

Halbjahresbericht  
zum 30. September 2023.

**Connect-Aktien Komfort**



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. September 2023

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Connect-Aktien Komfort für den Zeitraum vom 30. Juni 2023 bis zum 30. September 2023.

Im Berichtszeitraum entfernten sich die Teuerungsraten sukzessive von ihren Höchstständen und sorgten damit für eine gewisse Entlastung an den Finanzmärkten. Demgegenüber hat sich in Deutschland und im Euroraum die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,50 Prozent an. An den Rentenmärkten zogen die Renditen angesichts vorsichtiger Töne von den Notenbanken zuletzt erneut merklich an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,8 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 4,6 Prozent.

Die globalen Aktienbörsen präsentierten auf Halbjahressicht ein uneinheitliches Bild. Insbesondere in den USA und Japan konnten die Indizes Zuwächse verbuchen. In Europa überwogen die Minuszeichen und in China sorgten verschiedene Belastungsfaktoren wie u.a. der Immobiliensektor für einen kräftigen Rückgang. Der Euro zeigte sich im Verhältnis zum US-Dollar volatil und lag Ende September bei 1,06 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte merklich aufwärts und beendete die Berichtsperiode bei 95,3 US-Dollar je Barrel (Brent Future).

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](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 Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung



Dirk Degenhardt (Vorsitzender)



Dirk Heuser



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 30. September 2023	6
Vermögensaufstellung zum 30. September 2023	7
Anhang	10
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	11

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

# Connect-Aktien Komfort Anlagepolitik.

Das Anlageziel dieses Investmentfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, investiert der Fonds in Wertpapiere und Investmentanteile, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% des Fondsvermögens betragen muss. Der Aktieninvestitionsgrad beträgt ebenfalls mindestens 51% des Fondsvermögens. Daneben können unter anderem Anlagen in Geldmarktinstrumente, Bankguthaben und Sonstige Anlageinstrumente erfolgen.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Investmentfonds ausgewählt. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation nicht mit einem Index vergleichbar ist.

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

### Connect-Aktien Komfort

<b>Performance*</b>	<b>30.06.2023 - 30.09.2023</b>
	-0,2%
ISIN	DE000DKOLP06

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

# Connect-Aktien Komfort

## Vermögensübersicht zum 30. September 2023.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Investmentanteile</b>	<b>4.020.819,22</b>	<b>80,56</b>
Deutschland	176.944,72	3,55
Frankreich	162.048,73	3,25
Irland	1.167.437,84	23,38
Luxemburg	2.514.387,93	50,38
<b>2. Zertifikate</b>	<b>392.571,95</b>	<b>7,87</b>
Irland	392.571,95	7,87
<b>3. Derivate</b>	<b>2.150,00</b>	<b>0,04</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>427.113,56</b>	<b>8,57</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>390.683,04</b>	<b>7,84</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-243.483,72</b>	<b>-4,88</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>4.989.854,05</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Investmentanteile</b>	<b>4.020.819,22</b>	<b>80,56</b>
EUR	1.969.657,35	39,47
JPY	363.727,34	7,29
USD	1.687.434,53	33,80
<b>2. Zertifikate</b>	<b>392.571,95</b>	<b>7,87</b>
EUR	171.232,50	3,43
USD	221.339,45	4,44
<b>3. Derivate</b>	<b>2.150,00</b>	<b>0,04</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>427.113,56</b>	<b>8,57</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>390.683,04</b>	<b>7,84</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-243.483,72</b>	<b>-4,88</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>4.989.854,05</b>	<b>100,00</b>

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

# Connect-Aktien Komfort

## Vermögensaufstellung zum 30. September 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>392.571,95</b>	<b>7,87</b>
<b>Zertifikate</b>								<b>392.571,95</b>	<b>7,87</b>
<b>EUR</b>								<b>171.232,50</b>	<b>3,43</b>
XS2183935274	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 20/00	STK		3.750	3.750	0	EUR 45,662	171.232,50	3,43
<b>USD</b>								<b>221.339,45</b>	<b>4,44</b>
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18	STK		2.150	3.574	1.424	USD 74,488	150.984,44	3,03
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK		412	1.472	1.060	USD 181,130	70.355,01	1,41
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>4.020.819,22</b>	<b>80,56</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>176.944,72</b>	<b>3,55</b>
<b>EUR</b>								<b>176.944,72</b>	<b>3,55</b>
DE000ETFL284	Deka MSCI Europe UCITS ETF	ANT		11.754	11.754	0	EUR 15,054	176.944,72	3,55
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>3.843.874,50</b>	<b>77,01</b>
<b>EUR</b>								<b>1.792.712,63</b>	<b>35,92</b>
FR0011550185	BNPP.E.FR-S&P 500 UCITS ETF Actions au Port. C	ANT		8.071	8.071	0	EUR 20,078	162.048,73	3,25
LU1140883403	Eleva UCITS Fd-Eleva Euro.Sel. I2 acc.	ANT		53	53	0	EUR 1.800,970	95.451,41	1,91
LU2608816471	FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.	ANT		7.835	7.835	0	EUR 9,735	76.273,73	1,53
LU1731866494	GS Fds-GS Em.Mkts CORE Eq.Ptf. Reg.Shs I Acc.	ANT		8.657	8.657	0	EUR 10,360	89.686,52	1,80
IE00BRJG7840	Jan.Hend.C.-J.H.Gbl Life Sc.Fd Reg.Shares U Acc.	ANT		3.737	3.737	0	EUR 27,110	101.310,07	2,03
LU1136954127	Jan.Hend.-J.H.Pan European Fd Actions Nomi. G2	ANT		12.943	12.943	0	EUR 7,524	97.383,13	1,95
LU2040191186	JPMorgan-Eur. Equity Pl. Fd Act. Nom. I2 PERF Cap.	ANT		710	710	0	EUR 137,920	97.923,20	1,96
IE00BK5BC891	L&G-L&G Clean Water UCITS ETF Reg.Shares	ANT		3.712	6.160	2.448	EUR 13,488	50.067,46	1,00
LU1829218749	MUL-Am.BI.E.-W.Comm.xAgr.UETF Namens-Ant. Acc.	ANT		13.741	13.741	0	EUR 23,239	319.327,10	6,41
LU1829219390	MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UCETF Namens-Ant. Acc.	ANT		789	789	0	EUR 118,914	93.823,15	1,88
LU1516331532	Nin.One GI.Str.Fd-GI.Franchise Act. Nom. I Acc.	ANT		1.342	1.342	0	EUR 37,690	50.579,98	1,01
IE00B3WVRB16	Polar Cap.Fd.-Biotechnology Fd Reg.Shares I	ANT		2.807	2.807	0	EUR 34,870	97.880,09	1,96
LU0329356306	R.C.G.-Rob.QI Em.Mkts Act.Equ. Act. Nom. CI	ANT		344	344	0	EUR 241,300	83.007,20	1,66
IE00BKSCBX74	UBS(I)ETF-MSCI Wld Sm.C Soc.Resp.Reg.Shs A Dis.	ANT		9.240	9.240	0	EUR 8,177	75.555,48	1,51
IE00B6TYHG95	WMF(I)-W.Strat.Europ.Equity Fd Reg.Shs CIS Acc.	ANT		2.723	2.723	0	EUR 36,304	98.854,43	1,98
IE000XOQ9TK4	Xtr.IEXtr.MSCI Nxt Gen.Int.In. Reg.Shs 1C Acc.	ANT		755	755	0	EUR 33,400	25.217,00	0,51
LU0274209237	Xtrackers MSCI Europe 1C	ANT		2.335	2.335	0	EUR 76,370	178.323,95	3,57
<b>JPY</b>								<b>363.727,34</b>	<b>7,29</b>
LU1013116519	Alma C.I.F.-A.Ei.J.L.Cap Eq Fd Nam.-AnI Cap.	ANT		1.276	1.276	0	JPY 27.831,000	225.046,62	4,51
LU0274209740	Xtrackers MSCI Japan 1C	ANT		2.103	5.581	3.478	JPY 10.406,000	138.680,72	2,78
<b>USD</b>								<b>1.687.434,53</b>	<b>33,80</b>
LU0368250220	BGF - US Flexible Equity Fd Actions Nominatives I2	ANT		3.332	3.332	0	USD 37,200	116.857,17	2,34
LU1457522305	Fidelity Fds-GI Technology Reg.Shares I Acc.	ANT		3.844	3.844	0	USD 34,650	125.572,36	2,52
IE00BFD2H405	First T.G.F.-Cl.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A	ANT		849	1.287	438	USD 31,455	25.177,05	0,50
IE00BMTX1Y45	iShs VI-iSh.S&P 500 Swap U.E. Reg.Shares (Acc.)	ANT		24.618	24.618	0	USD 6,901	160.171,34	3,21
IE00BG0J4C88	iShsIV-Digital Security UC.ETF Reg.Shares (Acc.)	ANT		3.953	6.073	2.120	USD 6,721	25.047,71	0,50
LU1727362110	JPMorg.I.-US Select Equity Fd Act. Nom. I2 Acc.	ANT		694	694	0	USD 179,590	117.503,03	2,35
IE00BF0GL329	Polar Cap.-Artificial Intelli. Reg.Shares I Acc.	ANT		3.155	3.155	0	USD 16,280	48.424,06	0,97
IE000GSDD6V5	Polar CAPITAL Fds-Sm.Mobility Reg.Shs I Acc.	ANT		4.603	7.134	2.531	USD 8,430	36.582,72	0,73
LU2016064037	Schroder ISF - GI.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	ANT		219	339	120	USD 163,334	33.723,19	0,68
LU2016067568	Schroder ISF - Health.Innov. Act. Nom. IZ Acc.	ANT		263	352	89	USD 149,254	37.007,50	0,74
LU2016213212	Schroder ISF All China Equity Act. Nom. IZ Acc.	ANT		2.405	2.405	0	USD 114,089	258.682,73	5,18
LU2016221660	Schroder ISF US Large Cap Act. Nom. IZ Acc.	ANT		419	419	0	USD 302,048	119.315,65	2,39
IE00BWBXM492	SPDR S+P US Energ.Sel.Sec.UETF Reg.Shares	ANT		2.756	6.471	3.715	USD 34,403	89.387,47	1,79
IE00BTJRM35	Xtr.(IE)-MSCI Emerging Markets Reg.Shares 1C	ANT		3.363	5.319	1.956	USD 48,260	153.010,63	3,07

# Connect-Aktien Komfort

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
IE00BCHWNW54	Xtr.(IE)-MSCI USA Health Care Reg.Shares 1D		ANT	3.687	3.687	0	USD 52,000	180.752,33	3,62
LU0490618542	Xtrackers S&P 500 Swap 1C		ANT	2.036	2.036	0	USD 83,470	160.219,59	3,21
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 4.413.391,17</b>	<b>88,43</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Dez. 23		XEUR	EUR	Anzahl -2				2.150,00	0,04
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR 2.150,00</b>	<b>0,04</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	39.955,33			% 100,000	39.955,33	0,80
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	29.151,85			% 100,000	27.483,60	0,55
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR 67.438,93</b>	<b>1,35</b>
<b>Geldmarktfonds</b>									
<b>Gruppeneigene Geldmarktfonds</b>									
LU0052863874	DekaLux-Geldmarkt: Euro		ANT	7.523,00	15.499	7.976	EUR 47,810	359.674,63	7,22
<b>Summe Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 359.674,63</b>	<b>7,22</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 427.113,56</b>	<b>8,57</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	5.603,40				5.603,40	0,11
Forderungen aus Wertpapiergeschäften			EUR	325.097,76				325.097,76	6,53
Forderungen aus Devisenspots			EUR	59.941,77				59.941,77	1,20
Sonstige Forderungen			EUR	40,11				40,11	0,00
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR 390.683,04</b>	<b>7,84</b>
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>									
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	-698,00			% 100,000	-4,42	0,00
<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>								<b>EUR -4,42</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften			EUR	-182.660,24				-182.660,24	-3,66
Verbindlichkeiten aus Devisenspots			EUR	-59.394,74				-59.394,74	-1,19
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-1.424,32				-1.424,32	-0,03
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR -243.479,30</b>	<b>-4,88</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>EUR 4.989.854,05</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>								<b>STK 500.000,000</b>	
<b>Anteilwert</b>								<b>EUR 9,98</b>	

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

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.09.2023

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06070 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	157,80000 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

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>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>USD</b>				
IE00BWBXMB69	SPDR S+P US Utilit.Sel.Se.UETF Reg.Shares	ANT	5.142	5.142

## Gattungsbezeichnung

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>		

# Connect-Aktien Komfort

<b>Gattungsbezeichnung</b>	<b>Stück bzw. Anteile bzw. Whg.</b>	<b>Volumen in 1.000</b>
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): Russell 2000 Index)	EUR	262
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))	EUR	89
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
USD/EUR	EUR	2.383

# Connect-Aktien Komfort

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	500.000
Anteilwert	EUR	9,98

### 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)

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 2. Oktober 2023  
Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

## Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

## Sitz

Frankfurt am Main

## Gründungsdatum

16.09.1988

## Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 22,4 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 Investment 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 Investment GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,  
Wiesbaden

### Mitglieder

Wolfgang Dürr, Trier

Rita Geyermann  
Direktorin der KfW-Bankengruppe, Frankfurt am Main

Victor Mofitakhar, Bad Nauheim

Sabine Schmittroth  
Geschäftsführende Gesellschafterin der sajos GmbH,  
Frankfurt am Main

## Geschäftsführung

Dirk Degenhardt (Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der bevestor GmbH, Frankfurt am Main

Dirk Heuser

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

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

## 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: 30. September 2023

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



**Deka Vermögens-  
management GmbH**

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

Telefon: (0 69) 71 47 - 85 00  
Telefax: (0 69) 71 47 - 86 50  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

 **Finanzgruppe**