

Jahresbericht
zum 30. September 2022.
Deka-DeepDiscount 2y

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

30. September 2022

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-DeepDiscount 2y für den Zeitraum vom 1. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022.

An den internationalen Finanzmärkten war bis in das erste Quartal 2022 hinein der primäre Einflussfaktor die Corona-Pandemie und deren Auswirkungen. Die von Impffortschritten und hoher Liquidität am Markt getriebene Erholung der globalen Wirtschaft sowie die starke Nachfrage an den Aktienmärkten fand im Februar mit dem Einmarsch Russlands in die Ukraine ein jähes Ende. Die als Reaktion hierauf initiierten Sanktionsmaßnahmen des Westens veranlassten umgekehrt Russland zu einem Lieferstopp bzw. zu reduzierten Liefermengen von Gas in verschiedene europäische Länder. Schmerzliche Preissteigerungen bei Energie und Rohstoffen sowie wachsende Befürchtungen hinsichtlich Versorgungsengpässen im bevorstehenden Winter waren die Folge.

In der Geld- und Fiskalpolitik rückte im Laufe des Berichtszeitraums zunehmend die rasante Inflationsentwicklung in den Fokus, was sowohl EZB als auch Federal Reserve zu einer Wende bei den Leitzinsen veranlasste. Während die Fed diese im Jahr 2022 in fünf Schritten um insgesamt 300 Basispunkte erhöhte, stemmte sich die Europäische Zentralbank mit dem größten Zinsschritt seit Einführung des Euro-Bargelds 2002 gegen die Rekordinflation. Die Währungshüter um EZB-Chefin Christine Lagarde beschlossen, den Leitzins in zwei Schritten auf 1,25 Prozent zu erhöhen. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in den kommenden Monaten in Aussicht gestellt. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo kräftig an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,1 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,8 Prozent. Überwiegend abwärts ging es angesichts unzähliger Belastungsfaktoren und Unsicherheiten für die internationalen Aktienindizes. Die Inflationsentwicklung, hohe Rohstoffpreise, Lieferkettenprobleme sowie der Krieg in der Ukraine setzten den Kursen seit Jahresbeginn 2022 deutlich zu. In China belastete zudem die andauernd strikte Null-Covid-Strategie der Regierung. Signifikant unter Druck geriet auch der Euro, der zuletzt unter die Parität zum US-Dollar rutschte.

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Tätigkeitsbericht. 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.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 30. September 2022	7
Vermögensaufstellung zum 30. September 2022	8
Anhang	13
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	18
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	20

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

Jahresbericht 01.10.2021 bis 30.09.2022

Deka-DeepDiscount 2y

Tätigkeitsbericht.

Das Anlagekonzept des Fonds Deka-DeepDiscount 2y ist auf Kapitalzuwachs durch eine positive Entwicklung der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte ausgerichtet. Hierfür strebt das Sondervermögen eine Beteiligung an einer möglichen Aufwärtsbewegung des europäischen Aktienmarktes bei gleichzeitiger Vereinnahmung von Optionsprämien an. Das Fondsmanagement verfolgt das Anlageziel durch den systematischen Einsatz einer Discountstrategie. Hierfür sind Investitionen überwiegend in Aktien, verzinslichen Wertpapieren (z.B. Pfandbriefe und Staatsanleihen), Discountzertifikaten und Indexzertifikaten möglich. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Bei der Investition des Sondervermögens orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung der Einzelwerte an einem vorab festgelegten Vergleichsmaßstab (Index). Genutzt werden dafür als Basis DeepDiscount-Strukturen mit einer jeweiligen Laufzeit von 2 Jahren, wobei jeden Monat eine Teilrollierung fällig werdender Discountstrukturen vorgenommen wird. Zur Erreichung des Anlageziels kann insbesondere in außergewöhnlichen Marktphasen von dieser Systematik abgewichen werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Die Anlagestrategie des Fonds investiert in Rentenpapiere und verkauft monatlich Optionen auf den Aktienmarkt mit entsprechender Laufzeit. Durch den Verkauf der Optionen kann ein kontinuierlicher Einkommensstrom erzeugt werden. Die Rentenpapierauswahl erfolgt anhand ihrer Bonität, der zum jeweiligen Fonds passenden Restlaufzeit, ihrer Liquidität, ihrer Kuponstruktur und der Bonität des Emittenten selbst. Das resultierende Rentenportfolio ist Ergebnis einer Optimierung anhand der vorgenannten Kriterien. Der Erwerb der Rentenpapiere erfolgt entweder direkt vom Emittenten oder auf dem Sekundärmarkt. Das Rentenportfolio wird regelmäßig überprüft und ggf. angepasst. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten (Angaben gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852).

Fonds verzeichnet Wertrückgang

Das Berichtsjahr war von zwei unterschiedlichen Marktphasen geprägt. Bis Ende 2021 waren aufgrund der vorankommenden Corona-Impfkampagnen in vielen Volkswirtschaften immer mehr Öffnungsschritte möglich. Damit verbunden kam es zu einer deutlichen wirtschaftlichen Erholung. Gleichzeitig zogen die Inflationserwartungen an, in Euroland jedoch mit wesentlich geringerer Dynamik als etwa in den USA.

Wichtige Kennzahlen

Deka-DeepDiscount 2y

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
	-3,1%	-1,8%	-0,7%
ISIN	DE000DK093J0		
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.			

Veräußerungsergebnisse im Berichtszeitraum

Deka-DeepDiscount 2y

Realisierte Gewinne aus	in Euro
Renten und Zertifikate	0,00
Aktien	0,00
Zielfonds und Investmentvermögen	0,00
Optionen	772.418,07
Futures	0,00
Swaps	0,00
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	0,00
Devisenkassageschäften	415,63
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	772.833,70

Realisierte Verluste aus	in Euro
Renten und Zertifikate	-241.746,48
Aktien	0,00
Zielfonds und Investmentvermögen	0,00
Optionen	0,00
Futures	0,00
Swaps	0,00
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	0,00
Devisenkassageschäften	0,00
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	-241.746,48

Nach dem Jahreswechsel verschlechterte sich das Marktumfeld spürbar. Zunächst litten die Finanzmärkte unter dem Richtungswechsel der Notenbanken, welche zunehmend restriktivere Töne anschlugen. Hinzu kam Ende Februar der Einmarsch Russlands in die Ukraine. Aufgrund der dadurch ausgelösten Preisexplosion bei Rohstoffen (Öl, Gas) beschleunigte sich weltweit die Inflation. Die Zurückhaltung der Konsumenten und Zinserhöhungen der US-Zentralbank sowie später auch in Europa ließen die Stimmung für risikoreichere Anlagen einbrechen. Zudem belasteten die weltweit fragilen Lieferketten die Wachstumsaussichten der Unternehmen aufgrund der No-Covid-Strategie in China. Erste Rezessionsbefürchtungen in Europa trugen zu einer hohen Unsicherheit bei.

Zum Berichtsstichtag war das Fondsvermögen weiterhin hauptsächlich in verzinslichen Wertpapieren investiert (Pfandbriefe, Titel halbstaatlicher Emittenten, Staats- und Unternehmensanleihen), ergänzt um Anteile an einem gemischten Wertpapierfonds. Die

Deka-DeepDiscount 2y

Aktienseite des Portfolios wurde über Aktien-Derivate in Form von Optionen auf einen Aktienindex dargestellt.

Anteile an dem Sondervermögen sind Wertpapiere, deren Preise durch die börsentäglichen Kursschwankungen der im Fonds befindlichen Vermögensgegenstände bestimmt werden und deshalb steigen oder auch fallen können (Marktpreisrisiken).

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen i.d.R. die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere.

Durch die Investition des Fonds in Anleihen können bei Ausfall eines Emittenten Verluste für den Fonds entstehen. Darüber hinaus waren Derivate im Portfolio enthalten, sodass auch hierfür spezifische Risiken wie das Kontrahentenrisiko zu beachten waren.

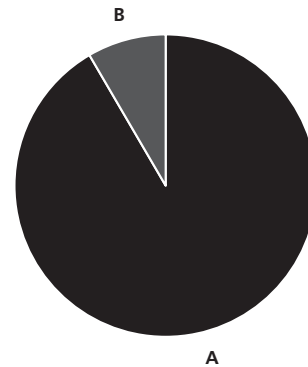
Die Risiken von Investmentanteilen, die für einen Fonds erworben werden (so genannte „Zielfonds“), stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Zielfonds enthaltene Vermögensgegenständen. Da die Manager der einzelnen Zielfonds voneinander unabhängig handeln, kann es vorkommen, dass mehrere Zielfonds gleiche Engagements tätigen.

Die Einschätzung der im Berichtsjahr eingegangenen Liquiditätsrisiken orientiert sich an der Veräußerbarkeit von Vermögenswerten, die potenziell eingeschränkt sein kann. Der Fonds verzeichnete im Berichtszeitraum keine wesentlichen Liquiditätsrisiken.

Zur Bewertung und Vermeidung operationeller Risiken führt die Gesellschaft detaillierte Risikoüberprüfungen durch. Das Sondervermögen wies im Berichtszeitraum keine besonderen operationellen Risiken auf.

Im Berichtszeitraum wies der Fonds Deka-DeepDiscount 2y eine Wertentwicklung von minus 3,1 Prozent aus. Das Fondsvermögen belief sich zuletzt auf 22,9 Mio. Euro.

Fondsstruktur Deka-DeepDiscount 2y



A	Verzinsliche Anleihen	94,7%
B	Gemischte Wertpapierfonds Wertpapiervermögen	103,4%
	Liquidität und Sonstiges	-3,4%

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

Wertentwicklung im Berichtszeitraum Deka-DeepDiscount 2y

Index: 30.09.2021 = 100



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

Deka-DeepDiscount 2y

Vermögensübersicht zum 30. September 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	21.604.091,00	94,21
Belgien	779.912,00	3,40
Deutschland	1.649.195,00	7,19
Finnland	994.910,00	4,34
Frankreich	8.996.407,00	39,24
Kanada	1.979.962,00	8,63
Niederlande	580.824,00	2,53
Norwegen	4.243.797,00	18,51
Österreich	598.080,00	2,61
Sonstige	599.172,00	2,61
USA	1.181.832,00	5,15
2. Investmentanteile	1.987.475,00	8,68
Irland	1.987.475,00	8,68
3. Derivate	-1.258.424,44	-5,48
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	2.736,37	0,01
5. Sonstige Vermögensgegenstände	627.257,47	2,73
II. Verbindlichkeiten	-33.830,33	-0,15
III. Fondsvermögen	22.929.305,07	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	21.604.091,00	94,21
EUR	21.604.091,00	94,21
2. Investmentanteile	1.987.475,00	8,68
EUR	1.987.475,00	8,68
3. Derivate	-1.258.424,44	-5,48
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	2.736,37	0,01
5. Sonstige Vermögensgegenstände	627.257,47	2,73
II. Verbindlichkeiten	-33.830,33	-0,15
III. Fondsvermögen	22.929.305,07	100,00

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

Deka-DeepDiscount 2y

Vermögensaufstellung zum 30. September 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								21.604.091,00	94,21
Verzinsliche Wertpapiere								21.604.091,00	94,21
EUR								21.604.091,00	94,21
FR0013499977	0,1250 % AXA Bank Europe SCF MT Obl.Fonc. 20/24	EUR		500.000	500.000	0	% 94,953	474.765,00	2,07
XS1458405898	0,7500 % Bank of America Corp. MTN 16/23	EUR		1.200.000	0	0	% 98,486	1.181.832,00	5,15
XS2141192182	0,1250 % Bank of Montreal MT Mortg.Cov. Bds 20/23	EUR		1.200.000	0	0	% 99,241	1.190.886,00	5,19
BE0002265347	0,0000 % BNP Paribas Fortis S.A. MT Mortg.Cov. Bds 16/23	EUR		800.000	800.000	0	% 97,489	779.912,00	3,40
FR0013367406	0,6250 % BPCE S.A. MTN 18/23	EUR		1.000.000	0	0	% 97,881	978.810,00	4,27
FR0013111903	0,3750 % BPCE SFH MT Obl.Fin.Hab. 16/23	EUR		1.200.000	0	0	% 99,626	1.195.512,00	5,21
FR0012688208	0,2000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 15/23	EUR		1.300.000	0	0	% 99,090	1.288.170,00	5,62
FR0011213453	3,6000 % Caisse Refinancement l'Habitat Cov. Bonds 12/24	EUR		800.000	800.000	0	% 101,387	811.096,00	3,54
FR0012332450	0,6250 % Crédit Agricole Home Loan SFH MT Obl.Fin.Hab 14/22	EUR		800.000	0	0	% 99,957	799.656,00	3,49
FR0013505575	0,1250 % Crédit Agricole Home Loan SFH MT Obl.Fin.Hab 20/24	EUR		800.000	800.000	0	% 94,446	755.568,00	3,30
XS0856976682	1,8750 % DNB Boligkredit A.S. Mortg. Cov. MTN 12/22	EUR		1.000.000	0	0	% 100,103	1.001.030,00	4,37
XS1909061597	0,3750 % DNB Boligkredit A.S. Mortg. Cov. MTN 18/23	EUR		700.000	700.000	0	% 97,862	685.034,00	2,99
XS1023039545	2,1250 % European Investment Bank MTN 14/24	EUR		600.000	600.000	0	% 99,862	599.172,00	2,61
DE000A2LQH28	0,0500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 18/24	EUR		700.000	700.000	0	% 97,085	679.595,00	2,96
DE000A2LQSP7	0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 19/24 ¹⁾	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 96,960	969.600,00	4,23
NL0013400401	0,2500 % Nationale-Nederlanden Bank NV MT Mg.Cov. Bds 19/24	EUR		600.000	600.000	0	% 96,804	580.824,00	2,53
XS1784067529	0,2500 % Nordea Mortgage Bank PLC MT Cov. Bds 18/23 ¹⁾	EUR		1.000.000	0	0	% 99,491	994.910,00	4,34
FR0011962398	1,7500 % Rep. Frankreich OAT 14/24	EUR		700.000	700.000	0	% 99,635	697.445,00	3,04
AT0000A185T1	1,6500 % Republik Österreich Bundesanl. 14/24	EUR		600.000	600.000	0	% 99,680	598.080,00	2,61
XS1847633119	0,2500 % Royal Bank of Canada MT Mortg.Cov. Bds 18/23	EUR		800.000	0	0	% 98,635	789.076,00	3,44
FR0013421674	0,0000 % SFIL S.A. MTN 19/24	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 96,491	964.910,00	4,21
XS0410174659	4,5000 % SNCF Réseau S.A. MTN 09/24	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 103,048	1.030.475,00	4,49
XS1637099026	0,3750 % SpareBank 1 Boligkredit AS MT Mortg.Cov.Bds 17/24	EUR		800.000	800.000	0	% 96,144	769.148,00	3,35
XS1839386908	0,3750 % SpareBank 1 Boligkredit AS MT Mortg.Cov.Bds 18/23 ¹⁾	EUR		800.000	0	0	% 98,775	790.200,00	3,45
XS1344895450	0,7500 % SR-Boligkredit A.S. Mortg. Covered MTN 16/23	EUR		1.000.000	0	0	% 99,839	998.385,00	4,35
Wertpapier-Investmentanteile								1.987.475,00	8,68
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								1.987.475,00	8,68
EUR								1.987.475,00	8,68
IE00BJH52T39	PassIM St.F.-J.P.M.M.E.P.W.St. Reg.Acc.Shs A	ANT		20.500	0	0	EUR 96,950	1.987.475,00	8,68
Summe Wertpapiervermögen								EUR 23.591.566,00	102,89
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Optionsrechte								-1.258.424,44	-5,48
Optionsrechte auf Aktienindices								-1.258.424,44	-5,48
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Dez. 22 2600	XEUR		Anzahl -26				EUR 24,350	-6.331,00	-0,03
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Dez. 23 2900	XEUR		Anzahl -38				EUR 208,150	-79.097,00	-0,34
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 23 2850	XEUR		Anzahl -38				EUR 144,600	-54.948,00	-0,24
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 24 2400	XEUR		Anzahl -41				EUR 145,200	-59.532,00	-0,26
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put März 24 2600	XEUR		Anzahl -41				EUR 156,800	-64.288,00	-0,28
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Sep. 24 2400	XEUR		Anzahl -41				EUR 156,500	-64.165,00	-0,28
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Aug. 23 2900	OTC		Anzahl -379				EUR 180,580	-68.439,82	-0,30
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Aug. 24 2650	OTC		Anzahl -377				EUR 196,270	-73.993,79	-0,32
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Jan. 23 2600	OTC		Anzahl -258				EUR 38,560	-9.948,48	-0,04
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Juli 23 2850	OTC		Anzahl -386				EUR 159,470	-61.555,42	-0,27
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Mai 23 2800	OTC		Anzahl -429				EUR 124,600	-53.453,40	-0,23
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put März 23 2700	OTC		Anzahl -519				EUR 73,200	-37.990,80	-0,17
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Nov. 22 2500	OTC		Anzahl -300				EUR 9,650	-2.895,00	-0,01
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Nov. 23 3000	OTC		Anzahl -335				EUR 233,820	-78.329,70	-0,34
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Okt. 22 2250	OTC		Anzahl -267				EUR 0,490	-130,83	0,00
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Okt. 23 2900	OTC		Anzahl -379				EUR 196,940	-74.640,26	-0,33

Deka-DeepDiscount 2y

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind. (SX5E) Put Sep. 23 2800		OTC		Anzahl -393			EUR 161,840	-63.603,12	-0,28
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Apr. 23 2800		OTC		Anzahl -464			EUR 105,340	-48.877,76	-0,21
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Apr. 24 2600		OTC		Anzahl -385			EUR 160,570	-61.819,45	-0,27
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Feb. 23 2700		OTC		Anzahl -519			EUR 61,300	-31.814,70	-0,14
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Feb. 24 2700		OTC		Anzahl -389			EUR 172,640	-67.156,96	-0,29
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Jan. 24 2800		OTC		Anzahl -375			EUR 190,440	-71.415,00	-0,31
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Juli 24 2400		OTC		Anzahl -415			EUR 140,720	-58.398,80	-0,25
OTC DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Mai 24 2600		OTC		Anzahl -385			EUR 170,390	-65.600,15	-0,29
Summe Aktienindex-Derivate								EUR -1.258.424,44	-5,48
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	2.691,22			% 100,000	2.736,37	0,01
Summe Bankguthaben								EUR 2.736,37	0,01
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR 2.736,37	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	115.789,84				115.789,84	0,50
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	511.253,40				511.253,40	2,23
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	214,23				214,23	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 627.257,47	2,73
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
EUR-Kredite bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	-11.762,92			% 100,000	-11.762,92	-0,05
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								EUR -11.762,92	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-70,71				-70,71	0,00
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-21.996,70				-21.996,70	-0,10
Summe Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -22.067,41	-0,10
Fondsvermögen								EUR 22.929.305,07	100,00
Umlaufende Anteile								STK 181.519,000	
Anteilwert								EUR 126,32	

*) 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:				
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 19/24	EUR 1.000.000		969.600,00	
0,2500 % Nordea Mortgage Bank PLC MT Cov. Bds 18/23	EUR 500.000		497.455,00	
0,3750 % SpareBank 1 Boligkredit AS MT Mortg.Cov.Bds 18/23	EUR 800.000		790.200,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		2.257.255,00	2.257.255,00

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.09.2022
 Vereinigte Staaten, Dollar (USD) 0,98350 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel
Terminbörsen
 XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

OTC Over-the-Counter

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1115479559	1,3750 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 14/22	EUR	0	1.300.000
XS0759310930	2,7500 % DNB Boligkredit A.S. MTN Hyp.-Pfe. 12/22	EUR	0	1.200.000
XS1678974525	0,2500 % SBAB Bank AB (publ) MTN 17/22	EUR	0	700.000
XS1246782269	0,7500 % Skandinaviska Enskilda Banken MT Cov. Bds 15/22	EUR	0	500.000
XS1516271290	0,3750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA MTN 16/22	EUR	0	1.600.000

Deka-DeepDiscount 2y

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1225004115	0,2500 % Sparebanken Vest Boligkred. AS MT Hyp.-Pfe. 15/22	EUR	0	1.000.000
XS1173845436	1,3750 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 15/22	EUR	0	1.000.000
XS1746107975	0,2500 % UBS AG (London Branch) MTN 18/22	EUR	0	700.000
XS1591674459	0,2500 % Westpac Sec. NZ Ltd. (Ldn Br.) MT Mtg.Co.Bds 17/22	EUR	0	1.000.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1917577931	0,2500 % ABN AMRO Bank N.V. Preferred MTN 18/21	EUR	0	600.000
DE000BLB3577	0,1500 % Bayerische Landesbank IHS 16/22	EUR	0	800.000
XS1527753187	0,5000 % BNP Paribas S.A. MTN 16/22	EUR	0	900.000
XS1576220484	0,7500 % ING Groep N.V. MTN 17/22	EUR	0	700.000
FR0012686087	0,1750 % La Banq. Postale Home Loan SFH MT Obl.FinHab 15/22	EUR	0	700.000
XS1538867760	1,0000 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 16/22	EUR	0	700.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	7.938
(Basiswert(e): 0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 19/24, 0,3750 % SpareBank 1 Boligkredit AS MT Mortg.Cov.Bds 17/24, 0,6250 % BPCE S.A. MTN 18/23, 0,7500 % Bank of America Corp. MTN 16/23)		

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0 Euro.

Deka-DeepDiscount 2y

Entwicklung des Sondervermögens

		EUR
I.	Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	26.330.864,54
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr	--
2	Zwischenausschüttung(en)	--
3	Mittelzufluss (netto)	-2.641.553,23
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 54.768,48
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 54.768,48
	davon aus Verschmelzung	EUR 0,00
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR -2.696.321,71
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	22.112,09
5	Ergebnis des Geschäftsjahres	-782.118,33
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-647.874,61
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-556.473,71
II.	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	22.929.305,07

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
30.09.2019	39.940.847,61	133,38
30.09.2020	34.631.395,18	125,75
30.09.2021	26.330.864,54	130,42
30.09.2022	22.929.305,07	126,32

Deka-DeepDiscount 2y

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.10.2021 - 30.09.2022 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	1.504,75	0,01
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	164.359,40	0,91
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-2.927,57	-0,02
davon Negative Einlagezinsen	-2.942,59	-0,02
davon Positive Einlagezinsen	15,02	0,00
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	682,17	0,00
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	682,17	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	0,00	0,00
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	0,00	0,00
10. Sonstige Erträge	0,00	0,00
Summe der Erträge	163.618,75	0,90
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-31,26	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-235.195,86	-1,30
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-37.248,86	-0,21
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-225,15	-0,00
davon EMIR-Kosten	-1.744,35	-0,01
davon Kostenpauschale	-35.279,36	-0,19
Summe der Aufwendungen	-272.475,98	-1,50
III. Ordentlicher Nettoertrag	-108.857,23	-0,60
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	772.833,70	4,26
2. Realisierte Verluste	-241.746,48	-1,33
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	531.087,22	2,93
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	422.229,99	2,33
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-647.874,61	-3,57
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-556.473,71	-3,07
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.204.348,32	-6,63
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-782.118,33	-4,31

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung

	EUR insgesamt	EUR je Anteil*)
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	103.680,24	0,57
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	422.229,99	2,33
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,00
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	525.910,23	2,90
III. Gesamtausschüttung	0,00	0,00
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung	0,00	0,00

Umlaufende Anteile: Stück 181.519

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

Deka-DeepDiscount 2y Anhang.

Zusätzliche Angaben zu den Derivaten Instrumentenart

Optionsrechte auf Aktienindices
Optionsrechte auf Aktienindices

Kontrahent

DekaBank Deutsche Girozentrale
Eurex Deutschland

Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)

-930.063,44
-328.361,00

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial wurde für dieses Sondervermögen gemäß der DerivateV nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt (relativer Value-at-Risk gem. § 8 DerivateV).

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§ 37 Abs. 5 DerivateV i. V. m. § 9 DerivateV)

50% Euro STOXX 50® NR in EUR, 50% ICE BofA 1-3 Year Euro Corporate Index in EUR

Dem Sondervermögen wird ein derivatereies Vergleichsvermögen gegenübergestellt. Es handelt sich dabei um eine Art virtuelles Sondervermögen, dem keine realen Positionen oder Geschäfte zugrunde liegen. Die Grundidee besteht darin, eine plausible Vorstellung zu entwickeln, wie das Sondervermögen ohne Derivate oder derivative Komponenten zusammengesetzt wäre. Das Vergleichsvermögen muss den Anlagebedingungen, den Angaben im Verkaufsprospekt und den wesentlichen Anlegerinformationen des Sondervermögens im Wesentlichen entsprechen, ein derivatereies Vergleichsmaßstab wird möglichst genau nachgebildet. In Ausnahmefällen kann von der Forderung des derivatereien Vergleichsvermögens abgewichen werden, sofern das Sondervermögen Long/Short-Strategien nutzt oder zur Abbildung von z.B. Rohstoffexposure oder Währungsabsicherungen.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (§ 37 Abs. 4 Satz 1 und 2 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

kleinster potenzieller Risikobetrag 2,10%
größter potenzieller Risikobetrag 4,97%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 3,48%

Der potenzielle Risikobetrag für das Marktrisiko des Sondervermögens wird über die Risikokennzahl Value-at-Risk (VaR) dargestellt. Zum Ausdruck gebracht wird durch diese Kennzahl der potenzielle Verlust des Sondervermögens, der unter normalen Marktbedingungen mit einem Wahrscheinlichkeitsniveau von 99% (Konfidenzniveau) bei einer angenommenen Haltdauer von 10 Arbeitstagen auf Basis eines effektiven historischen Betrachtungszeitraumes von einem Jahr nicht überschritten wird. Wenn zum Beispiel ein Sondervermögen einen VaR-Wert von 2,5% aufwiese, dann würde unter normalen Marktbedingungen der potenzielle Verlust des Sondervermögens mit einer Wahrscheinlichkeit von 99% nicht mehr als 2,5% des Wertes des Sondervermögens innerhalb von 10 Arbeitstagen betragen. Im Bericht wird die maximale, minimale und durchschnittliche Ausprägung dieser Kennzahl auf Basis einer Beobachtungszeitreihe von maximal einem Jahr oder ab Umstellungsdatum veröffentlicht. Der VaR-Wert des Sondervermögens darf das Zweifache des VaR-Werts des derivatereien Vergleichsvermögens nicht übersteigen. Hierdurch wird das Marktrisiko des Sondervermögens klar limitiert.

Risikomodelle (§ 37 Abs. 4 Satz 3 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

Monte Carlo Simulation

Im Berichtszeitraum genutzter Umfang des Leverage gemäß der Brutto-Methode (§ 37 Abs. 4 Satz 4 DerivateV i. V. m. § 5 Abs. 2 DerivateV)

115,55%

Emittenten oder Garanten, deren Sicherheiten mehr als 20% des Wertes des Fonds ausgemacht haben (§ 37 Abs. 6 DerivateV):

Im Berichtszeitraum wiesen keine Sicherheiten eine erhöhte Emittentenkonzentration nach § 27 Abs. 7 Satz 4 DerivateV auf.

Zusätzliche Angaben zu den Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäften (besichert) Instrumentenart

Wertpapier-Darlehen

Kontrahent

DekaBank Deutsche Girozentrale

Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)

2.257.255,00

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:

EUR 2.509.651,23

davon:

Schuldverschreibungen

EUR 1.516.004,04

Aktien

EUR 993.647,19

Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften

EUR 682,17

Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften

EUR 225,15

Umlaufende Anteile

STK 181.519

Anteilwert

EUR 126,32

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

Deka-DeepDiscount 2y

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.

Gesamtkostenquote (laufende Kosten) 1,16%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Für das Sondervermögen ist gemäß den Anlagebedingungen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Kostenpauschale von insgesamt 0,15% p.a. vereinbart. Davon entfallen bis zu 0,10% p.a. auf die Verwahrstelle und bis zu 0,06% p.a. auf Dritte. Die Kostenpauschale deckt die in den Besonderen Anlagebedingungen und im Verkaufsprospekt aufgeführten Vergütungen und Kosten ab, die dem Sondervermögen nicht separat belastet werden. Die Verwaltungsvergütung ist nicht Bestandteil der Kostenpauschale und wird dem Sondervermögen gesondert belastet.

Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen der aus dem Fonds an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersstattungen zu.

Die Gesellschaft gewährt an Vermittler, z.B. Kreditinstitute, wiederkehrend - meist jährlich - Vermittlungsentgelte als so genannte "Vermittlungsprovisionen" bzw. "Vermittlungsfolgeprovisionen".

Für den Erwerb und die Veräußerung der Investmentanteile sind keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge berechnet worden. Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:
PassIM St.F.-J.P.M.M.E.P.W.St. Reg.Acc.Shs A

0,08

Wesentliche sonstige Aufwendungen

Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften

EUR 225,15

EMIR-Kosten

EUR 1.744,35

Kostenpauschale

EUR 35.279,36

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt

EUR 2.348,87

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka Investment GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme.

Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung“ (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft.

Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlegerefolgsprämien, werden bei der Deka Investment GmbH nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Deka Investment GmbH bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeiters werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeiter erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

Die variable Vergütung der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und von Mitarbeitern, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitern (zusammen als "risikorelevante Mitarbeiter") unterliegt folgenden Regelungen:

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitern unterhalb der Geschäftsführungs-Ebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
- Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 75 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Deka-DeepDiscount 2y

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2021 fand im Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2021 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung
davon feste Vergütung
davon variable Vergütung

EUR 52.919.423,38
EUR 43.285.414,31
EUR 9.634.009,07

Zahl der Mitarbeiter der KVG

455

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen****

EUR 7.381.436,36
EUR 2.103.677,90
EUR 1.913.005,27
EUR 488.811,00
EUR 2.875.942,19

Geschäftsführer

weitere Risk Taker

Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen

Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risk Taker

* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt.

** weitere Risk Taker: alle sonstigen Risk Taker, die nicht Geschäftsführer oder Risk Taker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risk Taker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risk Taker oder Geschäftsführer befinden.

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

2.257.255,00

in % des Fondsvermögens

9,84

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

2.257.255,00

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

2.257.255,00

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 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

CHF

EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

2.509.651,23

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

Kostenanteil des Fonds

Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

694,76

229,30

229,30

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00

33,00

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.

Deka-DeepDiscount 2y

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

9,57% (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
Holcim Ltd.	993.647,19
DZ HYP AG	795.658,81
GEWOBAG Wohnungsbau-AG Berlin	333.570,25
Münchener Hypothekenbank eG	195.020,36
Bayerische Landesbank	191.754,63

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	993.647,19 (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt	1.516.004,04 (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.

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

Basierend auf dem Gesetz zur Umsetzung der zweiten Aktionärsrechterichtlinie (ARUG II) macht die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu § 134c Abs. 4 AktG folgende Angaben:

Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken

Informationen zu den wesentlichen allgemeinen mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens sind im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Risikohinweise“ aufgeführt. Für die konkreten wesentlichen Risiken im Geschäftsjahr verweisen wir auf den Tätigkeitsbericht.

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Die Zusammensetzung des Portfolios und die Portfolioumsätze können der Vermögensaufstellung bzw. den Angaben zu den während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäften, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, entnommen werden. Die Portfolioumsatzkosten bei Gesellschaften, die im Anhang des vorliegenden Jahresberichts ausgewiesen (Transaktionskosten).

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Die Anlageziele und Anlagepolitik des Fonds werden im Tätigkeitsbericht dargestellt. Bei den Anlageentscheidungen werden die mittel- bis langfristigen Entwicklungen der Portfoliogesellschaften berücksichtigt. Dabei soll ein Einklang zwischen den Anlagezielen und Risiken sichergestellt werden.

Einsatz von Stimmrechtsberatern

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern informieren der Mitwirkungsbericht sowie der Stewardship Code der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Dokumente stehen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil> (Corporate Governance).

Handhabung der Wertpapierleihe und Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten

Auf inländischen Hauptversammlungen von börsennotierten Aktiengesellschaften übt die Kapitalverwaltungsgesellschaft das Stimmrecht entweder selbst oder über Stimmrechtsvertreter aus. Verleihte Aktien werden rechtzeitig an die Kapitalverwaltungsgesellschaft zurückübertragen, sodass diese das Stimmrecht auf Hauptversammlungen wahrnehmen kann. Für die in den Sondervermögen befindlichen ausländischen Aktien erfolgt die Ausübung des Stimmrechts insbesondere bei Gesellschaften, die im EURO STOXX 50® oder STOXX Europe 50® vertreten sind, sowie für US-amerikanische und japanische Gesellschaften mit signifikantem Bestand, falls diese Aktien zum Hauptversammlungstermin nicht verliehen sind. Zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften informieren der Stewardship Code und der Mitwirkungsbericht der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die entsprechenden Dokumente stehen Ihnen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil> (Corporate Governance).

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Ermittlung Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste:

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Berichtszeitraum die in den Anteilpreis einfließenden Wertansätze der im Bestand befindlichen Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Berichtszeitraumes mit den Summenpositionen zum Anfang des Berichtszeitraumes die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Bei den unter der Kategorie „Nichtnotierte Wertpapiere“ ausgewiesenen unterjährigen Transaktionen kann es sich um börsengehandelte bzw. in den organisierten Markt einbezo-

Deka-DeepDiscount 2y

gene Wertpapiere handeln, deren Fälligkeit mittlerweile erreicht ist und die aus diesem Grund der Kategorie nichtnotierte Wertpapiere zugeordnet wurden.

Die Klassifizierung von Geldmarktinstrumenten erfolgt gemäß Einstufung des Informationsdienstleisters WM Datenservice und kann in Einzelfällen von der Definition in § 194 KAGB abweichen. Insofern können Vermögensgegenstände, die gemäß § 194 KAGB unter Geldmarktinstrumente fallen, in der Vermögensaufstellung außerhalb der Kategorie „Geldmarktpapiere“ ausgewiesen sein.

Frankfurt am Main, den 21. Dezember 2022
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

**An die Deka Investment GmbH,
Frankfurt am Main**

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka-DeepDiscount 2y – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. September 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Deka Investment GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Deka Investment GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu

verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung des Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Investmentvermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – falscher Darstellungen im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Deka Investment GmbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Deka Investment GmbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen,

dass das Sondervermögen durch die Deka Investment GmbH nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresberichts, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 23. Dezember 2022

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Kühn
Wirtschaftsprüfer

Steinbrenner
Wirtschaftsprüfer

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 Squaire
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: 30. September 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

