

# Halbjahresbericht zum 31. März 2022. Frankfurter-Sparinvest Deka

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

Verwaltungsgesellschaft: Deka Investment GmbH

# Bericht der Geschäftsführung.

31. März 2022

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Frankfurter-Sparinvest Deka 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](http://www.deka.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka 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.**

# Frankfurter-Sparinvest Deka Anlagepolitik.

Das Anlageziel dieses Investmentfonds ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Mit diesem verfolgt das Fondsmanagement die Strategie, mindestens 60% in Aktien von Unternehmen zu investieren, die in deutschen Aktienindizes enthalten sind. Der Fonds investiert dabei überwiegend in Standardwerte (so genannte Blue Chips). Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen einer Gesamtunternehmenseinschätzung, wobei in erster Linie Bilanzdaten und betriebswirtschaftliche Kennzahlen wie z.B. Eigenkapitalquote und Nettoverschuldung sowie qualitative Bewertungskriterien wie z.B. die Qualität der Produkte und des Geschäftsmodells des Unternehmens analysiert werden. Ergänzend wird die Markt- und Branchenattraktivität auf Basis volkswirtschaftlicher Daten bewertet. Um den Erfolg des Wertpapierauswahlprozesses zu bewerten wird der Index 100% HDAX Total Return in EUR<sup>(1)</sup> verwendet. Die initiale und kontinuierliche Wertpapierauswahl erfolgt im Rahmen des beschriebenen Investmentansatzes unabhängig von diesem Referenzwert und damit verbundenen quantitativen oder qualitativen Einschränkungen.

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.

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35% des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland und des Landes Hessen investieren.

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

Die Erträge eines Geschäftsjahres werden grundsätzlich ausgeschüttet.

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

## Wichtige Kennzahlen

### Frankfurter-Sparinvest Deka

Performance*	6 Monate
	-6,3%
ISIN	DE0008480732
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

1) Referenzindex: 100% HDAX Total Return in EUR<sup>®</sup>. Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Index-Marke stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

# Frankfurter-Sparinvest Deka

## Vermögensübersicht zum 31. März 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>70.531.158,54</b>	<b>98,94</b>
Deutschland	57.187.173,97	80,21
Frankreich	1.357.650,00	1,91
Irland	6.481.861,80	9,10
Luxemburg	1.193.655,12	1,67
Niederlande	4.155.267,48	5,83
Schweiz	155.550,17	0,22
<b>2. Derivate</b>	<b>-299.363,45</b>	<b>-0,43</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.222.994,06</b>	<b>1,72</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>183.416,27</b>	<b>0,25</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-344.687,87</b>	<b>-0,48</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>71.293.517,55</b>	<b>100,00</b>

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>70.531.158,54</b>	<b>98,94</b>
CHF	155.550,17	0,22
EUR	70.375.608,37	98,72
<b>2. Derivate</b>	<b>-299.363,45</b>	<b>-0,43</b>
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.222.994,06</b>	<b>1,72</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>183.416,27</b>	<b>0,25</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-344.687,87</b>	<b>-0,48</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>71.293.517,55</b>	<b>100,00</b>

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

# Frankfurter-Sparinvest Deko

## 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 *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>70.409.058,54</b>	<b>98,77</b>
<b>Aktien</b>								<b>70.409.058,54</b>	<b>98,77</b>
<b>EUR</b>								<b>70.253.508,37</b>	<b>98,55</b>
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien		STK	5.890	0	3.500	EUR 215,350	1.268.411,50	1,78
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét. Expl. P.G. Cl. Actions Port.		STK	5.000	5.000	0	EUR 159,240	796.200,00	1,12
NL0000235190	Airbus SE Aandelen op naam		STK	28.200	3.500	4.900	EUR 110,880	3.126.816,00	4,39
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE Namens-Aktien		STK	6.000	0	0	EUR 20,280	121.680,00	0,17
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien		STK	11.580	1.000	2.000	EUR 217,050	2.513.439,00	3,53
LU1673108939	Aroundtown SA Bearer Shares		STK	65.550	65.000	0	EUR 5,300	347.415,00	0,49
DE0006766504	Aurubis AG Inhaber-Aktien		STK	1.500	3.500	2.000	EUR 110,150	165.225,00	0,23
DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien		STK	20.180	10.000	14.500	EUR 53,250	1.074.585,00	1,51
DE000BAY0017	Bayer AG Namens-Aktien		STK	52.472	20.000	0	EUR 62,540	3.281.598,88	4,60
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien		STK	5.150	0	2.000	EUR 79,890	411.433,50	0,58
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien		STK	4.250	0	0	EUR 71,550	304.087,50	0,43
DE0005158703	Bechtle AG Inhaber-Aktien		STK	8.000	8.000	0	EUR 51,460	411.680,00	0,58
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien		STK	6.000	6.000	2.500	EUR 95,840	575.040,00	0,81
DE000A3CQ7F4	Bike24 Holding AG Inhaber-Aktien		STK	9.400	0	0	EUR 9,760	91.744,00	0,13
DE0005419105	CANCOM SE Inhaber-Aktien		STK	6.500	0	0	EUR 56,640	368.160,00	0,52
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien		STK	3.400	5.900	2.500	EUR 147,350	500.990,00	0,70
DE000CBK1001	Commerzbank AG Inhaber-Aktien		STK	65.000	110.000	45.000	EUR 7,254	471.510,00	0,66
DE000A288904	CompuGroup Medical SE & Co. KGaA Namens-Aktien		STK	3.500	3.500	0	EUR 55,250	193.375,00	0,27
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien		STK	13.940	12.000	14.000	EUR 46,960	654.622,40	0,92
NL00150006R6	CTP N.V. Aandelen op naam		STK	0	21.562	21.562	EUR 14,950	7,48	0,00
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG junge Namens-Aktien		STK	10.785	24.285	13.500	EUR 26,100	281.488,50	0,39
DE0005140008	Deutsche Bank AG Namens-Aktien		STK	77.600	80.000	111.000	EUR 11,864	920.646,40	1,29
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien		STK	12.450	2.300	0	EUR 164,250	2.044.912,50	2,87
DE000A14KRD3	Deutsche Konsum REIT-AG Inhaber-Aktien		STK	25.778	0	0	EUR 12,850	331.247,30	0,46
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien		STK	46.700	0	8.500	EUR 44,290	2.068.343,00	2,90
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien		STK	189.300	25.000	32.000	EUR 17,096	3.236.272,80	4,54
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien		STK	110.148	30.000	49.000	EUR 10,728	1.181.667,74	1,66
DE0006095003	ENCAVIS AG Inhaber-Aktien		STK	31.000	21.000	0	EUR 18,920	586.520,00	0,82
DE000EVNK013	Evonik Industries AG Namens-Aktien		STK	9.600	8.000	8.400	EUR 25,690	246.624,00	0,35
DE0005664809	Evotec SE Inhaber-Aktien		STK	6.400	0	5.400	EUR 27,970	179.008,00	0,25
DE0005773303	Fraport AG Ffm. Airport. Ser. AG Inhaber-Aktien		STK	6.000	4.500	6.000	EUR 50,360	302.160,00	0,42
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien		STK	12.000	12.000	6.150	EUR 60,660	727.920,00	1,02
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien		STK	19.550	0	8.500	EUR 33,515	655.218,25	0,92
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG Inhaber-Aktien		STK	8.900	5.500	4.500	EUR 67,500	600.750,00	0,84
DE000A161408	HelloFresh SE Inhaber-Aktien		STK	15.220	2.000	0	EUR 43,540	662.678,80	0,93
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien		STK	9.500	12.000	2.500	EUR 53,220	505.590,00	0,71
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien		STK	71.480	9.000	5.200	EUR 31,060	2.220.168,80	3,11
DE000A2NBX80	Instone Real Estate Group SE Inhaber-Aktien		STK	26.000	0	15.000	EUR 17,020	442.520,00	0,62
DE000KSAG888	K+S Aktiengesellschaft Namens-Aktien		STK	23.000	14.000	28.000	EUR 27,270	627.210,00	0,88
DE000A2TSQH7	KATEK SE Inhaber-Aktien		STK	11.300	0	0	EUR 19,500	220.350,00	0,31
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien		STK	6.000	6.000	0	EUR 70,720	424.320,00	0,60
IE00BZ12WBP82	Linde PLC Reg. Shares		STK	22.164	2.500	4.700	EUR 292,450	6.481.861,80	9,10
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien		STK	43.270	8.000	13.300	EUR 64,610	2.795.674,70	3,92
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien		STK	5.950	0	0	EUR 192,850	1.147.457,50	1,61
DE0006632003	MorphoSys AG Inhaber-Aktien		STK	6.000	0	0	EUR 24,810	148.860,00	0,21
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG Namens-Aktien		STK	3.500	3.500	0	EUR 209,800	734.300,00	1,03
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien		STK	7.900	0	1.000	EUR 244,300	1.929.970,00	2,71
DE000A0D6554	Nordex SE Inhaber-Aktien		STK	10.000	10.000	0	EUR 15,420	154.200,00	0,22
LU2356314745	Novem Group S.A. Reg. Shares		STK	21.981	0	6.519	EUR 10,520	231.240,12	0,32
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien		STK	14.200	0	4.100	EUR 88,660	1.258.972,00	1,77
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien		STK	7.875	0	0	EUR 78,200	615.825,00	0,86
NL0012169213	Qiagen N.V. Aandelen op naam		STK	16.600	12.000	3.700	EUR 44,740	742.684,00	1,04
DE0007030009	Rheinmetall AG Inhaber-Aktien		STK	2.500	2.500	0	EUR 194,950	487.375,00	0,68
DE0007037129	RWE AG Inhaber-Aktien		STK	50.500	17.500	0	EUR 39,930	2.016.465,00	2,83
DE0006202005	Salzgitter AG Inhaber-Aktien		STK	5.000	5.000	0	EUR 43,000	215.000,00	0,30
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien		STK	40.400	1.500	12.800	EUR 102,240	4.130.496,00	5,79
DE0007165631	Sartorius AG Vorzugsaktien		STK	890	350	0	EUR 407,800	362.942,00	0,51
FR0010411983	SCOR SE Actions au Porteur		STK	19.000	0	13.500	EUR 29,550	561.450,00	0,79
DE000A12DM80	Scout24 SE Namens-Aktien		STK	3.700	0	0	EUR 53,000	196.100,00	0,28
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien		STK	35.990	9.800	6.300	EUR 128,220	4.614.637,80	6,47
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG Namens-Aktien		STK	29.045	0	7.000	EUR 20,440	593.679,80	0,83
DE0005HL1006	Siemens Healthineers AG Namens-Aktien		STK	23.600	10.000	3.800	EUR 55,980	1.321.128,00	1,85
NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen op naam		STK	19.000	0	0	EUR 15,040	285.760,00	0,40
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien		STK	4.500	5.000	10.000	EUR 63,100	283.950,00	0,40

# Frankfurter-Sparinvest Deko

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
LU2333210958	SUSE S.A. Actions Nominatives		STK	20.500	16.000	0	EUR 30,000	615.000,00	0,86
DE000A2TSL71	SYNLAB AG Inhaber-Aktien		STK	11.000	11.000	14.000	EUR 16,260	178.860,00	0,25
DE000TLX1005	Talanx AG Namens-Aktien		STK	10.580	0	0	EUR 40,360	427.008,80	0,60
DE000A2YN900	TeamViewer AG Inhaber-Aktien		STK	32.000	32.000	5.350	EUR 13,835	442.720,00	0,62
DE0007664039	Volkswagen AG Vorzugsaktien		STK	1.800	0	3.200	EUR 159,140	286.452,00	0,40
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien		STK	43.250	35.750	14.000	EUR 42,770	1.849.802,50	2,59
<b>CHF</b>								<b>155.550,17</b>	<b>0,22</b>
CH1110425654	Montana Aerospace AG Namens-Aktien		STK	9.900	0	0	CHF 16,200	155.550,17	0,22
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>122.100,00</b>	<b>0,17</b>
<b>Aktien</b>								<b>122.100,00</b>	<b>0,17</b>
<b>EUR</b>								<b>122.100,00</b>	<b>0,17</b>
DE000A3CMGM5	APONTIS PHARMA AG Inhaber-Aktien		STK	11.100	0	0	EUR 11,000	122.100,00	0,17
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 70.531.158,54</b>	<b>98,94</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>									
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>								<b>-317.532,50</b>	<b>-0,45</b>
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>								<b>-317.532,50</b>	<b>-0,45</b>
Allianz SE (ALV) Put Juni 22 210		XEUR	STK	-3.500			EUR 10,625	-37.187,50	-0,05
Münch. Rückvers.-Ges. AG (MUV2) Put Mai 22 260		XEUR	STK	-4.000			EUR 26,575	-106.300,00	-0,15
SAP SE (SAP) Call Juni 22 125		XEUR	STK	3.500			EUR 0,330	1.155,00	0,00
SAP SE (SAP) Put Dez. 22 120		XEUR	STK	-8.000			EUR 21,900	-175.200,00	-0,25
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>								<b>58.029,05</b>	<b>0,08</b>
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktien</b>								<b>58.029,05</b>	<b>0,08</b>
Allianz SE Future (ALV) Apr. 22		XEUR	EUR	Anzahl 65				37.352,25	0,05
Bayer AG Future (BAYN) Apr. 22		XEUR	EUR	Anzahl 20				20.676,80	0,03
<b>Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>								<b>EUR -259.503,45</b>	<b>-0,37</b>
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>-39.860,00</b>	<b>-0,06</b>
DAX-Index Future (FDAX) Juni 22		XEUR	EUR	Anzahl -11				-39.860,00	-0,06
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR -39.860,00</b>	<b>-0,06</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		EUR		1.088.091,42			% 100,000	1.088.091,42	1,53
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		SEK		5.641,34			% 100,000	546,00	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale		CHF		138.528,41			% 100,000	134.356,64	0,19
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR 1.222.994,06</b>	<b>1,72</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 1.222.994,06</b>	<b>1,72</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Dividendenansprüche		EUR		2.601,01				2.601,01	0,00
Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR		5.447,52				5.447,52	0,01
Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR		167.097,76				167.097,76	0,23
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR		8.269,98				8.269,98	0,01
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR 183.416,27</b>	<b>0,25</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR		-89.884,08				-89.884,08	-0,13
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR		-173.914,53				-173.914,53	-0,24
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR		-80.889,26				-80.889,26	-0,11
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR -344.687,87</b>	<b>-0,48</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>EUR 71.293.517,55</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>								<b>STK 471.124,000</b>	
<b>Anteilwert</b>								<b>EUR 151,33</b>	
<b>Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 1.814.198,30</b>									

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

**Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.03.2022**  
 Schweden, Kronen (SEK) 10,33205 = 1 Euro (EUR)  
 Schweiz, Franken (CHF) 1,03105 = 1 Euro (EUR)

# Frankfurter-Sparinvest Deko

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR

Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>EUR</b>				
DE000A3CNK42	ABOUT YOU Holding SE Inhaber-Aktien	STK	0	16.500
FR0010220475	Alstom S.A. Actions Porteur	STK	12.000	12.013
NL0011872643	ASR Nederland N.V. Aandelen op naam	STK	0	3.000
LU1704650164	BEFESA S.A. Actions	STK	0	900
DE000A1DAHH0	Brenntag SE Namens-Aktien	STK	0	7.600
DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien	STK	6.500	6.500
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE Namens-Aktien	STK	5.000	11.400
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien	STK	32.000	32.000
FR0000121147	Faurecia SE Actions Port.	STK	7.300	7.300
DE000A3E5D64	FUCHS PETROLUB SE Namens-Vorzugsakt.	STK	8.500	11.000
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK	0	2.300
DE0006047004	HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien	STK	0	9.400
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien	STK	0	2.800
DE000A2NB601	JENOPTIK AG Namens-Aktien	STK	6.000	6.000
DE000KGX8881	KION GROUP AG Inhaber-Aktien	STK	4.000	14.200
DE0005470405	Lanxess AG Inhaber-Aktien	STK	5.000	12.050
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE Namens-Aktien	STK	0	25.000
DE000SYM9999	Symrise AG Inhaber-Aktien	STK	7.600	7.600
DE0007500001	thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien	STK	50.000	50.000
DE000UNSE018	Uniper SE Namens-Aktien	STK	5.500	5.500
DE000VTSC017	Vitesco Technologies Group AG Namens-Aktien	STK	3.500	6.214
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien	STK	0	1.400
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien	STK	0	5.000
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>EUR</b>				
DE000A2G9LL1	Deutsche Industrie REIT-AG Inhaber-Aktien	STK	0	23.250
DE000A3MQCJ0	Deutsche Industrie REIT-AG z.Umtausch eing.Inh.-A.	STK	17.250	17.250
<b>Andere Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
DE000A3MQB30	Vonovia SE Inhaber-Bezugsrechte	STK	25.000	25.000

## Gattungsbezeichnung

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

### Terminkontrakte

#### Aktienindex-Terminkontrakte

##### Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): DAX Performance-Index, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

Volumen in 1.000

EUR

35.880

### Optionsrechte

#### Wertpapier-Optionsrechte

##### Optionsrechte auf Aktien

##### Gekaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): Allianz SE vink.Namens-Aktien, Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien)

EUR

3.340

##### Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien)

EUR

1.040



# Frankfurter-Sparinvest Deka Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	471,124
Anteilwert	EUR	151,33

## 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-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

---

Frankfurt am Main, den 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 Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale  
Main Tower  
Neue Mainzer Straße 52 - 58  
60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

rechtsfähige Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Erfurt

**Haupttätigkeit**

Geschäftsbank, Retailbank, Verbundbank und öffentliche Förderbank

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](http://www.deka.de)

