

Halbjahresbericht
zum 31. Dezember 2022.
Deka-Vega Plus

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. Dezember 2022

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Vega Plus für den Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis zum 31. Dezember 2022.

Ereignispolitisch dominierten nach wie vor der russische Angriffskrieg auf die Ukraine und die Auswirkungen auf die verschiedenen Volkswirtschaften das Geschehen an den internationalen Kapitalmärkten. Sanktionsmaßnahmen des Westens veranlassten umgekehrt Russland zu einem Lieferstopp bzw. zu reduzierten Liefermengen von Gas an verschiedene europäische Länder. Exorbitante Preissteigerungen sowie wachsende Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im bevorstehenden Winter sorgten für große Verunsicherung, insbesondere in Europa. Gut gefüllte Gasspeicher und leicht gesunkene Inflationszahlen führten zuletzt jedoch zu einer leichten Entspannung. Daneben führte die Null-Covid-Politik in China mit damit einhergehenden Lockdown-Maßnahmen zu wiederholten Beeinträchtigungen im internationalen Handel, die sich auch an den Finanzmärkten niederschlugen.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtshalbjahr die sprunghafte Inflationsentwicklung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu einer restriktiveren Geldpolitik zwang. Während die Fed zum Stichtag mittlerweile bei einem Leitzinsintervall von 4,25 bis 4,50 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen seit Juli 2022 bislang erst auf 2,50 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in den kommenden Monaten in Aussicht gestellt, wobei die Zinsschritte zuletzt gemäßiger ausfielen. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo merklich an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,6 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,9 Prozent.

Das Gros der Börsen bewegte sich im Berichtszeitraum unter Schwankungen seitwärts mit einer leicht positiven Tendenz. Dabei wechselten sich unterstützende Signale, wie etwa die Hoffnung auf eine weniger aggressive Fortführung der restriktiven Geldpolitik in den USA, mit Belastungsfaktoren und Unsicherheiten hinsichtlich der zukünftigen Energiesicherheit und der hohen Inflation in Kombination mit dem Krieg in der Ukraine ab. Stark unter Druck geriet der Euro, der zeitweise unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, ehe in den letzten Monaten eine deutliche Erholung festzustellen war.

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
Anteilklassen im Überblick	6
Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022	7
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022	8
Anhang	11
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	13

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-Vega Plus

Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Deka-Vega Plus ist die Erzielung einer positiven Rendite unabhängig von der Marktentwicklung bzw. -richtung auf Grundlage einer Volatilitätsstrategie.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde und er verfolgt eine Volatilitätsstrategie. Damit ist eine Strategie gemeint, die der Schwankungsintensität von für das Sondervermögen relevanten Basiswerten über einen bestimmten Zeitraum Rechnung trägt. Hierfür werden vom Fondsmanagement auf Basis eines eigens entwickelten quantitativen Systems mehrere Einzelstrategien umgesetzt, die abhängig vom aktuellen Marktumfeld sind. Die eingesetzten Einzelstrategien werden nach einem Relative Value-Ansatz gesteuert, um gezielt relative Ungleichgewichte z.B. in der Volatilität verschiedener Märkte, Zeitstruktur der Volatilität eines Marktes, etc. gewinnbringend zu nutzen. Die Umsetzung dieser Strategie erfolgt weitestgehend über Derivate. Außerdem investiert der Fonds u.a. in verzinsliche Wertpapiere (Mindestrating: BBB-).

Die Anlagekriterien des Fonds entsprechen den Vorgaben der deutschen Verordnung über die Anlage des Sicherungsvermögens von Pensionskassen, Sterbekassen und kleinen Versicherungsunternehmen (Anlageverordnung). Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Die Erträge eines Geschäftsjahres werden grundsätzlich ausgeschüttet.

Die Anleger können börsentäglich die Rücknahme der Anteile verlangen. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Rücknahme aussetzen oder einschränken, wenn außergewöhnliche Umstände dies zur Wahrnehmung der Anlegerinteressen erforderlich erscheinen lassen. Setzt die Verwaltungsgesellschaft die Rücknahme von Anteilen ganz oder teilweise aus und lehnt daher die Rücknahme der Anteile ganz (Rücknahmeaussetzung) oder teilweise (Rücknahmebeschränkung) ab, kann dies dazu führen, dass der Auftrag ganz zu einem späteren Zeitpunkt ausgeführt wird oder dass ein Auftrag in Höhe seines nicht ausgeführten Anteils erlischt.

Wichtige Kennzahlen

Deka-Vega Plus

Performance*	6 Monate
Anteilklasse I (A)	0,2%
01.08.2022 - 31.12.2022	
Anteilklasse CF (A)	-1,4%
ISIN	
Anteilklasse I (A)	DE0005424568
Anteilklasse CF (A)	DE000DK0V7W1

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

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung, der Vertriebsvergütungen, der erfolgsabhängigen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von zwei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung und der Mindestanlagesumme sowie der Vertriebsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung I (A) und CF (A).

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

Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Mindestanlagesumme	Ertragsverwendung
Anteilklasse I (A)	0,60% p.a.	keiner	EUR 50.000	Ausschüttung
Anteilklasse CF (A)	0,80% p.a.	1,50%	keine	Ausschüttung

* Der Verwaltungsvergütungssatz wird auf das durchschnittliche Fondsvermögen berechnet, das sich aus den Tageswerten zusammensetzt.

** Die Vertriebsvergütung wird durch die Verwaltungsvergütung abgedeckt und wird dem Sondervermögen nicht gesondert belastet.

Deka-Vega Plus

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	24.517.522,00	67,35
Australien	697.378,50	1,92
Belgien	1.078.698,00	2,96
Deutschland	3.876.985,00	10,65
Finnland	892.404,00	2,45
Frankreich	3.746.497,50	10,29
Irland	907.434,00	2,49
Kanada	2.559.872,00	7,03
Niederlande	3.156.225,00	8,68
Norwegen	577.731,00	1,59
Österreich	1.847.215,00	5,08
Schweden	1.553.420,00	4,26
Sonstige	1.996.720,00	5,48
USA	1.626.942,00	4,47
2. Derivate	6.411.083,18	17,60
3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	5.338.322,89	14,66
4. Sonstige Vermögensgegenstände	163.516,86	0,45
II. Verbindlichkeiten	-23.042,10	-0,06
III. Fondsvermögen	36.407.402,83	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	24.517.522,00	67,35
EUR	24.517.522,00	67,35
2. Derivate	6.411.083,18	17,60
3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	5.338.322,89	14,66
4. Sonstige Vermögensgegenstände	163.516,86	0,45
II. Verbindlichkeiten	-23.042,10	-0,06
III. Fondsvermögen	36.407.402,83	100,00

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

Deka-Vega Plus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								23.021.095,50	63,24
Verzinsliche Wertpapiere								23.021.095,50	63,24
EUR								23.021.095,50	63,24
XS1856791873	0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. MTN 18/23	EUR		800.000	0	0	% 98,996	791.964,00	2,18
FR0012861821	1,5000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 15/23	EUR		700.000	0	0	% 99,426	695.982,00	1,91
XS1458405898	0,7500 % Bank of America Corp. MTN 16/23	EUR		750.000	750.000	0	% 99,076	743.070,00	2,04
FR0013367406	0,6250 % BPCE S.A. MTN 18/23	EUR		800.000	0	0	% 98,474	787.792,00	2,16
DE000CZ40M21	0,5000 % Commerzbank AG MTN IHS S.903 18/23	EUR		800.000	0	0	% 98,660	789.276,00	2,17
XS1956955980	0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR		800.000	0	0	% 97,213	777.700,00	2,14
XS2016807864	0,5000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Non-Pref. MTN 19/24	EUR		800.000	800.000	0	% 96,043	768.344,00	2,11
DE000DL19UC0	1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 18/23 ¹⁾	EUR		600.000	0	0	% 99,020	594.120,00	1,63
FR0013463643	0,0000 % EssilorLuxottica S.A. MTN 19/23	EUR		700.000	0	0	% 99,237	694.655,50	1,91
XS0942094805	2,5000 % Essity AB MTN 13/23	EUR		800.000	0	0	% 99,829	798.628,00	2,19
EU000A1G0EA8	0,2000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 18/24	EUR		1.000.000	0	0	% 97,288	972.880,00	2,67
XS0290050524	4,1250 % European Investment Bank MTN 07/24	EUR		1.000.000	0	0	% 102,384	1.023.840,00	2,81
BE0002280494	1,3750 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Bonds 17/24	EUR		500.000	0	0	% 97,500	487.500,00	1,34
XS1882544627	1,0000 % ING Groep N.V. MTN 18/23	EUR		900.000	0	0	% 98,527	886.743,00	2,44
BE0002266352	0,7500 % KBC Groep N.V. MTN 16/23	EUR		600.000	0	0	% 98,533	591.198,00	1,62
DE000A3E5XK7	0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 21/24	EUR		800.000	0	0	% 94,825	758.600,00	2,08
DE000LB2CHW4	0,3750 % Ldsbk Baden-Württemb. MTN S.806 19/24	EUR		1.000.000	0	0	% 95,613	956.125,00	2,63
XS1379171140	1,7500 % Morgan Stanley MTN 16/24	EUR		900.000	900.000	0	% 98,208	883.872,00	2,43
DE000MHB21J0	0,2500 % Münchener Hypothekenbank MTN Hyp.-Pfe.S.1803 18/23	EUR		800.000	0	0	% 97,358	778.864,00	2,14
XS1496770626	0,0000 % National Bank of Canada MT Cov. Bds 16/23	EUR		800.000	800.000	0	% 97,803	782.424,00	2,15
XS1550988569	0,8750 % NN Group N.V. MTN 17/23	EUR		700.000	0	0	% 99,974	699.818,00	1,92
XS2189614014	0,0000 % OMV AG MTN 20/23	EUR		800.000	0	0	% 98,983	791.864,00	2,18
FI4000079041	2,0000 % Republik Finnland Bonds 14/24	EUR		900.000	900.000	0	% 99,156	892.404,00	2,45
IE00B6X95T99	3,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 14/24	EUR		900.000	0	0	% 100,826	907.434,00	2,49
AT0000A28KX7	0,0000 % Republik Österreich MTN 19/24	EUR		1.100.000	1.100.000	0	% 95,941	1.055.351,00	2,90
XS1942615607	0,2500 % Royal Bank of Canada MT Mortg.Cov. Bds 19/24	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 97,840	978.400,00	2,69
XS1718306050	0,5000 % Société Générale S.A. Non-Pref. MTN 17/23	EUR		800.000	0	0	% 99,966	799.724,00	2,20
XS1967582831	0,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA Preferred MTN 19/24	EUR		600.000	0	0	% 96,289	577.731,00	1,59
XS1759602953	0,5000 % The Swedish Covered Bond Corp. MTN 18/25	EUR		800.000	0	0	% 94,349	754.792,00	2,07
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								1.496.426,50	4,11
Verzinsliche Wertpapiere								1.496.426,50	4,11
EUR								1.496.426,50	4,11
XS0918600668	2,5000 % Great-West Lifeco Inc. Bonds 13/23	EUR		800.000	0	0	% 99,881	799.048,00	2,19
XS1383389670	1,3750 % Scentre Management Ltd./RE1 MTN 16/23	EUR		700.000	0	0	% 99,626	697.378,50	1,92
Summe Wertpapiervermögen								EUR 24.517.522,00	67,35
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Optionsrechte								6.421.383,91	17,63
Optionsrechte auf Aktienindices								6.421.383,91	17,63
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Call Juni 23 1000		XEUR		Anzahl 130			EUR 2.749,136	3.573.877,37	9,81
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Call Juni 23 6000		XEUR		Anzahl -130			EUR 0,008	-10,64	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 23 1000		XEUR		Anzahl -130			EUR 0,053	-68,87	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 23 6000		XEUR		Anzahl 130			EUR 2.190,451	2.847.586,05	7,82
Summe Aktienindex-Derivate								EUR 6.421.383,91	17,63

Deka-Vega Plus

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Sonstige Derivate									
Sonstige Terminkontrakte									
	CBOE Volatility Index Future (VIX) Feb. 23	XCBO	USD	Anzahl -53.000				-10.300,73	-0,03
	VSTOXX Index Future (V2TX) Feb. 23	XEUR	EUR	Anzahl 50.000				44.699,27	0,12
	Summe Sonstige Derivate						EUR	-10.300,73	-0,03
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	2.054.851,87			% 100,000	2.054.851,87	5,64
EUR-Guthaben bei									
	Bayerische Landesbank		EUR	193.287,60			% 100,000	193.287,60	0,53
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	1.177.249,96			% 100,000	1.177.249,96	3,23
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	3.676,47			% 100,000	2.341,41	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	1.401,25			% 100,000	970,12	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	3.305,12			% 100,000	3.350,94	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	2.563,61			% 100,000	2.896,18	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	102.647,00			% 100,000	729,93	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	2.030.597,75			% 100,000	1.902.644,88	5,23
	Summe Bankguthaben						EUR	5.338.322,89	14,66
	Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR	5.338.322,89	14,66
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	162.518,64				162.518,64	0,45
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	12,42				12,42	0,00
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	985,80				985,80	0,00
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	163.516,86	0,45
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-4,10				-4,10	0,00
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-23.038,00				-23.038,00	-0,06
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-23.042,10	-0,06
Fondsvermögen									
	Umlaufende Anteile Klasse I (A)						EUR	36.407.402,83	100,00
	Umlaufende Anteile Klasse CF (A)						STK	547.001,000	
	Anteilwert Klasse I (A)						STK	287,000	
	Anteilwert Klasse CF (A)						EUR	66,51	
							EUR	98,57	

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

¹⁾ 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:				
1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 18/23	EUR 100.000		99.020,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		99.020,00	99.020,00

Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 1.349.761,00

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.12.2022

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88517 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,98633 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06725 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,44442 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	140,62500 = 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,57020 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)

Deka-Vega Plus

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				
XS1690676439	0,3820 % Dexia Crédit Local S.A. FLR MTN 17/22	EUR	0	1.100.000
DE000A1PGWA5	2,3750 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. MTN 12/22	EUR	0	800.000
XS1529838085	1,0000 % Morgan Stanley MTN 16/22	EUR	0	900.000

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		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): S&P 500 Index)	EUR	17.263
Verkaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	32.351
Sonstige Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): CBOE Volatility Index (VIX), VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	17.797
Verkaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): CBOE Volatility Index (VIX), VSTOXX Volatilitätsindex)	EUR	23.297
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	419.942
Verkaufte Kaufoptionen (Call):		
(Basiswert(e): S&P 500 Index)	EUR	459.088
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))	EUR	57.730
Sonstige Optionsrechte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): CBOE Volatility Index (VIX))	EUR	6.999
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	8.392
(Basiswert(e): 0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 21/24, 0,3750 % Ldsbk Baden-Württemb. MTN S.806 19/24, 0,5000 % Société Générale S.A. Non-Pref. MTN 17/23, 1,0000 % Morgan Stanley MTN 16/22, 1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 18/23, 1,3750 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Bonds 17/24, 1,3750 % Scentre Management Ltd./RE1 MTN 16/23, 1,5000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 15/23)		

Deka-Vega Plus

Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse I (A)	STK	547,001
Umlaufende Anteile Klasse CF (A)	STK	287
Anteilwert Klasse I (A)	EUR	66,51
Anteilwert Klasse CF (A)	EUR	98,57

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 Umsatzzolumina 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)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	99.020,00	0,27

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	99.020,00	Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	99.020,00

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 Anleiherrating, 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	absolute Beträge in EUR
unbefristet	287.208,00

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	531,56	100,00
Kostenanteil des Fonds	175,43	33,00
Ertragsanteil der KVG	175,43	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

Deka-Vega Plus

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

0,40% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen

Kreditanstalt für Wiederaufbau

absolutes Volumen der
empfangenen Sicherheiten in EUR
287.208,00

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

1

Clearstream Banking Frankfurt

287.208,00 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.

Verwahrart 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%

Verwahrart 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. Januar 2023
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 2021

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

Alleingesellschafterin

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 Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH, Köln
und der Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln;
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;
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Square
Am Flughafen
60549 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. Dezember 2022

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

