

Halbjahresbericht
zum 31. Oktober 2021.
MBS Invest 2

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. Oktober 2021

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds MBS Invest 2 für den Zeitraum vom 1. Mai 2021 bis zum 31. Oktober 2021.

Zu Beginn des Berichtszeitraums setzte sich die Erholung der europäischen Wirtschaft von den Belastungen der Corona-Pandemie zunächst fort. Die Wachstumskurve wies im zweiten Quartal 2021 merklich nach oben und an den Finanzmärkten überwogen optimistische Konjunkturperspektiven. Diese erfuhren ab dem Spätsommer jedoch aufgrund von Lieferengpässen bei Rohstoffen und Vorprodukten sowie gestiegener Energiepreise einen Dämpfer, was die weiteren Konjunkturerwartungen merklich belastete.

Die Geld- und Finanzpolitik wurde weiterhin in hohem Maße an den wirtschaftlichen Folgen der Corona-Krise ausgerichtet. Gleichwohl traten sowohl die Europäische Zentralbank (EZB) als auch die US-Notenbank hinsichtlich ihres expansiven Kurses zuletzt moderat auf die Bremse und kündigten eine Drosselung ihrer Anleihekäufe an. Darüber hinaus rückte im Verlauf des Berichtszeitraums immer stärker die Inflationsentwicklung in den Vordergrund. Allerdings betrachtete die EZB den teils erheblichen Preisanstieg bislang lediglich als Übergangsphänomen. An den Anleihemärkten war von wachsender Inflationsgefahr wenig zu spüren, die Renditen für längere Laufzeiten haben sich im Stichtagsvergleich nur wenig verändert. Ende Oktober rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei minus 0,1 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries bei plus 1,6 Prozent.

Ungeachtet aller Lieferkettenprobleme und Inflationsssorgen verzeichnete der überwiegende Anteil der Aktienmärkte auf Halbjahressicht komfortable Kurssteigerungen. Beflügelt wurde das insgesamt positive Bild nicht nur von der anhaltenden Flutung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken sowie der unveränderten Niedrigzinspolitik, sondern erfreulicherweise auch von guten Geschäftsergebnissen und -prognosen der Unternehmen.

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 Anteilhaber 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 Vermögensmanagement GmbH
Die Geschäftsführung



Dirk Degenhardt (Vorsitzender)



Dirk Heuser



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2021	6
Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2021	7
Anhang	11
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	12

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

MBS Invest 2

Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Investmentfonds MBS Invest 2 ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, je nach Marktlage, weltweit in unterschiedliche Anlageklassen und Finanzinstrumente zu investieren. Um eine möglichst breite Streuung innerhalb der einzelnen Anlageklassen zu erzielen und ein Einzeltitelrisiko zu reduzieren, wird die Anlagestrategie vorzugsweise mittels börsengehandelter Indexfonds und Investmentfonds umgesetzt. Durch Investition in Investmentfonds soll die Risikostreuung zusätzlich erhöht und das Spezialistenwissen der Zielfondsmanager genutzt werden. Bis zu 40 Prozent des Wertes des Fonds darf in Aktien, Aktienfonds, aktienähnliche Genussscheine, aktienbezogene Derivate, Zertifikate mit Aktienbezug, Rohstofffonds sowie Wertpapiere / Geldmarktinstrumente / Derivate mit Rohstoffexposure angelegt werden. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Das Fondsmanagement hat im Verlauf der Berichtsperiode Anpassungen in der Portfoliostruktur vorgenommen. Der Bestand von Rentenfonds wurde etwas reduziert und der Anteil von Aktienfonds dafür auf 38,5 Prozent aufgestockt.

Im Berichtszeitraum verzeichnete der Fonds MBS Invest 2 eine Wertsteigerung von 2,2 Prozent.

Wichtige Kennzahlen

MBS Invest 2

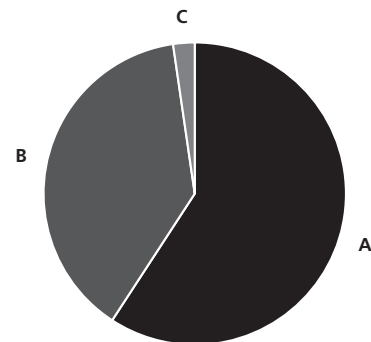
Performance*	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
	2,2%	8,6%	4,4%

ISIN DE000A2DJVN8

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

Fondsstruktur

MBS Invest 2



A	Rentenfonds	59,2%
B	Aktienfonds	38,5%
C	Barrereserve, Sonstiges	2,3%

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

MBS Invest 2

Vermögensübersicht zum 31. Oktober 2021.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Investmentanteile	189.807.740,01	97,67
Deutschland	71.979.471,82	37,04
Irland	62.031.469,57	31,93
Luxemburg	55.796.798,62	28,70
2. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	6.972.341,48	3,59
3. Sonstige Vermögensgegenstände	355.416,42	0,18
II. Verbindlichkeiten	-2.804.605,36	-1,44
III. Fondsvermögen	194.330.892,55	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Investmentanteile	189.807.740,01	97,67
EUR	177.464.368,79	91,31
USD	12.343.371,22	6,36
2. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	6.972.341,48	3,59
3. Sonstige Vermögensgegenstände	355.416,42	0,18
II. Verbindlichkeiten	-2.804.605,36	-1,44
III. Fondsvermögen	194.330.892,55	100,00

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

MBS Invest 2

Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2021.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2021	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Wertpapier-Investmentanteile								189.807.740,01	97,67
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								47.068.665,80	24,23
EUR								47.068.665,80	24,23
DE000ETFLO60	Deka DAX (ausschüttend) UCITS ETF	ANT		55.373	15.450	0	EUR 65,840	3.645.758,32	1,88
DE000ETFL144	Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF	ANT		125.589	16.224	0	EUR 116,245	14.599.093,31	7,52
DE000ETFL284	Deka MSCI Europe UCITS ETF	ANT		302.787	126.397	0	EUR 15,816	4.788.879,19	2,46
DE000ETFL300	Deka MSCI Japan UCITS ETF	ANT		405.316	193.056	0	EUR 9,334	3.783.219,54	1,95
DE000ETFL268	Deka MSCI USA UCITS ETF	ANT		155.189	88.153	0	EUR 38,040	5.903.389,56	3,04
DE0008479213	Multirent-INVEST	ANT		142.712	34.131	0	EUR 33,090	4.722.340,08	2,43
DE000A1JSHJ5	Weltzins-INVEST (I)	GRUPP		410.140	103.440	0	EUR 23,470	9.625.985,80	4,95
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								142.739.074,21	73,44
EUR								130.395.702,99	67,08
LU1165977643	AB FCP I-Europ.Inc.Portfolio Actions Nom. AR	ANT		792.002	156.517	0	EUR 12,360	9.789.144,72	5,04
LU1737652583	Amundi Ind.Sol.-A.In.MSCI E.M. Act.Nom.UC.ETF DR D	ANT		93.779	52.264	0	EUR 55,328	5.188.604,51	2,67
IE00BGGJJB67	Baillie G.W.-Health Innovat.Fd Reg.Acc.Shs B	ANT		66.175	66.175	0	EUR 19,753	1.307.128,31	0,67
LU1819479939	Ech.Fd-Ech.Artif. Intelligence Act. Nom. K Acc.	ANT		5.801	5.801	0	EUR 259,550	1.505.649,55	0,77
LU0399027886	Flossbach von Storch-Bd Oppor. I	ANT		31.232	3.723	0	EUR 146,140	4.564.244,48	2,35
DE000A0H0785	iShares Euro Government Bond Capped 1.5-10.5yr UCITS ETF (DE)	ANT		116.458	14.852	0	EUR 125,095	14.568.313,51	7,50
DE000A0H08M3	iShares STOXX Europe 600 Oil & Gas UCITS ETF (DE)	ANT		70.955	11.218	0	EUR 29,665	2.104.880,08	1,08
DE0002635307	iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE)	ANT		101.765	42.188	0	EUR 46,865	4.769.216,73	2,45
DE0005933998	iShares STOXX Europe Mid 200 UCITS ETF (DE)	ANT		61.171	17.454	37.430	EUR 56,700	3.468.395,70	1,78
IE00B0M62X26	iShs EO Inf.Li.Gov.Bd U.ETF(D) Reg.Shares	ANT		39.928	6.885	6.376	EUR 236,760	9.453.353,28	4,86
IE00B3F81R35	iShsIII-Core EO Corp.Bd U.ETF Reg.Shares	ANT		145.796	34.951	0	EUR 133,665	19.487.822,34	10,04
LU0750223520	Jupiter Global Fd-J.Dynamic Bd Namens-Ant.I Q Inc.	ANT		917.799	327.754	0	EUR 10,660	9.783.737,34	5,03
LU0496786574	MUL-LYXOR S&P 500 UCITS ETF Dis.	ANT		181.654	118.275	0	EUR 40,236	7.309.030,34	3,76
IE00BTL1H815	Nomura Fds Ire-Gl.Dynamic Bond Reg.Shares Hedged	ANT		45.133	3.737	0	EUR 108,253	4.885.760,08	2,51
IE00B8D0PH41	PIMCO Fds GIS - Income Fund Reg.Shs Inst. H. Inc.	ANT		927.387	150.015	0	EUR 10,460	9.700.468,02	4,99
LU0302976872	Swisscanto(LU)Eq.-Sus.Gl Water AT	ANT		4.478	12.695	8.217	EUR 297,020	1.330.055,56	0,68
LU2187597856	Thr.L.-Global Small.Companies IEP Dis.	ANT		183.157	32.393	125.198	EUR 15,426	2.825.434,83	1,45
LU1864952418	Threadneedle L-Euro. Sm. Comp. Act. Nom. 1EP Dis.	ANT		226.546	124.497	0	EUR 16,131	3.654.481,49	1,88
IE00B78JSG98	UBS(I)ETF-MSCI USA VALUE U.E. Reg.Shares A Dis.	ANT		69.350	10.944	0	EUR 84,600	5.867.010,00	3,02
LU0480132876	UBS(L)FS-MSCI EM UCITS ETF A-dis	ANT		48.216	27.179	0	EUR 107,605	5.188.282,68	2,67
IE00BG143G97	Vanguard Fds-V.Ger.All Cap U.E Reg. Dis.	ANT		129.612	37.395	0	EUR 28,120	3.644.689,44	1,88
USD								12.343.371,22	6,36
IE00B5M4WH52	iShsIII-iSh.JPM EM L.G.B.U.ETF Reg.Shares	ANT		83.666	20.337	0	USD 52,790	3.784.199,24	1,95
IE00B4KBB001	iShsV-S&P 500 Ut.Sector U.ETF Reg.Shares (Acc)	ANT		613.625	613.625	0	USD 7,420	3.901.038,86	2,01
LU0318931358	JPMorgan Fds-Emerg.Mkts Sm.Cap A.N.JPM-EMSC A(per)	ANT		252.051	131.457	0	USD 21,570	4.658.133,12	2,40
Summe Wertpapiervermögen								EUR 189.807.740,01	97,67
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale	EUR		6.951.283,69			% 100,000	6.951.283,69	3,58
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale	JPY		2.720.704,00			% 100,000	20.518,90	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale	USD		628,96			% 100,000	538,89	0,00
Summe Bankguthaben								EUR 6.972.341,48	3,59
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR 6.972.341,48	3,59
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Forderungen aus Anteilschneingeschäften	EUR		354.266,01				354.266,01	0,18
	Sonstige Forderungen	EUR		1.150,41				1.150,41	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 355.416,42	0,18
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften	EUR		-21.865,91				-21.865,91	-0,01
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften	EUR		-2.646.801,40				-2.646.801,40	-1,36
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten	EUR		-135.938,05				-135.938,05	-0,07
Summe Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -2.804.605,36	-1,44

MBS Invest 2

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2021	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Fondsvermögen						EUR	194.330.892,55	100,00
	Umlaufende Anteile						STK	18.353.782,000	
	Anteilwert						EUR	10,59	

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

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.10.2021

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,16715	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	132,59500	= 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
	Wertpapier-Investmentanteile			
	Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile			
	EUR			
LU1681041031	AIS-Am.FLOAT.RATE DL CORP.ESG Nam.-Ant.U.ETF DR H	ANT	0	107.654
	JPY			
IE00BYMD0W65	Polar Capital Fds-P.C.Jap.Val. Reg.Shares I	ANT	123.279	2.019.911

Gattungsbezeichnung

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Devisentermingeschäfte

Devisenterminkontrakte (Kauf)

Kauf von Devisen auf Termin:

JPY/EUR	EUR	121
---------	-----	-----

MBS Invest 2

Entwicklung des Sondervermögens

		EUR
I.	Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	152.347.243,75
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr	-769.651,30
2	Zwischenausschüttung(en)	-870.939,75
3	Mittelzufluss (netto)	39.991.695,39
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 42.277.663,71
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 42.277.663,71
	davon aus Verschmelzung	EUR 0,00
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR -2.285.968,32
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-224.389,29
5	Ergebnis des Geschäftsjahres	3.856.933,75
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	2.814.043,06
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-1.266.305,18
II.	Wert des Sondervermögens zur Mitte des Geschäftsjahres	194.330.892,55

MBS Invest 2

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.05.2021 - 31.10.2021 (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	0,00	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-34.044,02	-0,00
davon Negative Einlagezinsen	-34.095,77	-0,00
davon Positive Einlagezinsen	51,75	0,00
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	2.136.545,77	0,12
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	0,00	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	0,00	0,00
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	0,00	0,00
10. Sonstige Erträge	29.434,42	0,00
davon Kick-Back-Zahlungen	21.719,18	0,00
davon Rückvergütung aus Zielfonds	7.715,24	0,00
Summe der Erträge	2.131.936,17	0,12
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-1.209,32	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-752.188,59	-0,04
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-94.023,64	-0,01
davon Kostenpauschale	-94.023,64	-0,01
Summe der Aufwendungen	-847.421,55	-0,05
III. Ordentlicher Nettoertrag	1.284.514,62	0,07
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	1.043.289,87	0,06
2. Realisierte Verluste	-18.608,62	-0,00
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	1.024.681,25	0,06
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	2.309.195,87	0,13
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	2.814.043,06	0,15
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-1.266.305,18	-0,07
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	1.547.737,88	0,08
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	3.856.933,75	0,21

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

MBS Invest 2

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	18.353.782
Anteilwert	EUR	10,59

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)

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehens-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

Frankfurt am Main, den 1. November 2021
Deka Vermögensmanagement GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Vermögensmanagement GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

16.09.1988

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2020

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 20,7 Mio.

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Serge Demolière, Berlin

Wolfgang Dürr, Trier

Steffen Matthias, Berlin

Victor Mofitakhar

Mitglied des Vorstandes der
Stiftung Fonds zur Finanzierung der kerntechnischen Entsorgung,
Berlin

Geschäftsführung

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

Dirk Heuser

Thomas Ketter

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

Thomas Schneider

Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,
Frankfurt am Main;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,
Luxemburg;
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: 31. Oktober 2021

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



**Deka Vermögens-
management 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

 **Finanzgruppe**