

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2021.  
**DekaFutur-ChancePlus**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2021

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds DekaFutur-ChancePlus für den Zeitraum vom 1. Januar 2021 bis zum 30. Juni 2021.

Die europäische Wirtschaft litt im Berichtszeitraum zunächst unter den Belastungen der Corona-Pandemie. So schrumpfte in Deutschland die gesamtwirtschaftliche Leistung im ersten Quartal 2021 merklich. Vor allem der private Konsum büßte durch die Lockdown-Maßnahmen angesichts erneut steigender Infektionszahlen und auftretender Virusmutationen merklich ein. Erst in der zweiten Hälfte mehrten sich die Erholungszeichen. An den Finanzmärkten gewannen in den letzten sechs Monaten optimistisch stimmende Signale die Oberhand. Die Kombination aus erfolgreich verlaufenden Impfmaßnahmen und hoher Liquidität am Markt auf der Suche nach auskömmlichen Renditen befeuerte den Risikoappetit der Anleger.

Eine wichtige Stütze bildeten im Berichtszeitraum die Geld- und Finanzpolitik. Die EZB wie auch die US-Notenbank Federal Reserve bekräftigte ihren expansiven Kurs und die Regierung unter US-Präsident Joe Biden kündigte weitere staatliche Programme an. Ausgehend von den Impulsgebern USA und China vollzog sich die Erholung des Welthandels in raschem Tempo, was sich auch in deutlich gestiegenen Rohstoffpreisen und einer merklich anziehenden Inflation dokumentierte. Im Zuge verbesserter Konjunkturperspektiven ließen die Renditen an den Anleihemärkten ihre Tiefstände hinter sich. Ende Juni 2021 rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei minus 0,2 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries bei plus 1,5 Prozent.

Die Aktienmärkte erzielten auf Halbjahressicht kräftige Kurssteigerungen, beflügelt von zahlreichen Konjunkturstimuli wie auch der anhaltenden Flutung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken. Einige etablierte Aktienindizes erreichten in diesem Zuge neue Rekordmarken.

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 30. Juni 2021	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2021	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.**

# DekaFutur-ChancePlus

## Anlagepolitik.

Das Anlageziel des DekaFutur-ChancePlus ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement investiert in ein Sortiment von Wertpapieren mit Fokussierung auf die europäischen Kapitalmärkte. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann das Fondsmanagement die Gewichtung der Anlageklassen je nach Markteinschätzung variieren: Aktien, verzinsliche Wertpapiere, Wandelschuldverschreibungen, Optionsanleihen, Genuss-Scheine und Indexzertifikate sowie in Wertpapieren verbriefte Finanzinstrumente. Der Anteil der Aktien kann zwischen 51 Prozent und 100 Prozent des Fondsvermögens betragen. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental geprägte Investmentansatz erfolgt nach einer Top-Down und Bottom-up Betrachtung. Der Ausgangspunkt ist zunächst die weltweite volkswirtschaftliche Untersuchung (Top-down-Perspektive), um die wesentlichen makroökonomischen Einflussfaktoren auf die Investmententscheidung zu bestimmen. Anschließend erfolgt bei der Zusammensetzung des Portfolios eine qualitative Einschätzung der einzelnen Vermögensgegenstände anhand verschiedener Kriterien (Bottom-up-Perspektive). Bei Aktien sind dies z.B. die Bewertung des Geschäftsmodells oder der Managementqualität, bei Anleihen z.B. die Kreditqualität oder die relative Bewertung einer Anleihe zur eigenen Zinskurve. Um den Erfolg des Wertpapierauswahlprozesses zu bewerten wird der Index 90% Euro STOXX 50®, 10% iBoxx € Germany 1-10<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.

Die Gesellschaft hat die Verwaltung des Fonds zum 30. November 2021 gekündigt, was dessen Auflösung zu diesem Zeitpunkt zur Folge hat.

Die Aktienquote im Fonds DekaFutur-ChancePlus blieb im Stichtagsvergleich weitgehend konstant. Per 30. Juni 2021 waren 91,0 Prozent in Aktien investiert. Der Anteil des Rentensegments am Fondsvermögen bestand zum Stichtag ausschließlich aus Rentenfonds und belief sich auf 4,3 Prozent (inkl. Derivate). Der Beimischung diente ein Rohstoffzertifikat auf Gold (1,2 Prozent). Der wirtschaftliche Investitionsgrad des Gesamt-Portfolios reduzierte sich per saldo und lag Ende Juni bei 93,0 Prozent (inkl. Derivate).

DekaFutur-ChancePlus verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 13,0 Prozent, der Anteilpreis notierte zum Stichtag bei 70,51 Euro.

### Wichtige Kennzahlen

#### DekaFutur-ChancePlus

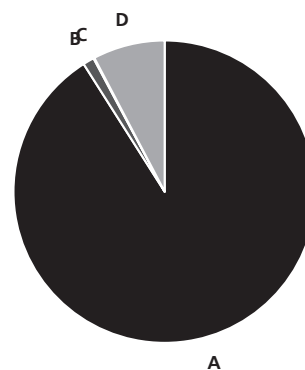
Performance*	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
	13,0%	25,4	6,2%

ISIN DE0005896849

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

### Fondsstruktur

#### DekaFutur-ChancePlus



A	Aktien	91,0%
B	Rohstoffzertifikat	1,2%
C	Rentenfonds	0,1%
D	Barreserve, Sonstiges	7,7%

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

1) Referenzindex: 90% Euro STOXX 50®, 10% iBoxx € Germany 1-10. Die oben genannten Indizes sind eingetragene Marken. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung der Indizes bzw. der Index-Marken stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

# DekaFutur-ChancePlus

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2021.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>18.701.861,36</b>	<b>90,95</b>
Belgien	328.320,00	1,60
Deutschland	5.411.612,70	26,32
Finnland	176.001,00	0,86
Frankreich	6.522.522,24	31,71
Irland	1.161.027,00	5,65
Italien	820.907,50	3,99
Niederlande	3.175.137,70	15,44
Spanien	1.106.333,22	5,38
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>23.370,97</b>	<b>0,12</b>
Irland	23.370,97	0,12
<b>3. Zertifikate</b>	<b>241.572,00</b>	<b>1,17</b>
Irland	241.572,00	1,17
<b>4. Derivate</b>	<b>13.300,00</b>	<b>0,06</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.524.692,11</b>	<b>7,43</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>74.909,76</b>	<b>0,37</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-20.373,74</b>	<b>-0,10</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>20.559.332,46</b>	<b>100,00</b>

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>18.701.861,36</b>	<b>90,95</b>
EUR	18.701.861,36	90,95
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>23.370,97</b>	<b>0,12</b>
EUR	13.994,00	0,07
USD	9.376,97	0,05
<b>3. Zertifikate</b>	<b>241.572,00</b>	<b>1,17</b>
EUR	241.572,00	1,17
<b>4. Derivate</b>	<b>13.300,00</b>	<b>0,06</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.524.692,11</b>	<b>7,43</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>74.909,76</b>	<b>0,37</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-20.373,74</b>	<b>-0,10</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>20.559.332,46</b>	<b>100,00</b>

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

# DekaFutur-ChancePlus

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2021.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>18.943.433,36</b>	<b>92,12</b>
<b>Aktien</b>								<b>18.701.861,36</b>	<b>90,95</b>
<b>EUR</b>								<b>18.701.861,36</b>	<b>90,95</b>
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien	STK		1.200	0	0	EUR 313,900	376.680,00	1,83
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam	STK		175	0	0	EUR 2.059,500	360.412,50	1,75
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		6.950	0	0	EUR 24,990	173.680,50	0,84
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port.	STK		3.000	0	0	EUR 147,840	443.520,00	2,16
NL0000235190	Airbus SE Aandelen op naam	STK		3.650	0	0	EUR 106,540	388.871,00	1,89
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		2.580	0	100	EUR 210,150	542.187,00	2,64
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port.	STK		2.800	0	0	EUR 59,120	165.536,00	0,81
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port.	STK		5.400	0	0	EUR 60,800	328.320,00	1,60
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		2.593	0	147	EUR 581,900	1.508.866,70	7,35
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		13.250	0	0	EUR 21,315	282.423,75	1,37
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom.	STK		108.655	0	7.500	EUR 3,230	350.901,32	1,71
DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien	STK		5.900	0	0	EUR 66,070	389.813,00	1,90
DE000BAY0017	Bayer AG Namens-Aktien	STK		6.200	0	0	EUR 51,090	316.758,00	1,54
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien	STK		1.980	0	220	EUR 89,300	176.814,00	0,86
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK		7.130	0	370	EUR 52,690	375.679,70	1,83
IE0001827041	CRH PLC Reg.Shares	STK		5.000	0	0	EUR 42,750	213.750,00	1,04
DE0007100000	Daimler AG Namens-Aktien	STK		5.190	0	310	EUR 74,960	389.042,40	1,89
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port.	STK		4.300	0	0	EUR 59,400	255.420,00	1,24
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien	STK		1.200	0	0	EUR 147,700	177.240,00	0,86
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK		6.200	0	0	EUR 57,710	357.802,00	1,74
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		20.000	0	0	EUR 17,774	355.480,00	1,73
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK		49.500	0	0	EUR 7,891	390.604,50	1,90
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port.	STK		12.000	0	0	EUR 11,444	137.328,00	0,67
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom.	STK		17.000	0	0	EUR 10,284	174.828,00	0,85
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port.	STK		1.900	0	0	EUR 156,300	296.970,00	1,44
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC Reg.Shares	STK		1.020	0	0	EUR 153,200	156.264,00	0,76
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK		37.343	526	1	EUR 10,265	383.325,90	1,86
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK		7.000	0	0	EUR 29,510	206.570,00	1,00
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK		8.180	8.180	0	EUR 34,035	278.406,30	1,35
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam	STK		24.100	0	1.900	EUR 11,108	267.702,80	1,30
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK		110.000	0	0	EUR 2,323	255.475,00	1,24
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port.	STK		470	0	0	EUR 740,900	348.223,00	1,69
FI0009013403	KONE Oyj Reg.Shares Cl.B	STK		2.550	0	0	EUR 69,020	176.001,00	0,86
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder	STK		5.847	106	0	EUR 41,850	244.716,20	1,19
IE00BZ12WP82	Linde PLC Reg.Shares	STK		3.270	0	230	EUR 241,900	791.013,00	3,85
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		1.540	0	0	EUR 376,450	579.733,00	2,82
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Action Port.(C.R.)	STK		1.660	0	50	EUR 664,200	1.102.572,00	5,36
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		880	0	0	EUR 232,150	204.292,00	0,99
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. Actions Port.(C.R.)	STK		1.260	0	0	EUR 187,600	236.376,00	1,15
NL0013654783	Prosus N.V. Reg.Shares	STK		2.800	0	0	EUR 82,460	230.888,00	1,12
FR0000073272	Safran Actions Port.	STK		2.220	0	0	EUR 116,180	257.919,60	1,25
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		7.055	0	280	EUR 87,850	619.781,75	3,01
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK		6.840	0	200	EUR 119,200	815.328,00	3,97
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port.	STK		3.500	0	0	EUR 132,500	463.750,00	2,26
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK		4.700	0	0	EUR 133,260	626.322,00	3,05
FR0000120271	TotalEnergies SE Actions au Porteur	STK		16.701	0	0	EUR 38,285	639.397,79	3,11
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK		3.555	0	0	EUR 89,830	319.345,65	1,55
FR0000127771	Vivendi S.A. Actions Porteur	STK		5.800	0	0	EUR 28,290	164.082,00	0,80
DE0007664039	Volkswagen AG Vorzugsaktien	STK		1.100	0	0	EUR 210,800	231.880,00	1,13
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien	STK		3.200	0	0	EUR 54,240	173.568,00	0,84
<b>Zertifikate</b>								<b>241.572,00</b>	<b>1,17</b>
<b>EUR</b>								<b>241.572,00</b>	<b>1,17</b>
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18	STK		4.100	21.200	26.100	EUR 58,920	241.572,00	1,17
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>23.370,97</b>	<b>0,12</b>
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>23.370,97</b>	<b>0,12</b>
<b>EUR</b>								<b>13.994,00</b>	<b>0,07</b>
IE0032523478	iShs-EO Corp Bd Lar.Cap U.ETF Reg.Shares	ANT		100	0	1.400	EUR 139,940	13.994,00	0,07
<b>USD</b>								<b>9.376,97</b>	<b>0,05</b>
IE00B2NPKV68	iShsII-J.P.M.USD EM Bond U.ETF Reg.Shares	ANT		100	0	0	USD 111,600	9.376,97	0,05
<b>Summe Wertpapiervermögen<sup>1)</sup></b>								<b>EUR 18.966.804,33</b>	<b>92,24</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									

# DekaFutur-ChancePlus

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
	DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 21	XEUR	EUR	Anzahl -18				13.050,00	0,06
	<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>						EUR	13.050,00	0,06
<b>Zins-Derivate</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>									
	EURO Bund Future (FGBL) Sep. 21	XEUR	EUR	500.000				250,00	0,00
	<b>Summe Zins-Derivate</b>						EUR	250,00	0,00
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.508.582,34			% 100,000	1.508.582,34	7,35
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	182,65			% 100,000	19,76	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	19.149,52			% 100,000	16.090,01	0,08
	<b>Summe Bankguthaben</b>						EUR	1.524.692,11	7,43
	<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>						EUR	1.524.692,11	7,43
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Dividendenansprüche		EUR	11.022,66				11.022,66	0,05
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	58.643,80				58.643,80	0,29
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	2,92				2,92	0,00
	Forderungen aus Quellensteuerrückstellung		EUR	5.240,38				5.240,38	0,03
	<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>						EUR	74.909,76	0,37
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>									
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	-0,34			% 100,000	-0,31	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	-166.595,00			% 100,000	-1.266,40	-0,01
	<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>						EUR	-1.266,71	-0,01
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-0,96				-0,96	0,00
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-19.106,07				-19.106,07	-0,09
	<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>						EUR	-19.107,03	-0,09
<b>Fondsvermögen</b>									
	<b>Umlaufende Anteile</b>						EUR	20.559.332,46	100,00
	<b>Anteilwert</b>						STK	291.600,000	
							EUR	70,51	

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

<sup>1)</sup> Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2021

Schweiz, Franken	(CHF)	1,09720 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,19015 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	131,55000 = 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	9,24220 = 1 Euro (EUR)

## 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>				
FI0009000681	Nokia Oyj Reg.Shares	STK	0	40.000
<b>Andere Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES06445809L2	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	36.818	36.818
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>EUR</b>				
ES0144583236	Iberdrola S.A. Acciones Port. Em.01/21	STK	526	526

# DekaFutur-ChancePlus

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b> (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nikkei 225 Stock Average Index (JPY), S&P 500 Index)	EUR	1.959
<b>Verkaufte Kontrakte:</b> (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), MSCI Emerging Markets Index, S&P 500 Index)	EUR	10.582
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b> (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY))	EUR	19.796
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b> USD/EUR	EUR	2.894
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b> USD/EUR	EUR	2.867
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
<b>unbefristet</b> (Basiswert(e): Adyen N.V. Aandelen op naam, Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port., BNP Paribas S.A. Actions Port., Daimler AG Namens-Aktien, Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom., Nokia Oyj Reg.Shares)	EUR	2.936



# DekaFutur-ChancePlus

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	291.600
Anteilwert	EUR	70,51

### 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 / Investmentanteile

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzumina 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, z.B. Broker-Quotes, zugrunde gelegt, welche sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Investmentanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs bewertet.

#### Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Verzinsliche Wertpapiere, rentenähnliche Genussscheine, Zertifikate und Schuldscheindarlehen, 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 mittels externer Modellkurse, z.B. Broker-Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.

#### Bankguthaben

Der Wert von Bankguthaben, Einlagezertifikaten und ausstehenden Forderungen, Bardividenden und Zinsansprüchen entspricht grundsätzlich dem jeweiligen nominalen Betrag.

#### 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. Die Bewertung von 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, erfolgt anhand von Fair Values, 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.

#### 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)

Im Sondervermögen bestehen zum Berichtsstichtag keine offenen Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte. Erläuterungen gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nur für zeitraumbezogene Angaben erforderlich.

#### Ertrags- und Kostenanteile

##### Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	180,67	100,00
Kostenanteil des Fonds	46,48	25,73
Ertragsanteil der KVG	46,48	25,73

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften gerechnet.

Neben dem oben ausgewiesenen Kostenanteil für den Fonds fielen bis 31. Dezember 2020 für den Fall, dass Aktien Gegenstand von Wertpapier-Darlehensgeschäften waren, zusätzliche Kosten Dritter an. Diese wurden bereits vor Zufluss der Erträge aus dem Wertpapier-Darlehen an den Fonds in Abzug gebracht. Sie betragen 25% der Bruttoerträge aus den Wertpapier-Darlehensgeschäften. Seit dem 1. Januar 2021 beinhaltet der oben ausgewiesene Kostenanteil sowohl den Aufwandsersatz der Kapitalverwaltungsgesellschaft als auch zusätzliche Kosten Dritter.

---

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2021  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2020

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

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 2021

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)