

Halbjahresbericht
zum 31. März 2022.

WertpapierStrategiePortfolio A

Ein Gemischtes Sondervermögen deutschen Rechts (AIF).



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. März 2022

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds WertpapierStrategiePortfolio A für den Zeitraum vom 1. Oktober 2021 bis zum 31. März 2022.

Bis in den Februar 2022 hinein beherrschte die Corona-Pandemie über weite Strecken die Schlagzeilen im Berichtszeitraum, wobei sich die Erholung der Wirtschaft in Euroland im Verlauf spürbar abschwächte. Angesichts der starken Lieferkettenprobleme sowie steigender Rohstoff- und Energiepreise kam es zu einer Verlangsamung des Wachstumstempos. Ende Februar veränderte der völkerrechtswidrige Angriff Russlands auf die Ukraine das Bild jedoch schlagartig und dominiert seitdem das Geschehen an den internationalen Finanzmärkten. Umfangreiche und wirkungsvolle Sanktionsmaßnahmen wurden in großer Geschlossenheit gegen den russischen Aggressor auf den Weg gebracht, doch Versuche, den Konflikt auf diplomatischem Weg zu entschärfen, scheiterten bisher an der unnachgiebigen Haltung Moskaus. Für Beunruhigung sorgten zudem Lieferengpässe bei Rohstoffen und Vorprodukten sowie signifikant ansteigende Inflationsraten. In der Eurozone sind die Verbraucherpreise im März 2022 um 7,5 Prozent gestiegen, den höchsten Wert seit Bestehen des Euro.

Die Geld- und Fiskalpolitik war über weite Strecken von Unterstützungsmaßnahmen hinsichtlich der Corona-Krise geprägt, bevor die Inflationsentwicklung immer stärker in den Vordergrund rückte. Sowohl die EZB als auch die Federal Reserve haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet. Darüber hinaus vollzog die US-Notenbank im März den ersten Schritt der angekündigten Leitzinswende und erhöhte diesen um 25 Basispunkte. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen im Verlauf unter Schwankungen an. Ende März rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 0,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen zuletzt bei plus 2,3 Prozent.

Die Aktienmärkte zeigten auf Sicht der letzten sechs Monate ein uneinheitliches Bild und konnten ihre zwischenzeitlichen Gewinne überwiegend nicht halten. Vor allem in den letzten Wochen des Berichtszeitraums flammte die Unsicherheit angesichts der militärischen Eskalation in der Ukraine auf, was sich in einer entsprechend hohen Schwankungsbreite an den Märkten niederschlug. Auch der Ölpreis spiegelte dies wider, zuletzt kostete ein Barrel Öl der Sorte Brent wieder über 100 US-Dollar.

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 2022	6
Vermögensaufstellung zum 31. März 2022	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.

WertpapierstrategiePortfolio A

Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Fonds ist die Erwirtschaftung eines mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachses durch die Investition in ein breit gestreutes Portfolio.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Hierfür kann der Fonds in globale Aktien, Anleihen und Investmentanteile investieren. Zusätzlich kann in liquide Geldanlagen angelegt werden. Der Investmentprozess basiert auf dem Ziel durch ein maximal diversifiziertes Portfolio ein im offensiven Bereich optimales Verhältnis von Rendite zu Risiko zu erreichen. Um dieses Verhältnis in möglichst allen Marktphasen sicherstellen zu können, werden stets verschiedene Investmentstile und Manager miteinander kombiniert. Bei der Kombination der Manager und Investmentstile werden bestmögliche Korrelationseigenschaften angestrebt, um das Risiko in fallenden Märkten zu begrenzen und zeitgleich bei steigenden Märkten einen angemessenen Performancebeitrag zu erreichen. Die beauftragten Asset-Management-Gesellschaften setzen ihre Anlagestrategien in voneinander getrennten Segmenten um, wobei sich das Gesamtvolumen des Fonds zwischen den jeweiligen Segmenten aufteilt. Zur Messung des Auswahlprozesses steht kein geeigneter Index zur Verfügung, da in unterschiedliche Strategien mit unterschiedlichen Universen investiert wird. Eine langfristig, feste Gewichtung von Regionen, Sektoren oder Größenklassen ist nicht vorgesehen. Daher wird, aufgrund der fehlenden Vergleichbarkeit in der Zusammensetzung von Index und Fondsallokation, auf die Nutzung eines Referenzwertes verzichtet.

Der Fonds legt mehr als 50% des Aktivvermögens (Wert der Vermögensgegenstände ohne Berücksichtigung von Verbindlichkeiten) in Kapitalbeteiligungen i.S.d. § 2 Abs. 8 InvStG an.

Für den Fonds fungiert das Münster Stegmaier Rombach Family Office als Berater.

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

Die Erträge eines Geschäftsjahres werden bei diesem Fonds 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

WertpapierstrategiePortfolio A

Performance*	6 Monate
	-2,1%
ISIN	DE000DK0LJ87
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

Die Portfolioverwaltung für das Sondervermögen WertpapierstrategiePortfolio A wird von der Deka Investment GmbH und seit dem 30. September 2021 auch von der LOYS AG mit Sitz in Oldenburg übernommen.

WertpapierstrategiePortfolio A

Vermögensübersicht zum 31. März 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	42.578.945,12	9,63
Belgien	732.000,00	0,17
Deutschland	10.605.033,72	2,41
Finnland	680.298,04	0,15
Frankreich	2.170.148,40	0,49
Großbritannien	4.416.660,11	1,00
Irland	1.116.992,60	0,25
Italien	2.952.000,00	0,67
Luxemburg	1.420.760,43	0,32
Malta	673.967,69	0,15
Niederlande	2.875.701,47	0,65
Norwegen	1.729.149,64	0,39
Schweden	4.271.133,46	0,96
Schweiz	2.257.000,00	0,51
USA	6.678.099,56	1,51
2. Investmentanteile	378.248.690,26	85,41
Deutschland	112.707.818,36	25,45
Irland	54.710.353,50	12,36
Luxemburg	196.498.918,49	44,36
Schweiz	14.331.599,91	3,24
3. Sonstige Wertpapiere	520,00	0,00
Deutschland	520,00	0,00
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	22.144.185,39	5,01
5. Sonstige Vermögensgegenstände	8.365,84	0,00
II. Verbindlichkeiten	-234.602,14	-0,05
III. Fondsvermögen	442.746.104,47	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	42.578.945,12	9,63
EUR	22.946.149,32	5,20
GBP	4.416.660,11	1,00
NOK	3.149.910,07	0,71
SEK	4.271.133,46	0,96
USD	7.795.092,16	1,76
2. Investmentanteile	378.248.690,26	85,41
EUR	347.005.663,04	78,35
USD	31.243.027,22	7,06
3. Sonstige Wertpapiere	520,00	0,00
EUR	520,00	0,00
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	22.144.185,39	5,01
5. Sonstige Vermögensgegenstände	8.365,84	0,00
II. Verbindlichkeiten	-234.602,14	-0,05
III. Fondsvermögen	442.746.104,47	100,00

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

WertpapierstrategiePortfolio A

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								38.224.354,48	8,64
Aktien								38.223.834,48	8,64
EUR								20.557.140,03	4,66
DE0005167902	3U Holding AG Inhaber-Aktien	STK		208.604	208.604	0	EUR 2,780	579.919,12	0,13
DE000A3CNK42	ABOUT YOU Holding SE Inhaber-Aktien	STK		44.475	44.475	0	EUR 12,570	559.050,75	0,13
BE0003755692	Agfa-Gevaert N.V. Actions au Porteur	STK		200.000	200.000	0	EUR 3,660	732.000,00	0,17
IT0001479523	Be Shaping the Future S.p.A. Azioni nom.	STK		900.000	900.000	0	EUR 3,280	2.952.000,00	0,67
NL0010776944	Brunel International N.V. Aandelen an toonder	STK		180.000	180.000	0	EUR 11,080	1.994.400,00	0,45
DE0005550636	Drägerwerk AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsakt.	STK		10.100	10.100	0	EUR 50,750	512.575,00	0,12
CH0303692047	EDAG Engineering Group AG Inhaber-Aktien	STK		185.000	185.000	0	EUR 12,200	2.257.000,00	0,51
DE000A161408	HelloFresh SE Inhaber-Aktien	STK		30.000	30.000	0	EUR 43,540	1.306.200,00	0,30
DE0007193500	Koenig & Bauer AG Inhaber-Aktien	STK		70.000	70.000	0	EUR 20,850	1.459.500,00	0,33
DE000A2DA588	MAX Automation SE Namens-Aktien	STK		520.000	520.000	0	EUR 4,000	2.080.000,00	0,47
NL0000360618	SBM Offshore N.V. Aandelen op naam	STK		61.479	61.479	0	EUR 14,335	881.301,47	0,20
FR0000121709	SEB S.A. Actions Port.	STK		7.897	7.897	0	EUR 127,200	1.004.498,40	0,23
DE000A2YN900	TeamViewer AG Inhaber-Aktien	STK		80.000	80.000	0	EUR 13,835	1.106.800,00	0,25
DE000A0XYGA7	technotrans SE Namens-Aktien	STK		37.072	37.072	0	EUR 23,200	860.070,40	0,19
FI4000252127	Terveystalo OYJ Reg.Shares	STK		60.097	60.097	0	EUR 11,320	680.298,04	0,15
DE000A1YC996	The Social Chain AG Namens-Aktien	STK		22.239	22.239	0	EUR 19,150	425.876,85	0,10
FR0011981968	Worldline S.A. Actions Port.	STK		28.500	28.500	0	EUR 40,900	1.165.650,00	0,26
GBP								3.678.339,64	0,83
GB0004270301	Hill & Smith Holdings PLC Reg.Shares	STK		30.000	30.000	0	GBP 14,940	527.933,85	0,12
GB00B06QFB75	IG Group Holdings PLC Reg.Shares	STK		90.000	90.000	0	GBP 8,290	878.829,64	0,20
GB0005630420	Mears Group PLC Reg.Shares	STK		950.000	950.000	0	GBP 2,030	2.271.576,15	0,51
NOK								3.149.910,07	0,71
NO0004822503	Atea ASA Navne-Aksjer	STK		93.560	93.560	0	NOK 133,000	1.293.729,66	0,29
NO0010360266	Bouvet ASA Navne-Aksjer	STK		60.000	60.000	0	NOK 69,800	435.419,98	0,10
LU0075646355	Subsea 7 S.A. Reg.Shares	STK		165.000	165.000	0	NOK 82,820	1.420.760,43	0,32
SEK								3.043.352,58	0,68
SE0007897079	AcadeMedia AB Namn-Aktier	STK		289.670	289.670	0	SEK 51,300	1.438.250,01	0,32
SE0000421273	Knowit AB Namn-Aktier	STK		25.000	25.000	0	SEK 309,500	748.883,33	0,17
SE0015346135	Stillfront Group AB Namn-Aktier	STK		325.000	325.000	0	SEK 27,220	856.219,24	0,19
USD								7.795.092,16	1,76
US90214J1016	2U Inc. Reg.Shares	STK		129.882	129.882	0	USD 13,080	1.523.296,62	0,34
IE0003LFZ4U7	DOLE PLC Reg.Shares	STK		100.300	100.300	0	USD 12,420	1.116.992,60	0,25
US29261A1007	Encompass Health Corp. Reg.Shares	STK		20.000	25.000	5.000	USD 71,120	1.275.409,10	0,29
US29786A1060	Etsy Inc. Reg.Shares	STK		8.000	8.000	0	USD 134,560	965.236,49	0,22
US3802371076	GoDaddy Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		20.862	20.862	0	USD 84,790	1.586.091,89	0,36
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc. Reg.Shares	STK		12.500	12.500	0	USD 118,490	1.328.065,46	0,30
Andere Wertpapiere								520,00	0,00
EUR								520,00	0,00
DE000A3MQRX9	MAX Automation SE Inhaber-Bezugsrechte	STK		520.000	520.000	0	EUR 0,001	520,00	0,00
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								4.355.110,64	0,99
Aktien								4.355.110,64	0,99
EUR								2.389.009,29	0,54
DE000A0EQ578	HELMA Eigenheimbau AG Inhaber-Aktien	STK		29.672	29.672	0	EUR 57,800	1.715.041,60	0,39
MT0000580101	Media and Games Invest SE Reg.Shares	STK		195.807	195.807	0	EUR 3,442	673.967,69	0,15
GBP								738.320,47	0,17
JE00BG6L7297	boohoo Group PLC Reg.Shares	STK		695.376	695.376	0	GBP 0,901	738.320,47	0,17
SEK								1.227.780,88	0,28
SE0016828511	Embracer Group AB Namn-Aktier AK Cl.B	STK		100.000	100.000	0	SEK 80,550	779.612,95	0,18
SE0002480442	Zinzino AB Namn-Aktier B	STK		113.215	113.215	0	SEK 40,900	448.167,93	0,10
Wertpapier-Investmentanteile								378.248.690,26	85,41
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								378.248.690,26	85,41
EUR								347.005.663,04	78,35
DE000A3C92E9	ACATIS AKTIEN GLOBAL FONDS E	ANT		50.000	50.000	0	EUR 1.058,640	52.932.000,00	11,95
LU2365567358	AGIF-All.China Thematica Act. Nom. PT10 Acc.	ANT		8.500	3.400	0	EUR 816,740	6.942.290,00	1,57
LU1704598736	AGIF-All.Japan Equity W9	ANT		184	98	0	EUR 108.331,750	19.933.042,00	4,50
IE00BGGJJB67	Baillie G.W.-Health Innovat.Fd Reg.Acc.Shs B	ANT		717.000	312.912	0	EUR 14,526	10.414.783,50	2,35
DE000A0KFRV6	First Private Aktien Global C	ANT		164.275	124.000	56.000	EUR 127,390	20.926.992,25	4,73
LU0972633704	Gl.Adv.Fds-Emerg.Mkts High V. Actions Nom. I Acc.	ANT		6.981	3.220	0	EUR 2.277,410	15.898.599,21	3,59
IE00B1FZS350	iShsII-Dev.Mkts Prop.Yld U.ETF Reg.Shs (Dist)	ANT		496.500	496.500	0	EUR 26,440	13.127.460,00	2,97
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Reg.Shs Acc.	ANT		2.930.000	3.250.000	320.000	EUR 9,585	28.084.050,00	6,34
IE00B6R52036	iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Reg.Shares (Acc)	ANT		210.000	210.000	0	EUR 14,686	3.084.060,00	0,70
LU1129459035	LOYS - LOYS Aktien Europa I	ANT		4.701	0	0	EUR 1.001,630	4.708.662,63	1,06
LU0861001344	LOYS - LOYS Aktien Global I	ANT		4.601	0	5.200	EUR 1.298,350	5.973.708,35	1,35

WertpapierstrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE000A0H08T8	LOYS Global MH A (t)		ANT	19.393	0	25.500	EUR 279,650	5.423.252,45	1,22
LU0500707901	Lumen Vietnam Fund Inh.-Ant. I2 Acc.		ANT	108.057	57.057	0	EUR 132,630	14.331.599,91	3,24
LU1891775857	Lupus alpha Fds-Micro Champio. C		ANT	63.050	63.050	0	EUR 189,520	11.949.236,00	2,70
LU1706108732	Nordea 1-Europ.Stars Equit.Fd Actions Nom. BI		ANT	143.650	87.143	0	EUR 143,810	20.658.350,08	4,67
LU0097890064	Nordea 1-Glob.Stab.Eq.Fd Actions Nom. CI.BI		ANT	1.166.600	887.180	0	EUR 33,330	38.882.778,00	8,77
DE000A2P5QF9	ODDO BHF Algo Sustainabl.Lead. CPW		ANT	20.500	20.500	0	EUR 1.159,860	23.777.130,00	5,37
LU1521667375	Robeco BP Gl Premium Equities Act.Nom. CI.IB Dis.		ANT	318.650	248.200	0	EUR 126,500	40.309.225,00	9,09
DE000A2N6519	Value Intell.Gold Comp.Fds AMI S (a)		ANT	68.638	21.900	21.000	EUR 140,570	9.648.443,66	2,18
USD								31.243.027,22	7,06
LU1997245680	AGIF SICAV-All.China A-Shares Act. Nom. W Dis.		ANT	5.020	0	0	USD 1.613,070	7.260.803,77	1,64
LU1378878604	Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.		ANT	208.250	101.511	0	USD 53,810	10.047.910,78	2,27
LU0552385535	Mor.St.Inv.-Global Opportunity Acti. Nom Z		ANT	129.556	72.701	0	USD 119,950	13.934.312,67	3,15
Summe Wertpapiervermögen							EUR	420.828.155,38	95,04
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	6.911.540,66			% 100,000	6.911.540,66	1,56
EUR-Guthaben bei									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	573.077,14			% 100,000	573.077,14	0,13
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	Landesbank Baden-Württemberg		NOK	7.350.685,91			% 100,000	764.239,62	0,17
	Landesbank Baden-Württemberg		SEK	256.416,18			% 100,000	24.817,55	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	Landesbank Baden-Württemberg		GBP	402.596,98			% 100,000	474.218,15	0,11
	Landesbank Baden-Württemberg		USD	14.940.214,96			% 100,000	13.396.292,27	3,03
Summe Bankguthaben							EUR	22.144.185,39	5,01
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	22.144.185,39	5,01
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Dividendenansprüche		EUR	5.396,10				5.396,10	0,00
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	2.969,74				2.969,74	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	8.365,84	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften		EUR	-13.426,27				-13.426,27	0,00
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-221.175,87				-221.175,87	-0,05
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-234.602,14	-0,05
Fondsvermögen							EUR	442.746.104,47	100,00
Umlaufende Anteile							STK	361.190.000	
Anteilwert							EUR	1.225,80	

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

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.03.2022

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,84897 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,61830 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	10,33205 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,11525 = 1 Euro (EUR)

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				
Aktien				
EUR				
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK	15.000	15.000
GBP				
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares	STK	15.000	15.000
NOK				
NO0010073489	Austevoll Seafood ASA Navne-Aksjer	STK	77.805	77.805
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
SEK				
SE0017564024	Stillfront Group AB Namn-Aktier (Em.02/2022)	STK	75.000	75.000

WertpapierStrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Andere Wertpapiere				
SEK				
SE0017564016	Stillfront Group AB Anrechte	STK	250.000	250.000
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
DE000A0HF455	ACATIS AKTIEN GLOBAL FONDS Inh.-Anteile B (inst.)	ANT	624	1.040
IE00B52VJ196	iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)	ANT	247.500	247.500
IE00B6R52259	iShsV-MSCI ACWI UCITS ETF Reg.Shares (Acc)	ANT	486.000	486.000
DE000A2N6527	Value Intelligence Fonds AMI S (a)	ANT	0	76.312

WertpapierstrategiePortfolio A

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	361.190
Anteilwert	EUR	1.225,80

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.

Frankfurt am Main, den 1. April 2022
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2020

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,2 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 Munning
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 Squaire
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

Landesbank Baden-Württemberg
Am Hauptbahnhof 2
70173 Stuttgart
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Stuttgart, Karlsruhe, Mannheim, Mainz

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. März 2022

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



Deka Investment GmbH

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

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