2.365.895,75	2,35
	Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								
	EUR-Kredite bei der Verwahrstelle								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	-163.577,74			% 100,000	-163.577,74	-0,16
	Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	-5.668.415,95			% 100,000	-491.269,59	-0,49
	Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						EUR	-654.847,33	-0,65
	Sonstige Verbindlichkeiten								
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-58,29				-58,29	0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-133.277,40				-133.277,40	-0,13
	Verbindlichkeiten aus Derivategeschäften		EUR	-1.365,21				-1.365,21	0,00
	Verbindlichkeiten aus Devisenspots		EUR	-1.256.901,86				-1.256.901,86	-1,25
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-79.949,83				-79.949,83	-0,08
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-1.471.552,59	-1,46
	Fondsvermögen						EUR	100.548.385,27	100,00
	Umlaufende Anteile						STK	3.268.388,000	
	Anteilwert						EUR	30,76	

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

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
2,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.14/46	EUR 177.468		177.670,31	
1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/38	EUR 200.000		165.450,00	
1,8500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 10/27	EUR 1.600.000		2.209.640,42	
1,5000 % Rep. Frankreich OAT 15/31	EUR 1.000.000		925.000,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		3.477.760,73	3.477.760,73

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.03.2024

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85596	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45740	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,69920	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,53830	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,97777	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,31810	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	25,33950	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	395,08000	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,07910	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46797	= 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso	(MXN)	17,90600	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	163,34500	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,66169	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,80905	= 1 Euro (EUR)
Offshore Renminbi	(CNH)	7,83350	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XSES	Singapur - Singapore Exchange (SGX)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options

OTC Over-the-Counter

Deka-RentenReal

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000BU25018	2,4000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.188 23/28	EUR	1.000.000	1.000.000
NL0015000B11	0,0000 % Koenigreich Niederlande Anl. 21/38	EUR	0	200.000
ES0000012M69	2,0500 % Koenigreich Spanien Bonos Ind. Inflación 22/39	EUR	275.000	275.000
ES00000126A4	1,8000 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 14/24	EUR	0	850.000
ES0000012B70	0,1500 % Königreich Spanien Bonos Ind. Inflación 18/23	EUR	0	600.000
FR0011427848	0,2500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 13/24	EUR	0	900.000
FR0012558310	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 14/25	EUR	0	500.000
IE00BFZRPZ02	1,3000 % Republik Irland Treasury Bonds 18/33	EUR	0	1.500.000
PTOTEW0E0017	2,2500 % Republik Portugal Obr. 18/34	EUR	0	100.000
GBP				
GB00BNNGP882	0,1250 % Großbritannien Inflation-Ind. Lkd.Treas.St. 21/51	GBP	0	500.000
USD				
US912810FH69	3,8750 % U.S. Treasury Inflation-Ind. Bonds 99/29	USD	0	500.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
USD				
US912828Z377	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 20/30	USD	0	1.500.000
US912828Z263	0,1250 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 20/30	USD	0	1.000.000
US912810SM18	0,2500 % U.S. Treasury Inflation-Prot. Secs 20/50	USD	0	1.000.000
US9128285M81	3,1250 % U.S. Treasury Notes 18/28	USD	0	1.200.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
NZD				
NZIIIBDT003C0	3,0000 % Government of New Zealand Inflation Lkd Bds 13/30	NZD	0	3.000.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
	EUR	94.937
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), 10-YR Canadian Gov.Bond Future (CGB), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Ten-Year Commonw. Treas. Bonds Future (XT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (LUXY))		
Verkaufte Kontrakte:		
	EUR	51.284
(Basiswert(e): 10-YR Canadian Gov.Bond Future (CGB), 30-YR Canadian Gov.Bond Future (LGB), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), SGX Mini Jap. Government Bond Future (SJB), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Three-Year Commonw. Treas. Bd Future (YT), Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB), US Treasury Long Bond Future (US))		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	929
CAD/EUR	EUR	2.277
CHF/EUR	EUR	1.039
GBP/EUR	EUR	12.694
GBP/USD	EUR	357
JPY/EUR	EUR	721
JPY/USD	EUR	1.422
NZD/EUR	EUR	2.321
SEK/EUR	EUR	525
USD/EUR	EUR	75.983
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	1.809
AUD/GBP	EUR	61
CAD/EUR	EUR	3.793
CHF/EUR	EUR	1.598
GBP/EUR	EUR	23.892
GBP/USD	EUR	183
JPY/CHF	EUR	568
JPY/EUR	EUR	289
JPY/USD	EUR	1.454
NZD/EUR	EUR	4.725
SEK/EUR	EUR	1.061
USD/EUR	EUR	145.205
Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)		
Zinsswaps		
(Erhalten/Zahlen)	EUR	12.511
(Basiswert(e): IRS 5,1575% NZD / NZDBBAM03 NZD, IRS AUDBBM03 AUD/ 4,0525% AUD)		

Deka-RentenReal

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Credit Default Swaps (CDS)		
Protection Buyer: (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE SEN FINANCIALS S40 V1 5Y)	EUR	4.000
Protection Seller: (Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE S40 V1 5Y)	EUR	8.250
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet (Basiswert(e): 0,0000 % Koenigreich Niederlande Anl. 21/38, 0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 15/26, 0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 19/29, 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 14/30, 0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/40, 0,7000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 14/30, 1,3000 % Republik Irland Treasury Bonds 18/33, 1,8500 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 10/27, 2,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/46)	EUR	9.653

Deka-RentenReal

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	3.268.388
Anteilwert	EUR	30,76

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

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 zugrunde gelegt, die sich nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Für die Bewertung von Renten, rentenähnlichen Genussscheinen und Zertifikaten, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind, wird grundsätzlich der letzte verfügbare handelbare Kurs zugrunde gelegt. Renten, 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 mit marktnahen Kursstellungen (in der Regel Brokerquotes, alternativ mit sonstigen Preisquellen) bewertet, welche auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden. Die Bewertung von Schuldscheindarlehen erfolgt in der Regel mit Modellbewertungen, die von externen Dienstleistern bezogen und auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden.

Investmentanteile

Investmentanteile werden zum letzten von der Investmentgesellschaft festgestellten Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Börsenkurs bewertet.

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. 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, werden mit Verkehrswerten bewertet, 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.

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR

3.477.760,73

in % des Fondsvermögens

3,46

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

3.477.760,73

Sitzstaat

Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)

unbefristet

absolute Beträge in EUR

3.477.760,73

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. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

4.861.946,71

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

1.203,64

100,00

Kostenanteil des Fonds

397,22

33,00

Ertragsanteil der KVG

397,22

33,00

Der oben ausgewiesene Kostenanteil des Fonds bzw. Ertragsanteil der KVG beinhaltet sowohl den Aufwandsersatz der Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) als auch zusätzliche Kosten Dritter. Damit werden der Infrastrukturaufwand der Kapitalverwaltungsgesellschaft und die Kosten des externen Wertpapierdarlehen-Serviceproviders für die Anbahnung, Durchführung und Abwicklung inklusive der Sicherheitenstellung abgegolten.

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

3,49% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Wells Fargo & Co.	2.317.195,54
Berlin Hyp AG	2.225.460,72
Swedbank AB	319.290,44

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

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

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer	2
J.P. Morgan AG Frankfurt	2.636.485,98 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt	2.225.460,72 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

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

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

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

Die Summenangabe der Sicherheiten nach Instrumentenart, Restlaufzeit, Sicherheitenaussteller und Verwahrer kann rundungsbedingt von der Summe der angegebenen Einzelwerte abweichen.

Frankfurt am Main, den 2. April 2024
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 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 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,1 Mio.

Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Dr. Matthias Danne
Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main und der WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf

Stellvertretende Vorsitzende

Birgit Dietl-Benzin
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

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

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. März 2024

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



Deka Investment GmbH

Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

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

