

Jahresbericht
zum 30. September 2023.

WertpapierStrategiePortfolio A

Ein Gemischtes Sondervermögen deutschen Rechts (AIF).



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

30. September 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds WertpapierStrategiePortfolio A für den Zeitraum vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023.

Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor dämpften im Herbst 2022 die Börsenstimmung in Europa, diese nahmen allerdings angesichts eines milden Winters im Verlauf spürbar ab. Damit sank auch der Einfluss des russischen Angriffskriegs auf die Kapitalmarktentwicklung. Die rigide Null-Covid-Politik in China führte in den ersten Monaten noch zu deutlichen Beeinträchtigungen im globalen Handel, die sich nach dem Paradigmenwechsel in der Corona-Politik im Dezember sukzessive reduzierten. In Deutschland und dem Euroraum hat sich die Konjunktur dennoch merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Wesentlicher Faktor war hierbei die Geldpolitik der führenden Notenbanken. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtsjahr die Inflationsentwicklung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten zwang. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt war, erhöhte die EZB die Leitzinsen bis auf 4,50 Prozent. An den Rentenmärkten zogen die Renditen zunächst kräftig an, ehe eine Seitwärtstendenz einsetzte und erst im letzten Monat erneut deutliche Anstiege zu konstatieren waren. Im Betrachtungszeitraum erhöhte sich die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen auf 2,8 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen Ende September bei 4,6 Prozent.

Angesichts zahlreicher Belastungsfaktoren wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode einige Schwankungen auf. Bis zum Sommer überwogen hierbei die positiven Vorzeichen, ehe zuletzt wieder belastende Faktoren zunahmen. Stark unter Druck stand anfangs der Euro, der vorübergehend unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, sich jedoch anschließend wieder erholte. Der Ölpreis zeigte ebenfalls eine hohe Volatilität und tendierte zuletzt bei 95,3 US-Dollar pro Barrel (Brent Future).

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 2023	9
Vermögensaufstellung zum 30. September 2023	10
Anhang	23
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	28
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	30

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

Jahresbericht 01.10.2022 bis 30.09.2023

WertpapierStrategiePortfolio A

Tätigkeitsbericht.

Das Anlageziel des Fonds WertpapierStrategiePortfolio A ist es, einen mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachs zu erwirtschaften. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds in Wertpapiere, globale Aktien, Anleihen, Investmentanteile, Geldmarktinstrumente und sogenannte sonstige Anlageinstrumente an. Der Fonds kann vollständig in Wertpapieren angelegt sein. Darüber hinaus kann der Fonds bis zu 49 Prozent in Geldmarktinstrumente anlegen.

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

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z.B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Der Fonds wird von der Münster Stegmaier Rombach Family Office GmbH beraten.

Die Portfolioverwaltung für das Sondervermögen WertpapierStrategiePortfolio A wird von der Deka Investment GmbH mit Sitz in Frankfurt am Main, der LOYS AG mit Sitz in Oldenburg, der First Private Investment Management KAG mbH mit Sitz in Frankfurt am Main und der ODDO BHF Asset Management GmbH mit Sitz in Düsseldorf übernommen. Diese setzen die Anlagestrategie in voneinander getrennten Segmenten um.

Wichtige Kennzahlen

WertpapierStrategiePortfolio A

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
	7,6%	3,3%	3,2%

ISIN DE000DK0LJ87

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

Übersicht der Anlagegeschäfte im Berichtszeitraum

WertpapierStrategiePortfolio A

Wertpapier-Käufe	in Euro
Renten	0
Rentenartige Wertpapiere und Rentenfonds	0
Aktien	104.424.943
Aktienartige Wertpapiere und Aktienfonds	76.488.283
Sonstige Wertpapiere und Fonds	0
Gesamt	180.913.226

Wertpapier-Verkäufe	in Euro
Renten	0
Rentenartige Wertpapiere und Rentenfonds	0
Aktien	102.957.669
Aktienartige Wertpapiere und Aktienfonds	87.099.393
Sonstige Wertpapiere und Fonds	2.543.000
Gesamt	192.600.062

Spürbares Plus

Im Berichtszeitraum rückte die Corona-Pandemie sowie der Ukraine-Krieg sukzessive in den Hintergrund des internationalen Finanzmarktgeschehens. Hohe Energie- und Rohstoffpreise als Folge von Sanktionsmaßnahmen sorgten zwar zeitweise noch für Verunsicherung. Im weiteren Verlauf schwangen sich jedoch Inflation und die Geldpolitik der Notenbanken zu den dominierenden Themen an den Börsen auf. Die Abkehr von der strikten Null-Covid-Politik in China mit damit verbundenen Lockdown-Maßnahmen belebte den globalen Handel, die chinesische Konjunktur blieb im weiteren Verlauf jedoch hinter den Erwartungen zurück. Im März führte die Schieflage mehrerer US-Banken sowie die Notübernahme der Schweizer Credit Suisse zu zeitweiligen Turbulenzen im Bankenbereich. Insgesamt aber konnten die Indizes seit dem Herbst 2022 merklich zulegen. Insbesondere die großen Technologiekonzerne wiesen deutliche Kurszuwächse auf.

In der Berichtsperiode wurde der Investitionsgrad durchgehend auf hohem Niveau gehalten. Zum Ende des Berichtszeitraums waren 97,9 Prozent des Fondsvermögens in Wertpapieren investiert. Dabei legte das Fondsmanagement weiterhin einen Fokus auf Aktienfonds mit unterschiedlichen regionalen und thematischen Schwerpunkten. Diese machten Ende September 2023 63,9 Prozent des Fondsvolumens aus. Daneben war weiterhin ein deutlicher Anteil des Fondsvermögens direkt in internatio-

WertpapierStrategiePortfolio A

nale Aktien investiert. Diese Engagements umfassten zuletzt 33,2 Prozent. Unter regionalen Gesichtspunkten führten bei den Direktanlagen US-Aktien die Aufstellung an. Auf Branchenebene wurde eine breite Streuung gewählt, wobei bei den Einzelwerten die Sektoren Industrie und Technologie die größten Positionen bildeten. Dem Portfolio war zudem ein gemischter Fonds als Beimischung beigefügt. Der überwiegende Teil der Engagements notierte in Euro. Außerhalb des Euro-Raums entfiel die größte Position auf den US-Dollar.

In der Berichtsperiode wirkte sich die deutliche Aufwärtsbewegung bei den großen US-Technologiefirmen auch auf den Fonds positiv aus. Daneben war die Beimischung von Goldproduzenten über einen Zielfonds vorteilhaft. Nachteilige Effekte resultierten u.a. aus dem Bereich Mid und Small Caps sowie aus der Bewertungskorrektur durch den Zinsanstieg an den Rentenmärkten.

Der Fonds WertpapierStrategiePortfolio A verzeichnete auf Jahressicht eine Wertentwicklung von plus 7,6 Prozent.

Im Folgenden werden wesentliche Risiken und wirtschaftliche Unsicherheiten erläutert:

Die Vermögensgegenstände, in die die Gesellschaft für Rechnung des Fonds investiert, sind Risiken ausgesetzt. So können Wertverluste auftreten, indem der Marktwert der Vermögensgegenstände fällt oder Kassa- und Terminpreise sich unterschiedlich entwickeln.

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird (Marktrisiken).

Die Risiken von Investmentanteilen, die für einen Fonds erworben werden (so genannte „Zielfonds“), stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Zielfonds enthaltenen Vermögensgegenstände und der verfolgten Anlagestrategien. Das Engagement in Investmentanteilen ist somit marktüblichen und spezifischen Risiken unterworfen. Da die Manager der einzelnen Zielfonds voneinander unabhängig handeln, kann es vorkommen, dass mehrere Zielfonds gleiche Engagements tätigen. Dieses Sondervermögen enthält Anteile an anderen Fonds, die in Aktien und Renten investieren. Insofern unterliegt der Fonds mittelbar spezifischen Risiken wie dem Zinsänderungs- und Adressenausfallrisiko sowie Aktienkursrisiken.

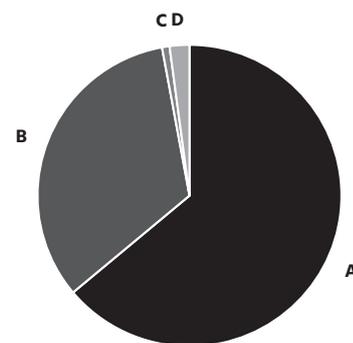
Vermögenswerte des Fonds können in einer anderen Währung als der Fondswährung angelegt sein. Der Fonds erhält die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der anderen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert solcher Anlagen und somit auch der Wert des Fondsvermögens.

Veräußerungsergebnisse im Berichtszeitraum WertpapierStrategiePortfolio A

Realisierte Gewinne aus	in Euro
Renten und Zertifikate	0,00
Aktien	5.239.009,03
Zielfonds und Investmentvermögen	2.290.182,10
Optionen	0,00
Futures	0,00
Swaps	0,00
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	632,68
Devisenkassageschäften	34.375,23
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	7.564.199,04

Realisierte Verluste aus	in Euro
Renten und Zertifikate	0,00
Aktien	-10.714.771,72
Zielfonds und Investmentvermögen	-10.212.701,56
Optionen	0,00
Futures	0,00
Swaps	0,00
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	-14.351,46
Devisenkassageschäften	-327.467,14
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	-21.269.291,88

Fondsstruktur WertpapierStrategiePortfolio A



A	Aktienfonds	63,9%
B	Aktien	33,2%
C	Gemischte Fonds	0,8%
D	Barreserve, Sonstiges	2,1%

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

Der Fonds darf Geschäfte mit Derivaten tätigen. Im Falle von Absicherungsgeschäften, die der Verringerung des Gesamtrisikos dienen, können ggf. auch die Renditechancen reduziert werden. Sofern im Rahmen der Anlagestrategie systematisch Derivate zu Investitionszwecken eingesetzt werden, kann sich das Verlustrisiko

WertpapierStrategiePortfolio A

des Sondervermögens erhöhen. Der Einsatz von Derivaten birgt Risiken. Diese sind u.a. Kursänderungen des Basiswerts, Hebelrisiken, Stillhalterrisiken sowie allgemeine Marktschwankungen.

Die Veräußerbarkeit von Vermögenswerten kann potenziell eingeschränkt sein (Liquiditätsrisiko). Dies kann beispielsweise dazu führen, dass gegebenenfalls das investierte Kapital oder Teile hiervon für unbestimmte Zeit nicht zur Verfügung stehen. Durch eine beeinträchtigte Liquidität von Vermögensgegenständen könnten zudem der Nettoinventarwert des Fonds und damit der Anteilwert sinken. Bei dem Sondervermögen manifestierten sich im Berichtszeitraum keine wesentlichen Liquiditätsrisiken.

Unter operationellen Risiken versteht man die Gefahr von unmittelbaren und mittelbaren Verlusten, die infolge der Unangemessenheit oder des Versagens von internen Verfahren, Menschen und Systemen oder von externen Ereignissen eintreten. Zur Bewertung und Vermeidung operationeller Risiken führt die Gesellschaft detaillierte Risikoüberprüfungen durch. Operationelle Risiken haben sich im Berichtszeitraum nicht verwirklicht.

Der Jahresbericht muss zusätzliche, während des abgelaufenen Geschäftsjahres eingetretene wesentliche Änderungen der im Verkaufsprospekt aufgeführten Informationen enthalten. Im Berichtszeitraum gab es keine wesentlichen Änderungen im Sinne der im Artikel 105 Abs. 1c) der Verordnung (EU) Nr. 231/2013 in Verbindung mit Artikel 23 der Richtlinie 2011/61/EU genannten Informationen.

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

PAI-Berücksichtigung

Bei den Anlageentscheidungen dieses Finanzproduktes in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (nachfolgend auch Principal Adverse Impacts oder PAI) berücksichtigt. PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-) Tätigkeiten von Unternehmen und Staaten in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Dazu wurden auch systematische Verfahrensweisen zur Messung und Bewertung, sowie Maßnahmen zum Umgang mit den PAI in den Investitionsprozessen angewendet. Diese beinhalteten einen Steuerungsmechanismus, der bei schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen keine Investition in Emittenten erlaubte, sofern dazu aussagekräftige Daten herangezogen werden konnten. Bei weniger schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen konnten Investitionen nur begründet erfolgen. Im Ergebnis investierte der Fonds seit dem 01.01.2023 keine Anlagen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Unternehmen und Staaten mit schwerwiegenden negativen

Wertentwicklung im Berichtszeitraum WertpapierStrategiePortfolio A

Index: 30.09.2022 = 100



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

Nachhaltigkeitsauswirkungen. Es wurde somit nicht in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Unternehmen investiert, die an der Herstellung oder dem Verkauf von kontroversen Waffen beteiligt waren, denen Menschenrechtsverletzungen vorgeworfen wurden oder die einen Schwellenwert bei ihrer Treibhausgasemissionsintensität oder Energieverbrauchsintensität überschritten haben. Darüber hinaus wurde seit dem 01.01.2023 auch nicht in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Staaten investiert, deren Treibhausgasemissionsintensität einen Schwellenwert überschritten hat. Bei Unternehmen und Staaten mit weniger schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen erfolgte bei den zuvor genannten Indikatoren seit dem 01.10.2022 eine Investition nur in begründeten Fällen. Zudem erfolgten nur begründete Investitionen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Staaten, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen haben und nur begründete Investitionen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen haben. Zielfonds, bei denen festgelegte Schwellenwerte für bestimmte PAI überstritten wurden, konnten seit dem 01.12.2022 nicht mehr für das Sondervermögen erworben werden, vorausgesetzt einer ausreichenden Datenverfügbarkeit bei den PAI-Indikatoren. Bereits vor dem 01.12.2022 gehaltene Zielfonds, bei denen die festgelegten Schwellenwerte überschritten wurden, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger bis zum 31.12.2022 veräußert.

Durch das systematische, abgestufte Vorgehen wurden die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen, die mit den Investitionen des Fonds verbunden waren, begrenzt. Die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen von Unternehmen wurden auch im Rahmen der Mitwirkungspolitik der Verwaltungsgesellschaft

WertpapierstrategiePortfolio A

berücksichtigt mit der Absicht auf eine Reduzierung der PAI der Emittenten im Anlageuniversum hinzuwirken. Die Ergebnisse der Mitwirkungspolitik sind im aktuellen Engagement-Bericht zu finden <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.

WertpapierstrategiePortfolio A

Vermögensübersicht zum 30. September 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	134.759.773,52	33,24
Australien	300.530,49	0,07
Belgien	2.580.790,46	0,62
Bermuda	479.688,88	0,12
China	1.261.477,50	0,31
Curaçao	186.031,60	0,05
Dänemark	1.105.282,26	0,28
Deutschland	11.530.044,24	2,83
Finnland	333.175,26	0,08
Frankreich	3.309.483,83	0,82
Großbritannien	11.482.382,24	2,83
Indonesien	497.820,75	0,12
Irland	4.005.153,64	0,99
Israel	327.692,54	0,08
Italien	1.486.690,74	0,36
Japan	10.269.575,82	2,53
Kaiman-Inseln	145.387,77	0,03
Kanada	3.439.360,57	0,86
Liberia	172.694,43	0,04
Luxemburg	443.439,42	0,11
Niederlande	6.012.181,17	1,50
Norwegen	2.557.033,36	0,64
Portugal	153.951,60	0,04
Schweden	7.201.127,99	1,77
Schweiz	4.027.217,60	1,00
Singapur	135.962,34	0,03
Spanien	503.566,45	0,13
USA	60.812.030,57	15,00
2. Investmentanteile	262.964.404,99	64,64
Deutschland	81.120.621,34	19,93
Irland	59.000.254,02	14,51
Luxemburg	122.843.529,63	30,20
3. Sonstige Wertpapiere	0,48	0,00
Kanada	0,48	0,00
4. Derivate	0,01	0,00
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	3.286.620,96	0,78
6. Sonstige Vermögensgegenstände	5.788.926,11	1,42
II. Verbindlichkeiten	-328.549,01	-0,08
III. Fondsvermögen	406.471.177,06	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	134.759.773,52	33,24
AUD	300.530,49	0,07
CAD	3.439.360,57	0,86
CHF	1.074.132,12	0,27
DKK	1.520.240,18	0,38
EUR	27.373.509,60	6,74
GBP	11.328.107,52	2,79
HKD	1.355.114,61	0,33
IDR	497.820,75	0,12
ILS	327.692,54	0,08
JPY	10.269.575,82	2,53
NOK	2.557.033,36	0,64
SEK	7.164.222,09	1,76
SGD	135.962,34	0,03
USD	67.416.471,53	16,64
2. Investmentanteile	262.964.404,99	64,64
EUR	262.964.404,99	64,64
3. Sonstige Wertpapiere	0,48	0,00
CAD	0,48	0,00
4. Derivate	0,01	0,00
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	3.286.620,96	0,78
6. Sonstige Vermögensgegenstände	5.788.926,11	1,42
II. Verbindlichkeiten	-328.549,01	-0,08
III. Fondsvermögen	406.471.177,06	100,00

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

WertpapierstrategiePortfolio A

Vermögensaufstellung zum 30. September 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								132.301.875,81	32,65
Aktien								132.301.875,33	32,65
EUR								26.074.169,92	6,43
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V. Cert.v.Aand.op Naam	STK		33.134	33.134	0	EUR 13,370	443.001,58	0,11
BE0003755692	Agfa-Gevaert N.V. Actions au Porteur	STK		687.213	417.213	0	EUR 1,860	1.278.216,18	0,31
FR0004125920	Amundi S.A. Actions au Porteur	STK		5.401	5.401	0	EUR 53,350	288.143,35	0,07
LU0569974404	Aperam S.A. Actions Nom.	STK		8.850	8.850	0	EUR 27,790	245.941,50	0,06
NL0000334118	ASM International N.V. Reg.Shares	STK		192	192	0	EUR 402,750	77.328,00	0,02
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		657	70	27	EUR 563,100	369.956,70	0,09
IT0003188064	Banca IFIS S.p.A. Azioni nom	STK		30.323	30.323	0	EUR 16,380	496.690,74	0,12
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		26.273	26.273	0	EUR 7,724	202.932,65	0,05
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien	STK		4.961	4.961	0	EUR 97,160	482.010,76	0,12
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien	STK		7.775	7.775	0	EUR 89,700	697.417,50	0,17
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK		3.464	0	0	EUR 60,500	209.572,00	0,05
FR0000039299	Bolloré SE Actions Port.	STK		15.220	15.220	0	EUR 5,150	78.383,00	0,02
NL0010776944	Brunel International N.V. Aandelen an toonder	STK		135.000	30.000	75.000	EUR 12,900	1.741.500,00	0,43
ES0140609019	Caixabank S.A. Acciones Port.	STK		26.865	26.865	0	EUR 3,810	102.355,65	0,03
NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam	STK		7.387	7.387	0	EUR 11,695	86.390,97	0,02
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur	STK		2.134	2.134	0	EUR 57,300	122.278,20	0,03
FR0000045072	Crédit Agricole S.A. Actions Port.	STK		40.935	48.760	7.825	EUR 11,676	477.957,06	0,12
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG Namens-Aktien	STK		3.627	3.627	0	EUR 33,270	120.670,29	0,03
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		11.261	0	0	EUR 20,010	225.332,61	0,06
BE0974259880	D'leteren Group S.A. Parts Sociales au Port.	STK		528	0	0	EUR 160,500	84.744,00	0,02
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		15.271	15.271	0	EUR 11,250	171.798,75	0,04
CH0303692047	EDAG Engineering Group AG Inhaber-Aktien	STK		240.000	20.000	0	EUR 11,450	2.748.000,00	0,68
NL0011585146	Ferrari N.V. Aandelen op naam	STK		530	530	0	EUR 282,800	149.884,00	0,04
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC Reg.Shares	STK		659	659	0	EUR 155,950	102.771,05	0,03
DE0006047004	Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien	STK		5.168	5.168	0	EUR 75,000	387.600,00	0,10
DE000A161408	HelloFresh SE Inhaber-Aktien	STK		65.000	45.000	25.000	EUR 28,430	1.847.950,00	0,45
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur	STK		108	0	0	EUR 1.745,800	188.546,40	0,05
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK		5.609	5.609	0	EUR 35,350	198.278,15	0,05
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam	STK		9.201	9.201	0	EUR 12,550	115.472,55	0,03
PJTJMT0AE0001	Jerónimo Martins SGPS, S.A. Aççoes Nominativas	STK		7.194	0	19.555	EUR 21,400	153.951,60	0,04
BE0003565737	KBC Groep N.V. Parts Sociales au Port.	STK		2.389	2.389	0	EUR 59,360	141.811,04	0,03
DE0007193500	Koenig & Bauer AG Inhaber-Aktien	STK		168.301	40.000	0	EUR 14,040	2.362.946,04	0,58
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		1.041	1.057	16	EUR 397,700	414.005,70	0,10
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Action Port.(C.R.)	STK		424	150	249	EUR 724,800	307.315,20	0,08
DE000A2DA588	MAX Automation SE Namens-Aktien	STK		580.000	40.000	0	EUR 5,740	3.329.200,00	0,82
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK		10.943	5.212	0	EUR 66,030	722.566,29	0,18
NL0015000N09	MFE-MediaForEurope N.V. Aandelen B op naam	STK		388.769	388.769	0	EUR 0,600	233.261,40	0,06
BE0974276082	Ontex Group N.V. Actions Nom.	STK		155.046	155.046	0	EUR 6,940	1.076.019,24	0,26
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		1.369	1.369	0	EUR 71,880	98.403,72	0,02
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port.	STK		2.020	269	85	EUR 157,960	319.079,20	0,08
IT0004729759	Sesa S.p.A. Azioni nom.	STK		10.000	10.000	0	EUR 99,000	990.000,00	0,24
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK		1.854	1.854	0	EUR 136,620	253.293,48	0,06
NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen op naam	STK		32.784	32.784	0	EUR 18,240	597.980,16	0,15
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder	STK		3.637	0	0	EUR 41,170	149.735,29	0,04
LU0156801721	Tenaris S.A. Actions nom.	STK		13.088	0	22.611	EUR 15,090	197.497,92	0,05
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		1.560	1.560	0	EUR 115,500	180.180,00	0,04
FR0011981968	Worldline S.A. Actions Port.	STK		30.000	6.000	24.500	EUR 26,860	805.800,00	0,20
AUD								300.530,49	0,07
AU000000FMG4	Fortescue Metals Group Ltd. Reg.Shares	STK		5.718	0	4.010	AUD 20,920	73.064,11	0,02
AU000000MIN4	Mineral Resources Ltd. Reg.Shares	STK		1.246	0	0	AUD 67,630	51.470,18	0,01
AU000000S320	South32 Ltd. Reg.Shares	STK		37.931	0	0	AUD 3,390	78.540,25	0,02
AU00000219529	The Lottery Corporation Ltd. Reg.Shares	STK		33.804	33.804	0	AUD 4,720	97.455,95	0,02
CAD								3.439.360,57	0,86
CA13321L1085	Cameco Corp. Reg.Shares	STK		4.035	0	1.286	CAD 55,520	157.074,79	0,04
CA17039A1066	Choice Properties Reit Reg.Trust Units	STK		12.816	12.816	0	CAD 12,720	114.301,80	0,03
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK		135	0	0	CAD 2.794,160	264.483,46	0,07
CA25675T1075	Dollarama Inc. Reg.Shares	STK		2.564	0	6.833	CAD 94,430	169.762,39	0,04
CA9611485090	George Weston Ltd. Reg.Shares	STK		1.978	0	0	CAD 151,960	210.750,71	0,05
CA39138C1068	Great-West Lifeco Inc. Reg.Shares	STK		7.708	7.708	0	CAD 39,300	212.396,68	0,05
CA4488112083	Hydro One Ltd. Reg.Shares	STK		2.507	2.507	0	CAD 34,750	61.083,32	0,02
CA46579R1047	Ivanhoe Mines Ltd. Reg.Shares Cl.A	STK		6.471	0	0	CAD 11,400	51.723,72	0,01
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares	STK		2.869	0	0	CAD 115,280	231.898,53	0,06
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK		27.524	27.524	0	CAD 24,940	481.306,22	0,12
CA6330671034	National Bank of Canada Reg.Shares	STK		2.405	2.405	0	CAD 90,880	153.248,73	0,04
CA69946Q1046	Parex Resources Inc. Reg.Shares	STK		19.331	19.331	0	CAD 25,350	343.594,15	0,08

WertpapierstrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CA74167K1093	Primaris REIT Reg.Units S.A		STK	45.342	45.342	0	CAD 13,570	431.413,77	0,11
CA8787422044	Teck Resources Ltd. Reg.Shares (Sub. Vtg) CLB		STK	3.873	0	0	CAD 57,330	155.683,62	0,04
CA87241L1094	TFI International Inc. Reg.Shares		STK	660	0	0	CAD 174,620	80.807,45	0,02
CA8849038085	Thomson Reuters Corp. Reg.Shares		STK	1.416	1.416	0	CAD 166,760	165.565,03	0,04
CA92938W2022	WSP Global Inc. Reg.Shares		STK	1.147	0	3.257	CAD 191,820	154.266,20	0,04
CHF								1.074.132,12	0,27
CH0012221716	ABB Ltd. Namens-Aktien		STK	3.667	3.667	0	CHF 33,070	125.690,10	0,03
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien		STK	907	907	3.687	CHF 113,550	106.745,70	0,03
CH0025238863	Kuehne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien		STK	579	579	0	CHF 262,700	157.650,22	0,04
CH1175448666	Straumann Holding AG Namens-Aktien		STK	553	553	0	CHF 118,500	67.920,27	0,02
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien		STK	503	503	271	CHF 546,200	284.757,80	0,07
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien		STK	10.355	0	0	CHF 22,790	244.596,58	0,06
CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien		STK	254	0	0	CHF 329,600	86.771,45	0,02
DKK								1.520.240,18	0,38
DK0010244425	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier A		STK	290	507	217	DKK 12.680,000	493.130,48	0,12
DK0010274414	Danske Bank AS Navne-Aktier		STK	3.351	3.351	0	DKK 165,000	74.148,60	0,02
DK0060079531	DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier		STK	391	391	0	DKK 1.332,000	69.843,43	0,02
DK0062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B		STK	5.342	5.342	0	DKK 653,500	468.159,75	0,12
GB00BZ3CNK81	TORM PLC Reg.Shares A		STK	15.707	15.707	0	DKK 197,000	414.957,92	0,10
GBP								10.169.549,01	2,51
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares		STK	11.756	11.756	0	GBP 20,700	280.870,72	0,07
GB0000456144	Antofagasta PLC Reg.Shares		STK	2.973	8.629	9.795	GBP 14,485	49.703,85	0,01
GB0000536739	Ashtead Group PLC Reg.Shares		STK	1.888	219	0	GBP 50,680	110.437,14	0,03
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares		STK	2.070	767	0	GBP 112,060	267.730,29	0,07
GB0002634946	BAE Systems PLC Reg.Shares		STK	23.537	0	0	GBP 10,160	276.007,80	0,07
GB00BF4HYT85	Bank of Georgia Group PLC Reg.Shares		STK	10.449	10.449	0	GBP 36,750	443.209,05	0,11
GB0007980591	BP PLC Reg.Shares		STK	10.967	10.967	0	GBP 5,388	68.201,20	0,02
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC Reg.Shares		STK	808	0	3.581	GBP 138,050	128.743,20	0,03
GB00BYZN9041	Future PLC Reg.Shares		STK	165.000	165.000	0	GBP 8,640	1.645.410,37	0,40
GB00BMX86B70	Haleon PLC Reg.Shares		STK	63.014	63.014	0	GBP 3,404	247.572,93	0,06
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Reg.Shares		STK	129.236	129.236	0	GBP 6,476	965.977,24	0,24
GB00B019KW72	J. Sainsbury PLC Reg.Shs		STK	45.000	45.000	0	GBP 2,537	131.767,87	0,03
GB0005630420	Mears Group PLC Reg.Shares		STK	865.000	100.000	285.000	GBP 2,755	2.750.516,50	0,68
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC Reg.Shares		STK	56.592	56.592	0	GBP 2,355	153.823,43	0,04
NL0012650360	RHI Magnesita N.V. Aandelen op naam		STK	30.686	30.686	0	GBP 28,280	1.001.604,41	0,25
GB00BP6MXD84	Shell PLC Reg.Shares Cl.		STK	20.385	20.385	0	GBP 26,525	624.083,44	0,15
JE00BMDZN391	TP ICAP Group PLC Reg.Shares		STK	234.668	234.668	0	GBP 1,695	459.092,42	0,11
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC Reg.Shares		STK	634.032	634.032	0	GBP 0,772	564.797,15	0,14
HKD								1.355.114,61	0,33
CNE100000205	Bank of Communications Co.Ltd. Reg.Shares H		STK	599.000	599.000	0	HKD 4,740	341.898,27	0,08
CNE1000002H1	China Construction Bank Corp. Reg.Shares H		STK	577.000	577.000	0	HKD 4,420	307.107,08	0,08
CNE1000003G1	Industr. & Commerc.Bk of China Reg.Shares H		STK	592.162	0	0	HKD 3,770	268.827,46	0,07
CNE100001MK7	People's Ins.Co.(Gr.) o.Ch.Ltd Reg.Shares H		STK	1.015.574	1.015.574	0	HKD 2,810	343.644,69	0,08
KYG7800X1079	Sands China Ltd. Reg.Shs Reg.S		STK	32.400	69.600	37.200	HKD 24,000	93.637,11	0,02
IDR								497.820,75	0,12
ID1000058407	United Tractors PT Reg.Shares		STK	288.226	361.700	73.474	IDR 28.325,000	497.820,75	0,12
ILS								327.692,54	0,08
IL0006912120	Israel Discount Bank Ltd. Reg.Shares CIA		STK	27.655	0	0	ILS 20,590	140.390,40	0,03
IL0006954379	Mizrahi Tefahot Bank Ltd. Reg.Shares		STK	5.501	0	0	ILS 138,100	187.302,14	0,05
JPY								10.269.575,82	2,53
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc. Reg.Shares		STK	8.100	0	0	JPY 5.764,000	295.870,72	0,07
JP3526600006	Chubu Electric Power Co. Inc. Reg.Shares		STK	40.900	49.600	8.700	JPY 1.907,000	494.273,13	0,12
JP3305990008	Concordia Financial Group Ltd. Reg.Shares		STK	16.400	16.400	0	JPY 681,500	70.827,63	0,02
JP3476480003	Dai-ichi Life Holdings Inc. Reg.Shares		STK	5.600	0	0	JPY 3.097,000	109.906,21	0,03
JP3551500006	Denso Corp. Reg.Shares		STK	8.400	6.300	0	JPY 2.401,000	127.809,89	0,03
JP3802300008	Fast Retailing Co. Ltd. Reg.Shares		STK	300	300	0	JPY 32.590,000	61.958,17	0,02
JP3788600009	Hitachi Ltd. Reg.Shares		STK	3.200	3.200	0	JPY 9.275,000	188.086,19	0,05
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Reg.Shares		STK	44.400	44.400	0	JPY 1.682,000	473.262,36	0,12
JP3148800000	Ibiden Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.500	0	0	JPY 7.964,000	75.703,42	0,02
JP3294460005	Inpex Corp. Reg.Shares		STK	48.900	21.800	17.500	JPY 2.256,000	699.102,66	0,17
JP3421100003	Japan Petroleum Exploration Co Reg.Shares		STK	15.100	15.100	0	JPY 5.630,000	538.738,91	0,13
JP3946750001	Japan Post Bank Co.Ltd Reg.Shares		STK	48.300	48.300	0	JPY 1.301,000	398.214,83	0,10
JP3726800000	Japan Tobacco Inc. Reg.Shares		STK	24.600	24.600	0	JPY 3.440,000	536.273,76	0,13
JP3386030005	JFE Holdings Inc. Reg.Shares		STK	33.200	48.000	14.800	JPY 2.191,000	460.970,85	0,11
JP3877600001	Marubeni Corp. Reg.Shares		STK	13.100	13.100	0	JPY 2.332,000	193.594,42	0,05
JP3898400001	Mitsubishi Corp. Reg.Shares		STK	9.869	0	1.931	JPY 7.128,000	445.793,61	0,11
JP3902900004	Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Reg.Shares		STK	35.200	0	49.400	JPY 1.268,500	282.960,71	0,07
JP3893600001	Mitsui & Co. Ltd. Reg.Shares		STK	9.100	1.900	0	JPY 5.423,000	312.733,21	0,08
JP3362700001	Mitsui O.S.K. Lines Ltd. Reg.Shares		STK	4.200	2.000	0	JPY 4.110,000	109.391,63	0,03
JP3885780001	Mizuho Financial Group Inc. Reg.Shares		STK	12.600	12.600	0	JPY 2.541,000	202.893,54	0,05
JP3890310000	MS&AD Insurance Grp Hldgs Inc. Reg.Shares		STK	1.800	1.800	0	JPY 5.495,000	62.680,61	0,02
JP3381000003	Nippon Steel Corp. Reg.Shares		STK	22.700	27.900	5.200	JPY 3.505,000	504.204,69	0,12
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares		STK	452.500	781.300	355.000	JPY 176,600	506.410,01	0,12
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Reg.Shares		STK	25.200	24.800	5.900	JPY 3.886,000	620.577,95	0,15

WertpapierstrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares		STK	2.700	2.700	9.800	JPY 2.793,000	47.788,97	0,01
JP3164720009	Renesas Electronics Corp. Reg.Shares		STK	7.400	0	0	JPY 2.285,500	107.178,07	0,03
JP3500610005	Resona Holdings Inc. Reg.Shares		STK	15.500	15.500	0	JPY 828,300	81.360,27	0,02
JP3422950000	Seven & I Holdings Co. Ltd. Reg.Shares		STK	5.300	5.300	0	JPY 5.855,000	196.650,82	0,05
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares		STK	6.000	4.800	300	JPY 4.343,000	165.133,08	0,04
JP3351500008	Shizuoka Financial Group Inc. Reg.Shares		STK	13.500	13.500	0	JPY 1.219,000	104.287,07	0,03
JP3663900003	Sojitz Corp. Reg.Shares		STK	10.600	10.600	0	JPY 3.278,000	220.195,18	0,05
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.500	2.500	9.100	JPY 6.433,000	101.916,98	0,03
JP3435000009	Sony Group Corp. Reg.Shares		STK	2.700	0	0	JPY 12.240,000	209.429,66	0,05
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group Reg.Shares		STK	4.800	4.800	0	JPY 7.347,000	223.482,89	0,05
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Hldg.Inc Reg.Shares		STK	1.500	1.500	0	JPY 5.631,000	53.526,62	0,01
JP3539220008	T & D Holdings Inc. Reg.Shares		STK	4.700	4.700	0	JPY 2.468,000	73.508,24	0,02
JP3511800009	The Chiba Bank Ltd. Reg.Shares		STK	11.900	11.900	0	JPY 1.087,500	82.010,46	0,02
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares		STK	10.100	5.600	8.700	JPY 3.465,000	221.777,57	0,05
JP3571400005	Tokyo Electron Ltd. Reg.Shares		STK	1.200	800	0	JPY 20.440,000	155.437,26	0,04
JP3931600005	Yakult Honsha Co. Ltd. Reg.Shares		STK	4.000	4.000	0	JPY 3.633,000	92.091,25	0,02
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares		STK	14.514	0	0	JPY 3.931,000	361.562,32	0,09
NOK								2.557.033,36	0,64
NO0004822503	Atea ASA Navne-Aksjer		STK	78.560	20.000	35.000	NOK 132,200	921.823,48	0,23
NO0010360266	Bouvet ASA Navne-Aksjer		STK	144.917	0	119.924	NOK 56,100	721.600,84	0,18
NO0010096985	Equinor ASA Navne-Aksjer		STK	5.922	1.994	0	NOK 355,200	186.705,11	0,05
NO0011082075	Hoeegh Autoliners ASA Navne-Aksjer		STK	91.389	91.389	0	NOK 78,950	640.414,11	0,16
NO0005052605	Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer		STK	14.596	0	0	NOK 66,760	86.489,82	0,02
SEK								7.164.222,09	1,76
SE0007897079	AcadeMedia AB Namn-Aktier		STK	600.000	199.122	0	SEK 47,120	2.460.071,26	0,61
SE0017486897	Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria)		STK	18.620	18.620	0	SEK 128,150	207.629,68	0,05
SE0016828511	Embracer Group AB Namn-Aktier AK CLB		STK	848.949	698.949	0	SEK 21,605	1.595.978,47	0,39
SE0015658109	Epiroc AB Namn-Aktier A		STK	4.899	0	21.498	SEK 208,500	88.880,12	0,02
SE0012673267	Evolution AB (publ) Namn-Aktier		STK	1.209	0	0	SEK 110,800	115.909,82	0,03
SE0000421273	Knowit AB Namn-Aktier		STK	115.509	55.890	0	SEK 128,600	1.292.551,78	0,32
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares		STK	31.972	33.324	1.352	SEK 119,760	333.175,26	0,08
SE0015346135	Stillfront Group AB Namn-Aktier		STK	765.698	350.000	9.629	SEK 16,060	1.070.025,70	0,26
SGD								135.962,34	0,03
SG1V61937297	Singapore Airlines Ltd. Reg.Shares		STK	30.400	30.400	0	SGD 6,460	135.962,34	0,03
USD								67.416.471,53	16,64
US90214J1016	2U Inc. Reg.Shares		STK	179.882	50.000	0	USD 2,300	390.052,42	0,10
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	7.252	1.829	723	USD 152,250	1.040.932,40	0,26
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares CLA		STK	739	0	2.351	USD 300,770	209.549,38	0,05
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc. Reg.Shares		STK	2.022	2.022	2.121	USD 102,760	195.890,19	0,05
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares		STK	4.729	4.729	0	USD 77,670	346.282,11	0,09
US0090661010	Airbnb Inc. Reg.Shares		STK	537	537	718	USD 136,470	69.090,59	0,02
US0126531013	Albemarle Corp. Reg.Shares		STK	318	44	0	USD 172,400	51.685,87	0,01
US0162551016	Align Technology Inc. Reg.Shares		STK	198	198	0	USD 307,510	57.402,64	0,01
US01973R1014	Allison Transmission Hldg.Inc. Reg.Shares		STK	7.317	0	2.238	USD 59,990	413.827,50	0,10
US02005N1000	Ally Financial Inc. Reg.Shares		STK	17.461	20.549	3.088	USD 26,630	438.376,95	0,11
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk CLC		STK	9.328	4.382	8.614	USD 133,130	1.170.770,85	0,29
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares CLA		STK	5.229	5.267	8.238	USD 132,310	652.256,99	0,16
US0220951033	Altria Group Inc. Reg.Shares		STK	13.300	13.300	0	USD 42,140	528.388,80	0,13
US03076C1062	Ameriprise Financial Inc. Reg.Shares		STK	770	0	0	USD 330,350	239.812,86	0,06
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	1.626	1.626	627	USD 270,820	415.153,50	0,10
US0326541051	Analog Devices Inc. Reg.Shares		STK	1.185	1.185	0	USD 176,410	197.082,92	0,05
IE00BLPIHW54	AON PLC Reg.Shares A		STK	608	0	0	USD 329,380	188.802,72	0,05
US03769M1062	Apollo Global Management(New.) Reg.Shares		STK	6.500	6.500	0	USD 91,100	558.263,41	0,14
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	24.006	12.640	16.140	USD 170,690	3.863.094,32	0,95
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares		STK	2.068	0	0	USD 138,220	269.481,44	0,07
US03990B1017	Ares Management Corp. Reg.Shares CLA		STK	1.672	1.672	0	USD 104,890	165.339,95	0,04
US0404131064	Arista Networks Inc. Reg.Shares		STK	822	0	3.369	USD 184,430	142.925,86	0,04
US3635761097	Arthur J. Gallagher & Co. Reg.Shares		STK	2.060	536	177	USD 230,770	448.181,58	0,11
US0533321024	AutoZone Inc. Reg.Shares		STK	80	0	0	USD 2.559,480	193.040,82	0,05
US08265T2087	Bentley Systems Inc. Reg.Shares CLB		STK	2.867	2.867	0	USD 50,010	135.173,63	0,03
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New		STK	2.731	1.853	1.563	USD 357,060	919.327,67	0,23
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares		STK	6.600	6.600	0	USD 68,900	428.716,89	0,11
US09260D1072	Blackstone Inc. Reg.Shares		STK	1.027	0	3.257	USD 108,230	104.791,37	0,03
US09739D1000	Boise Cascade Co. Reg.Shares		STK	4.733	0	0	USD 106,050	473.210,76	0,12
US09857L1089	Booking Holdings Inc. Reg.Shares		STK	50	50	0	USD 3.104,830	146.357,59	0,04
US1011371077	Boston Scientific Corp. Reg.Shares		STK	4.397	4.397	0	USD 53,370	221.238,70	0,05
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares		STK	1.371	50	357	USD 832,000	1.075.395,49	0,26
US1152361010	Brown & Brown Inc. Reg.Shares		STK	2.949	0	0	USD 70,870	197.035,57	0,05
BMGI69621056	Bunge Ltd. Reg.Shares		STK	4.600	4.600	1.061	USD 110,610	479.688,88	0,12
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	954	0	0	USD 234,010	210.470,01	0,05
US14448C1045	Carrier Global Corp. Reg.Shares		STK	12.457	4.443	2.159	USD 55,940	656.966,70	0,16
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares		STK	1.071	1.071	0	USD 276,240	278.922,45	0,07
US12514G1085	CDW Corp. Reg.Shares		STK	1.822	0	499	USD 202,880	348.493,79	0,09
US03073E1055	Cencora Inc. Reg.Shares		STK	2.377	354	85	USD 182,860	409.784,31	0,10
US16411R2085	Cheniere Energy Inc. Reg.Shares		STK	958	0	0	USD 168,940	152.582,75	0,04
US1696561059	Chipotle Mexican Grill Inc. Reg.Shares		STK	67	0	0	USD 1.838,730	116.144,91	0,03
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	13.082	13.082	0	USD 53,880	664.521,69	0,16
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC Reg.Shares		STK	5.221	5.221	0	USD 62,815	309.189,33	0,08
US2172041061	Copart Inc. Reg.Shares		STK	3.663	3.663	0	USD 43,430	149.980,29	0,04

WertpapierstrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US22052L1044	Corteva Inc. Reg.Shares		STK	3.259	0	6.201	USD 50,910	156.420,94	0,04
US22160K1051	Costco Wholesale Corp. Reg.Shares		STK	788	78	188	USD 568,630	422.438,43	0,10
US23331A1097	D.R. Horton Inc. Reg.Shares		STK	4.300	4.300	0	USD 108,920	441.553,69	0,11
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares		STK	1.517	1.517	0	USD 143,100	204.659,85	0,05
US2441991054	Deere & Co. Reg.Shares		STK	982	80	157	USD 384,730	356.184,46	0,09
US24703L2025	Dell Technologies Inc. Reg.Shares C		STK	9.874	0	0	USD 68,500	637.662,86	0,16
US2521311074	DexCom Inc. Reg.Shares		STK	820	0	0	USD 95,460	73.797,68	0,02
US2533931026	Dick's Sporting Goods Inc. Reg.Shares		STK	489	489	0	USD 106,590	49.139,73	0,01
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares		STK	3.462	0	0	USD 86,330	281.770,96	0,07
US25659T1079	Dolby Laboratories Inc. Reg.Shares CIA		STK	2.557	4.517	1.960	USD 79,340	191.262,73	0,05
IE0003LFZ4U7	DOLE PLC Reg.Shares		STK	133.162	39.612	6.750	USD 11,680	1.466.326,16	0,36
US25809K1051	DoorDash Inc. Reg.Shares CIA		STK	860	860	0	USD 77,830	63.103,42	0,02
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares		STK	7.511	2.904	0	USD 50,930	360.644,13	0,09
IE0088KQN827	Eaton Corporation PLC Reg.Shares		STK	2.128	300	511	USD 215,530	432.401,09	0,11
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares		STK	1.075	654	821	USD 544,450	551.790,09	0,14
US29786A1060	Etsy Inc. Reg.Shares		STK	10.000	5.537	3.537	USD 63,750	601.018,20	0,15
US30034W1062	Evergy Inc. Reg.Shares		STK	9.779	6.677	0	USD 50,430	464.933,51	0,11
US30063P1057	Exact Sciences Corp. Reg.Shares		STK	917	917	0	USD 69,160	59.790,44	0,01
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares		STK	7.367	7.960	593	USD 119,470	829.768,54	0,20
US31428X1063	Fedex Corp. Reg.Shares		STK	753	753	0	USD 266,440	189.148,03	0,05
US31946M1036	First Citizens BancShares Inc. Reg.Shares Class A		STK	144	220	76	USD 1.370,600	186.071,84	0,05
US3453708600	Ford Motor Co. Reg.Shares		STK	7.627	2.044	0	USD 12,560	90.313,11	0,02
US34959E1091	Fortinet Inc. Reg.Shares		STK	2.414	0	6.915	USD 58,600	133.365,14	0,03
US34965K1079	Fortrea Holdings Inc. Reg.Shares		STK	18.700	18.700	0	USD 28,660	505.271,99	0,12
US35137L1052	Fox Corp. Reg.Shares A		STK	15.075	4.800	0	USD 31,140	442.571,42	0,11
US35137L2043	Fox Corp. Reg.Shares B		STK	15.879	4.800	0	USD 28,860	432.042,93	0,11
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	372	372	0	USD 346,420	121.493,58	0,03
US3724601055	Genuine Parts Co. Reg.Shares		STK	631	631	0	USD 143,260	85.223,97	0,02
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	7.432	10.538	3.106	USD 75,420	528.444,84	0,13
KYG4124C1096	Grab Holdings Limited Reg.Shares CIA		STK	15.819	15.819	0	USD 3,470	51.750,66	0,01
US4062161017	Halliburton Co. Reg.Shares		STK	4.207	4.207	0	USD 41,790	165.749,53	0,04
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	1.598	2.698	1.100	USD 250,650	377.617,33	0,09
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares		STK	29.984	10.368	4.965	USD 17,630	498.367,04	0,12
US4039491000	HF Sinclair Corp. Reg.Shares		STK	6.602	12.446	5.844	USD 58,630	364.924,35	0,09
US43300A2033	Hilton Worldwide Holdings Inc. Reg.Shares		STK	1.114	0	0	USD 153,670	161.391,89	0,04
IE00BQPQZ61	Horizon Therapeutics PLC Reg.Shares		STK	1.218	470	4.113	USD 115,690	132.846,63	0,03
US4435106079	Hubbell Inc. Reg.Shares		STK	591	591	889	USD 317,910	177.132,85	0,04
US45168D1046	IDEXX Laboratories Inc. Reg.Shares		STK	217	217	0	USD 436,980	89.398,19	0,02
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares		STK	4.036	4.036	0	USD 28,950	110.155,75	0,03
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares		STK	4.368	4.368	0	USD 141,580	583.031,43	0,14
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc. Reg.Shares		STK	474	474	0	USD 296,150	132.341,94	0,03
US46284V1017	Iron Mountain Inc. Reg.Shares		STK	3.498	3.498	0	USD 59,870	197.440,61	0,05
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	1.100	1.100	0	USD 156,880	162.692,56	0,04
IE00BY7QL619	Johnson Controls Internat. PLC Reg.Shares		STK	7.492	8.684	1.192	USD 53,190	375.694,81	0,09
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	2.300	2.300	0	USD 147,590	320.031,11	0,08
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc. Reg.Shares		STK	8.931	0	0	USD 31,460	264.890,41	0,07
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares		STK	1.917	1.150	2.008	USD 132,640	239.719,88	0,06
US48251W1045	KKR & Co. Inc. Common Shares		STK	1.480	0	0	USD 62,550	87.276,33	0,02
US4824801009	KLA Corp. Reg.Shares		STK	571	216	0	USD 458,090	246.600,73	0,06
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares		STK	378	0	0	USD 627,520	223.628,32	0,06
US5178341070	Las Vegas Sands Corp. Reg.Shares		STK	2.843	2.843	0	USD 45,550	122.087,91	0,03
US5218652049	Lear Corp. Reg.Shares		STK	2.949	2.949	0	USD 134,680	374.442,65	0,09
US5260571048	Lennar Corp. Reg.Shares CIA		STK	1.149	1.149	0	USD 114,200	123.706,80	0,03
US5312297550	Liberty Media Corp. Reg.Shares C Formula One		STK	1.885	1.885	0	USD 61,680	109.613,27	0,03
IE00059YS762	Linde plc Reg.Shares		STK	2.462	2.977	515	USD 373,490	866.910,89	0,21
US5018892084	LKQ Corp. Reg.Shares		STK	1.937	1.937	0	USD 49,540	90.467,60	0,02
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares		STK	3.951	2.591	0	USD 207,780	773.959,44	0,19
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A		STK	5.356	2.784	1.100	USD 94,540	477.379,32	0,12
US56585A1025	Marathon Petroleum Corp. Reg.Shares		STK	6.176	1.858	1.429	USD 154,430	899.179,49	0,22
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	2.825	841	170	USD 193,400	515.089,09	0,13
US5732841060	Martin Marietta Materials Inc. Reg.Shares		STK	392	392	0	USD 414,520	153.193,02	0,04
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares		STK	1.029	1.029	0	USD 265,590	257.652,60	0,06
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	907	0	38	USD 442,040	377.986,50	0,09
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	3.159	4.802	5.514	USD 104,300	310.628,55	0,08
US30303M1027	Meta Platforms Inc. Reg.Shares CIA		STK	2.031	2.248	217	USD 303,960	582.014,48	0,14
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	92	134	42	USD 1.118,240	96.990,74	0,02
US5529531015	MGM Resorts International Reg.Shares		STK	3.410	3.410	0	USD 36,640	117.792,40	0,03
US5950171042	Microchip Technology Inc. Reg.Shares		STK	1.207	1.207	0	USD 78,610	89.452,50	0,02
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	12.044	9.318	9.381	USD 313,640	3.561.308,72	0,88
US60871R2094	Molson Coors Beverage Co. Reg.Shares B		STK	11.920	6.307	0	USD 62,610	703.602,53	0,17
US6092071058	Mondelez International Inc. Reg.Shares CIA		STK	910	910	0	USD 69,390	59.531,35	0,01
US6098391054	Monolithic Power Systems Inc. Reg.Shares		STK	294	293	252	USD 451,920	125.261,13	0,03
US61174X1090	Monster Beverage Corp. (NEW) Reg.Shares		STK	2.982	2.982	0	USD 53,160	149.451,42	0,04
US6174464486	Morgan Stanley Reg.Shares		STK	4.304	1.901	0	USD 82,190	333.502,18	0,08
US6200763075	Motorola Solutions Inc. Reg.Shares		STK	1.346	1.346	0	USD 274,190	347.939,79	0,09
US64110D1046	NetApp Inc. Reg.Shares		STK	5.432	2.128	0	USD 76,250	390.487,41	0,10
US64110L1061	Netflix Inc. Reg.Shares		STK	630	630	0	USD 376,360	223.538,04	0,05
US6703461052	Nucor Corp. Reg.Shares		STK	3.482	373	0	USD 157,760	517.884,72	0,13

WertpapierstrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares		STK	2.600	731	1.412	USD 430,890	1.056.202,51	0,26
NL0009538784	NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder		STK	2.055	2.055	0	USD 200,530	388.506,79	0,10
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc. Reg.Shares		STK	469	0	0	USD 406,050	179.539,41	0,04
US6819191064	Omnicom Group Inc. Reg.Shares		STK	1.495	1.495	0	USD 74,050	104.369,52	0,03
US6821891057	ON Semiconductor Corp. Reg.Shares		STK	1.310	249	0	USD 94,050	116.154,90	0,03
US68389X1054	Oracle Corp. Reg.Shares		STK	2.951	2.951	0	USD 106,150	295.322,57	0,07
US67103H1077	O'Reilly Automotive Inc.[New] Reg.Shares		STK	317	0	0	USD 917,410	274.176,46	0,07
US68902V1070	Otis Worldwide Corp. Reg.Shares		STK	1.102	1.102	0	USD 80,470	83.603,22	0,02
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	3.389	3.389	0	USD 139,250	444.912,09	0,11
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares		STK	2.979	2.979	0	USD 85,710	240.718,48	0,06
US6974351057	Palo Alto Networks Inc. Reg.Shares		STK	552	0	0	USD 235,180	122.390,27	0,03
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc. Reg.Shares		STK	20.000	5.000	0	USD 58,180	1.097.011,41	0,27
US7185461040	Phillips 66 Reg.Shares		STK	4.715	6.144	6.068	USD 123,380	548.446,03	0,13
US7433151039	Progressive Corp. Reg.Shares		STK	1.989	672	1.628	USD 140,410	263.293,57	0,06
US7443201022	Prudential Financial Inc. Reg.Shares		STK	5.618	6.651	1.033	USD 94,860	502.426,21	0,12
US7445731067	Public Service Ent. Group Inc. Reg.Shares		STK	8.900	8.900	0	USD 56,660	475.416,23	0,12
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares		STK	6.820	6.820	0	USD 74,770	480.749,88	0,12
US7607591002	Republic Services Inc. Reg.Shares		STK	2.899	400	696	USD 144,980	396.244,95	0,10
LR000862868	Royal Caribbean Cruises Ltd. Reg.Shares		STK	1.946	1.946	0	USD 94,130	172.694,43	0,04
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC Reg.Ord.CIA Shares		STK	17.100	20.157	5.351	USD 26,780	431.731,88	0,11
AN8068571086	Schlumberger N.V. (Ltd.) Reg.Shares		STK	3.238	3.238	20.000	USD 60,940	186.031,60	0,05
US8318652091	Smith Corp., A.O. Reg.Shares		STK	8.766	2.463	0	USD 66,480	549.414,24	0,14
US858191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares		STK	943	0	0	USD 105,950	94.193,32	0,02
US8636671013	Stryker Corp. Reg.Shares		STK	1.456	1.456	0	USD 273,410	375.304,01	0,09
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares		STK	16.817	7.630	0	USD 30,870	489.432,25	0,12
US8716071076	Synopsys Inc. Reg.Shares		STK	529	0	0	USD 460,710	229.768,63	0,06
CH0102993182	TE Connectivity Ltd. Namens-Aktien		STK	1.757	1.757	0	USD 123,810	205.085,48	0,05
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares		STK	2.602	1.880	5.368	USD 246,380	604.394,04	0,15
US0640581007	The Bk of New York MellonCorp. Reg.Shares		STK	11.722	19.423	7.701	USD 42,680	471.664,90	0,12
US1255231003	The Cigna Group Reg.Shares		STK	1.761	380	770	USD 290,320	481.996,34	0,12
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares		STK	2.869	1.161	455	USD 201,840	545.940,38	0,13
US5007541064	The Kraft Heinz Co. Reg.Shares		STK	16.872	8.823	0	USD 33,750	536.843,59	0,13
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares		STK	9.410	2.000	2.254	USD 45,090	400.015,93	0,10
US61945C1036	The Mosaic Co. Reg.Shares		STK	2.560	10.237	16.305	USD 35,840	86.499,86	0,02
US88339J1051	The Trade Desk Inc. Reg.Shares A		STK	923	0	0	USD 77,690	67.604,29	0,02
US89417E1091	The Travelers Companies Inc. Reg.Shares		STK	1.882	0	455	USD 167,620	297.408,16	0,07
US9694571004	The Williams Cos.Inc. Reg.Shares		STK	8.194	0	0	USD 34,410	265.820,25	0,07
US8725401090	TJX Companies Inc. Reg.Shares		STK	3.290	3.290	0	USD 89,580	277.852,55	0,07
US8923561067	Tractor Supply Co. Reg.Shares		STK	834	300	0	USD 203,420	159.943,70	0,04
IE00BK9ZQ967	Trane Technologies PLC Reg.Shares		STK	1.194	1.194	0	USD 204,190	229.850,91	0,06
US90364P1057	UiPath Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	6.500	6.500	0	USD 16,770	102.767,04	0,03
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B		STK	1.369	0	0	USD 155,500	200.697,18	0,05
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares		STK	332	46	0	USD 448,220	140.293,24	0,03
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	1.401	811	2.558	USD 510,100	673.753,28	0,17
US91529Y1064	UNUM Group Reg.Shares		STK	10.200	10.200	0	USD 49,900	479.852,93	0,12
US91913Y1001	Valero Energy Corp. Reg.Shares		STK	3.639	1.964	0	USD 147,180	504.938,27	0,12
US9234541020	Veritiv Corp. Reg.Shares		STK	2.220	0	937	USD 168,840	353.374,94	0,09
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	13.247	21.059	7.812	USD 32,550	406.514,42	0,10
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	717	0	0	USD 352,500	238.278,97	0,06
US92556V1061	Viatrix Inc. Reg.Shares		STK	45.223	57.914	12.691	USD 9,810	418.249,86	0,10
US9256521090	Vici Properties Inc. Reg.Shares		STK	19.352	19.352	0	USD 29,470	537.667,05	0,13
US92645B1035	Victory Capital Holdings Inc. Reg.Shs Cl.A		STK	11.225	11.225	0	USD 33,860	358.327,99	0,09
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	397	0	0	USD 698,850	261.566,37	0,06
US9553061055	West Pharmaceutical.Services Inc Reg.Shares		STK	351	351	407	USD 379,080	125.442,71	0,03
US98421M1062	Xerox Holdings Corp. Reg.Shares		STK	32.900	32.900	0	USD 16,000	496.276,04	0,12
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	799	799	0	USD 124,080	93.466,50	0,02
Andere Wertpapiere								0,48	0,00
CAD								0,48	0,00
CA21037X1428	Constellation Software Inc. Anrechte		STK	135	135	0	CAD 0,005	0,48	0,00
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								2.457.898,19	0,59
Aktien								2.457.898,19	0,59
EUR								1.299.339,68	0,31
DE000A3CMGM5	APONTIS PHARMA AG Inhaber-Aktien		STK	94.524	94.524	0	EUR 4,490	424.412,76	0,10
DE000A0EQ578	HELMIA Eigenheimbau AG Inhaber-Aktien		STK	85.278	43.606	0	EUR 5,920	504.845,76	0,12
SE0018538068	MGI-Media and Games Invest SE Namn-Aktier Cl.A		STK	339.524	339.524	0	EUR 1,090	370.081,16	0,09
GBP								1.158.558,51	0,28
JE00BG6L7297	boohoo Group PLC Reg.Shares		STK	1.714.738	1.019.362	0	GBP 0,318	629.363,33	0,15
GB00B4T7HX10	Learning Technolog.Group PLC Reg.Shares		STK	700.000	700.000	0	GBP 0,655	529.195,18	0,13
Wertpapier-Investmentanteile								262.964.404,99	64,64
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								262.964.404,99	64,64
EUR								262.964.404,99	64,64
DE000A3C92E9	ACATIS AKTIEN GLOBAL FONDS E		ANT	56.400	1.100	0	EUR 973,280	54.892.992,00	13,49
IE00BNG8N985	BlackRock Fds I-Gl.Unconst.Eq.Reg.Shs D EUR Acc.		ANT	135.166	135.166	0	EUR 136,717	18.479.490,02	4,55

WertpapierstrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE000A3C5CP2	Finreon SGKB Carbon Focus D		ANT	140.000	140.000	0	EUR 101,470	14.205.800,00	3,49
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares		ANT	365.000	0	1.385.000	EUR 5,897	2.152.405,00	0,53
IE00BYX2JD69	iShsV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Reg.Shs Acc.		ANT	2.550.000	2.785.000	1.465.000	EUR 9,432	24.051.600,00	5,91
IE00B6R52036	iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Reg.Shares (Acc)		ANT	1.260.500	0	0	EUR 11,358	14.316.759,00	3,52
LU1129459035	LOYS - LOYS Aktien Europa I		ANT	4.701	0	0	EUR 816,480	3.838.272,48	0,94
LU0277768098	Loys - Loys Global S		ANT	4.000	4.389	389	EUR 1.070,560	4.282.240,00	1,05
DE000A0H08T8	LOYS Global MH A (t)		ANT	11.000	0	8.393	EUR 311,500	3.426.500,00	0,84
LU1891775857	Lupus alpha Fds-Micro Champio. C		ANT	31.525	0	31.525	EUR 137,790	4.343.829,75	1,07
LU0097890064	Nordea 1-Glob.Stab.Eq.Fd Actions Nom. Cl.BI		ANT	1.582.600	0	0	EUR 34,049	53.885.947,40	13,25
LU1521667375	Robeco BP GI Premium Equities Act.Nom. Cl.IB Dis.		ANT	438.000	8.000	0	EUR 128,980	56.493.240,00	13,89
DE000A2N6519	Value Intell.Gold Comp.Fds AMI S (a)		ANT	79.638	0	0	EUR 107,930	8.595.329,34	2,11
Summe Wertpapiervermögen								EUR 397.724.178,99	97,88
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere									
Optionsscheine								0,01	0,00
Optionsscheine auf Aktien								0,01	0,00
Constellation Soft. Inc. WTS (Foreign) 23/31.03.40		X	STK	135	135	0	CAD 0,000	0,01	0,00
Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere								EUR 0,01	0,00
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	2.895.667,20			% 100,000	2.895.667,20	0,72
EUR-Guthaben bei									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	46.025,63			% 100,000	46.025,63	0,01
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Landesbank Baden-Württemberg			DKK	211.131,61			% 100,000	28.313,78	0,01
Landesbank Baden-Württemberg			NOK	894.432,08			% 100,000	79.389,35	0,02
Landesbank Baden-Württemberg			SEK	318.719,97			% 100,000	27.733,22	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Landesbank Baden-Württemberg			AUD	37.074,99			% 100,000	22.645,36	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			CAD	14.113,84			% 100,000	9.895,98	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			CHF	20.597,12			% 100,000	21.348,26	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			GBP	47.258,14			% 100,000	54.544,78	0,01
Landesbank Baden-Württemberg			HKD	8.551,46			% 100,000	1.029,75	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			ILS	31.241,22			% 100,000	7.702,57	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			JPY	1.038.910,00			% 100,000	6.583,72	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			NZD	7.677,81			% 100,000	4.364,00	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			SGD	6.542,01			% 100,000	4.529,22	0,00
Landesbank Baden-Württemberg			USD	81.161,07			% 100,000	76.516,52	0,01
Landesbank Baden-Württemberg			ZAR	6.615,81			% 100,000	331,62	0,00
Summe Bankguthaben								EUR 3.286.620,96	0,78
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR 3.286.620,96	0,78
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenansprüche			EUR	215.258,48				215.258,48	0,05
Forderungen aus Wertpapiergeschäften			EUR	5.526.848,38				5.526.848,38	1,36
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	46.819,25				46.819,25	0,01
Summe Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 5.788.926,11	1,42
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften			EUR	-101.392,72				-101.392,72	-0,02
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-227.156,29				-227.156,29	-0,06
Summe Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -328.549,01	-0,08
Fondsvermögen								EUR 406.471.177,06	100,00
Umlaufende Anteile								STK 351.890,990	
Anteilwert								EUR 1.155,11	

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

WertpapierstrategiePortfolio A

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.09.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,86641	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45685	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,26640	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,49235	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,96482	= 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	19,95015	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06070	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,42622	= 1 Euro (EUR)
Israel, Schechel	(ILS)	4,05595	= 1 Euro (EUR)
Indonesien, Rupiah	(IDR)	16.399,48000	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,44440	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	157,80000	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,30440	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,63720	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,75935	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel Wertpapierhandel

X Nichtnotierte Wertpapiere

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
AUD				
AU0000030678	Coles Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	28.901
AU0000154833	Endeavour Group Ltd. Reg.Shares	STK	8.845	76.434
AU000000MQG1	Macquarie Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.795
AU000000RIO1	Rio Tinto Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.856
AU000000WTC3	WiseTech Global Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.459
AU0000224040	Woodside Energy Group Ltd Reg.Shares	STK	0	9.346
CAD				
CA0636711016	Bank of Montreal Reg.Shares	STK	0	3.695
CA11284V1058	Brookfield Renewable Corp. Reg.Shs Cl.A Sub.Vot.	STK	4.695	6.554
CA13646K1084	Canadian Pacifi.Kansas City Ltd. Reg.Shares	STK	3.148	3.148
CA13645T1003	Canadian Pacific Railway Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.608
CA55027C1068	Lumine Group Inc. Reg.Shs (Sub.Vtg.)	STK	405	405
CA67077M1086	Nutrien Ltd Reg.Shares	STK	0	5.601
CA71584R1055	Pet Valu Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	11.413
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK	0	7.162
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.024
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	628
CHF				
CH0126673539	DKSH Holding AG Nam.-Aktien	STK	0	3.305
DKK				
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK	0	149
EUR				
DE0005167902	3U Holding AG Inhaber-Aktien	STK	0	113.133
DE000A3CNK42	ABOUT YOU Holding SE Inhaber-Aktien	STK	0	44.475
ES0125220311	Acciona S.A. Acciones Port.	STK	462	462
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam	STK	0	34
IT0005218380	Banco BPM S.p.A. Azioni	STK	91.436	91.436
FR0014004L86	Dassault Aviation S.A. Actions Port.	STK	673	1.147
DE0005550636	Drägerwerk AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsakt.	STK	0	10.100
ES0127797019	EDP Renováveis S.A. Acciones Port.	STK	4.009	8.791
BE0003822393	Elia Group Actions au Port.	STK	0	1.086
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom.	STK	7.973	28.677
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E. Actions Port.	STK	0	941
IT0000072170	Fincoobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom.	STK	4.677	4.677
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien	STK	0	6.360
NL0010801007	IMCD N.V. Aandelen op naam	STK	0	754
NL0014332678	JDE Peet's N.V. Reg.Shares	STK	1.401	18.593
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	53.918
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX Actions Port. (Prom.)	STK	6.743	6.743
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK	0	2.954
FI0009013296	Neste Oyj Reg.Shs	STK	1.591	1.591
NL0010558797	OCI N.V. Reg.Shares	STK	4.384	4.384
NL0013654783	Prosus N.V. Reg.Shares	STK	1.904	1.904
DE0007030009	Rheinmetall AG Inhaber-Aktien	STK	0	323
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK	0	4.477
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port.	STK	0	191
DE000A2YN900	TeamViewer SE Inhaber-Aktien	STK	0	80.000
DE000A0XYGA7	technotrans SE Namens-Aktien	STK	0	57.072
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom.	STK	0	26.591
FR0000121329	THALES S.A. Actions Port.	STK	0	802
DE000A1YC996	The Social Chain AG Namens-Aktien	STK	0	22.239

WertpapierStrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
FR0000120271	TotalEnergies SE Actions au Porteur	STK	800	14.430
NL00150001Y2	Universal Music Group N.V. Aandelen op naam	STK	6.294	6.294
NL0000302636	Van Lanschot Kempen N.V. Aand. aan toonder	STK	0	15.162
AT0000746409	Verbund AG Inhaber-Aktien	STK	0	1.417
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK	3.748	3.748
DE0007664039	Volkswagen AG Vorzugsaktien	STK	2.206	2.206
GBP				
GB00BKDRYJ47	Airtel Africa PLC Reg.Shares (WI)	STK	0	182.928
GB00B1XZS820	Anglo American PLC Reg.Shares	STK	0	17.109
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC Reg.Shares	STK	0	46.206
GB0002374006	Diageo PLC Reg.Shares	STK	0	3.128
GB00BYW3C20	Forterra PLC Reg.Shares	STK	0	70.706
GB0004270301	Hill & Smith PLC Reg.Shares	STK	0	24.396
GB00BKFB1C65	M&G PLC Reg.Shares	STK	0	22.675
JE00BJDLW90	Man Group PLC Reg.Shares	STK	0	121.248
GB00BDR05C01	National Grid PLC Reg.Shares	STK	0	25.290
GB0006776081	Pearson PLC Reg.Shares	STK	1.687	7.102
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK	0	13.658
GB00BGDT3G23	Rightmove PLC Reg.Shares	STK	0	46.076
GB00BYZDVK82	Softcat PLC Reg.Shares	STK	0	20.122
GB00BL6C2002	Wickes Group PLC Reg.Shares	STK	0	86.950
JE00B8KF9B49	WPP PLC Reg.Shares	STK	0	30.019
HKD				
KYG1674K1013	Budweiser Brew. Co. Apac Ltd. Reg.Shares	STK	25.900	160.800
CNE1000003W8	PetroChina Co. Ltd. Reg.Shares H	STK	0	738.000
CNE1000029W3	Postal Savings Bank of China Reg.Shares	STK	0	467.578
KYG811511131	Shui on Land Ltd. Reg.Shares	STK	2.016.500	2.016.500
KYG8187G1055	SITC International Hldg.Co.Ltd Reg.Shs Reg.S	STK	0	32.000
HK0019000162	Swire Pacific Ltd. Reg.Shares Cl.A	STK	11.500	11.500
CNE100000Q43	The Agricult. Bk of China Reg.Shares H	STK	0	948.113
ILS				
IL0006046119	Bank Leumi Le-Israel B.M. Reg.Shares	STK	0	22.515
IL0002300114	Bezeq, Israel Telecomm. Corp. Reg.Shares	STK	117.522	117.522
IL0002810146	ICL Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.504
JPY				
JP3778630008	BANDAI NAMCO Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	1.700
JP3548770001	Dexerials Corp. Reg.Shares	STK	0	5.551
JP3160400002	Eisai Co. Ltd. Reg.Shares	STK	1.600	1.600
JP3752900005	Japan Post Holdings Co.Ltd Reg.Shares	STK	50.900	50.900
JP3385980002	JSR Corp. Reg.Shares	STK	0	4.800
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares	STK	0	6.800
JP3260800002	Kintetsu Group Holdings Co.Ltd Reg.Shares	STK	1.100	1.100
JP3291200008	Kobe Bussan Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.800
JP3289800009	Kobe Steel Ltd. Reg.Shares	STK	46.200	46.200
JP3283460008	Koei Tecmo Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	5.100	10.100
JP3868400007	Mazda Motor Corp. Reg.Shares	STK	48.200	48.200
JP3117700009	Mebuki Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	0	153.821
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	9.000
JP3658850007	Nishi-Nippon Finan.Hldg.Inc. Reg.Shares	STK	35.200	35.200
JP3675600005	Nissin Foods Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	600	600
JP3738600000	Niterra Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	20.175
JP3762800005	Nomura Research Institute Ltd. Reg.Shares	STK	0	3.300
JP3201200007	Olympus Corp. Reg.Shares	STK	0	5.000
JP3173540000	Open House Group Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.600
JP3198900007	Oriental Land Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	800
JP3402600005	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.900
JP3336560002	Suntory Beverage & Food Ltd. Reg.Shares	STK	0	9.400
JP3633400001	Toyota Motor Corp. Reg.Shares	STK	0	19.600
KRW				
KR7011070000	LG Innotek Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	424
KR7005930003	Samsung Electronics Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	6.733
KR7316140003	Woori Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	0	19.226
NOK				
NO0010310956	Salmar ASA Navne-Aksjer	STK	0	1.358
LU0075646355	Subsea 7 S.A. Reg.Shares	STK	0	55.000
NO0010571680	Wallenius Wilhelmsen ASA Navne-Aksjer	STK	78.757	78.757
NZD				
NZTELE0001S4	Spark New Zealand Ltd. Reg.Shares	STK	25.002	119.359
SEK				
SE0005127818	AB Sagax Namn-Aktier B	STK	0	2.298
SE0017486889	Atlas Copco AB Namn-Aktier A	STK	3.823	3.823
SE0020050417	Boliden AB Namn-Aktier	STK	2.344	2.344
SE0015658117	Epiroc AB Namn-Aktier B	STK	0	21.762
SE0015811955	Investor AB Namn-Aktier A (fria)	STK	0	13.687
SE0015988019	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B	STK	0	5.125
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB Namn-Aktier B (fria)	STK	0	9.891
SGD				
SGXE62145532	CapitalLand Investment Ltd Reg.Shares	STK	0	31.700
SG1L01001701	DBS Group Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	15.400
SG2D54973185	Sheng Siong Group Ltd Reg.Shares	STK	0	288.648
USD				
US00436Q1067	Accel Entertainment Inc. Reg.Shares A-1	STK	0	30.241

WertpapierStrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK	1.232	1.232
US0226711010	Amalgamated Financial Corp. Reg.Shs ClA	STK	0	11.285
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares	STK	6.488	10.430
JE00BJF3079	AMCOR PLC Reg.Shares	STK	26.667	47.375
US0304201033	American Water Works Co. Inc. Reg.Shares	STK	0	2.527
US0394831020	Archer Daniels Midland Co. Reg.Shares	STK	0	1.824
US29109X1063	Aspen Technology Inc. Reg.Shares	STK	681	681
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares	STK	58.737	58.737
US0476491081	Atkore Inc. Reg.Shares	STK	0	3.857
US0477263026	Atlanta Braves Holdings Inc. Reg.Sh.ClC	STK	55	55
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares	STK	3.768	3.768
US05722G1004	Baker Hughes Co. Reg.Shares ClA	STK	0	2.376
US0708301041	Bath & Body Works Inc. Reg.Shares	STK	1.522	1.522
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares	STK	670	670
US05550J1016	BJ's Wholesale Club Hldgs Inc. Reg.Shares	STK	0	4.989
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares	STK	17.518	21.550
US1423391002	Carlisle Cos. Inc. Reg.Shares	STK	509	509
US14575E1055	Cars.com Inc. Reg.Shares	STK	15.122	15.122
US8085131055	Charles Schwab Corp. Reg.Shares	STK	339	2.752
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.790
US1729674242	Citigroup Inc. Reg.Shares	STK	7.061	7.061
US2091151041	Consolidated Edison Inc. Reg.Shares	STK	0	610
US21037T1097	Constellation Energy Corp. Reg.Shares	STK	1.410	1.410
US22160N1090	CoStar Group Inc. Reg.Shares	STK	1.503	1.503
US2283681060	Crown Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	1.286
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares	STK	1.003	1.003
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares	STK	9.455	12.666
US2358511028	Danaher Corp. Reg.Shares	STK	0	1.389
US2372661015	Darling Ingredients Inc. Reg.Shares	STK	857	857
US2566771059	Dollar General Corp. (New) Reg.Shares	STK	0	2.269
US2567461080	Dollar Tree Inc. Reg.Shares	STK	0	564
US26441C2044	Duke Energy Corp. Reg.Shares New	STK	0	608
US26614N1028	DuPont de Nemours Inc. Reg.Shares	STK	1.247	1.247
US27627N1054	Eastern Bankshares Inc. Reg.Shares	STK	0	18.672
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares	STK	0	710
US29261A1007	Encompass Health Corp. Reg.Shares	STK	0	20.000
US29332G1022	Enhabit Inc. Reg.Shares	STK	0	10.000
US29355A1079	Enphase Energy Inc. Reg.Shares	STK	293	293
US29362U1043	Entegris Inc. Reg.Shares	STK	0	487
US29415F1049	Envista Holdings Corp. Reg.Shares	STK	0	9.029
US29414B1044	EPAM Systems Inc. Reg.Shares	STK	176	176
US30161N1019	Exelon Corp. Reg.Shares	STK	0	6.300
US30225T1025	Extra Space Storage Inc. Reg.Shs of Benef. Int.	STK	0	1.088
US3030751057	FactSet Research Systems Inc. Reg.Shares	STK	0	608
US319001044	Fastenal Co. Reg.Shares	STK	0	4.102
JE00BJVNS543	Ferguson PLC Reg.Shares	STK	1.408	1.408
US3167731005	Fifth Third Bancorp Reg.Shares	STK	0	4.270
US3390411052	FleetCor Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	1.518
US3024913036	FMC Corp. Reg.Shares	STK	0	1.616
US6687711084	Gen Digital Inc. Reg.Shares	STK	0	5.182
US3687361044	Generac Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	459
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares	STK	1.092	7.830
US3802371076	GoDaddy Inc. Reg.Shares ClA	STK	0	6.862
US4108671052	Hanover Insurance Group Inc. Reg.Shares	STK	0	2.437
US4131971040	Harmony Biosciences Hldgs Inc. Reg.Shares	STK	0	5.186
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares	STK	0	2.562
US4456581077	Hunt (J.B.) Transport Svcs Inc Reg.Shares	STK	0	549
US45867G1013	InterDigital Inc. (Pa.) Reg.Shares	STK	1.137	1.137
US8326964058	J.M. Smucker Co. Reg.Shares	STK	377	377
US4262811015	Jack Henry & Associates Inc. Reg.Shares	STK	0	279
US46817M1071	Jackson Financial Inc. Reg.Shares ClA	STK	17.690	17.690
US4990491049	Knight-Swift Transp. Hldgs Inc Reg.Shs ClA	STK	0	7.690
US49926D1090	Knowles Corp. Reg.Shares	STK	0	19.317
US52736R1023	Levi Strauss & Co. Reg.Shares ClA	STK	0	20.602
US5312297220	Liberty Media Corp. Reg.Shares C Live	STK	81	81
US5380341090	Live Nation Entertainment Inc. Reg.Shares	STK	0	625
US55024U1097	Lumentum Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	4.405
US55261F1049	M&T Bank Corp. Reg.Shares	STK	0	729
US5663241090	Marcus & Millichap Inc. Reg.Shares	STK	0	7.987
US5738741041	Marvell Technology Inc. Reg.Shares	STK	0	1.237
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A	STK	1.947	1.947
US5951121038	Micron Technology Inc. Reg.Shares	STK	0	6.326
US5977421057	Midland States Bancorp. Inc. Reg.Shares	STK	0	4.790
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	0	399
US60937P1066	MongoDB Inc. Reg.Shs ClA	STK	0	147
US55354G1004	MSCI Inc. Reg.Shares A	STK	0	325
US6311031081	Nasdaq Inc. Reg.Shares	STK	4.590	4.590
US6516391066	Newmont Corp. Reg.Shares	STK	0	4.184
US65339F1012	Nextera Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	4.208
US68404L2016	Option Care Health Inc. Reg.Shares	STK	0	11.973
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares	STK	0	3.155
US70959W1036	Penske Automotive Group Inc. Reg.Shares	STK	0	3.011

WertpapierStrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK	0	7.536
US6934311079	PJT Partners Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	4.639
US73278L1052	Pool Corp. Reg.Shares	STK	0	271
US74251V1026	Principal Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	6.172	6.172
US74340W1036	ProLogis Inc. Reg.Shares	STK	2.227	7.183
US74460D1090	Public Storage Reg.Shares	STK	0	869
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares	STK	0	1.714
US2197981051	QuidelOrtho Corp. Reg.Shares	STK	0	2.143
US7547301090	Raymond James Financial Inc. Reg.Shares	STK	0	1.303
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	0	251
US7591EP1005	Regions Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	7.576
US7595091023	Reliance Steel & Alumin. Co. Reg.Shares	STK	0	1.805
IE00BKVD2N49	Seagate Technolog.Holdings PLC Reg.Shares	STK	0	764
US81282V1008	SeaWorld Entertainment Inc. Reg.Shares	STK	0	5.305
US81762P1021	ServiceNow Inc. Reg.Shares	STK	0	316
US82968B1035	Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	61.378
US83417M1045	SolarEdge Technologies Inc. Reg.Shares	STK	83	298
US83601L1026	Sotera Health Company Reg.Shares	STK	0	17.554
US78467J1007	SS&C Technologies Holdings Reg.Shares	STK	0	5.858
US8552441094	Starbucks Corp. Reg.Shares	STK	3.101	3.101
IE00BFY8C754	Steris PLC Reg.Shares	STK	0	900
US87612E1064	Target Corp. Reg.Shares	STK	0	762
US8807701029	Teradyne Inc. Reg.Shares	STK	0	502
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK	2.557	2.557
US38141G1040	The Goldman Sachs Group Inc. Reg.Shares	STK	1.109	1.109
US4165151048	The Hartford Finl SvcsGrp Inc. Reg.Shares	STK	0	5.417
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares	STK	100	858
US8725901040	T-Mobile US Inc. Reg.Shares	STK	250	3.065
US8887871080	Toast Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	2.184	2.184
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	4.179
US90384S3031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares	STK	0	955
US9078181081	Union Pacific Corp. Reg.Shares	STK	0	1.395
US92214X1063	Varex Imaging Corp Reg.Shares	STK	0	9.011
US92511U1025	Verra Mobility Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	0	20.575
US9282541013	Virtu Financial Inc. Reg.Shares A	STK	0	12.387
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	3.335	3.335
US0844231029	W.R. Berkley Corp. Reg.Shares	STK	0	3.609
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc. Reg.Shares	STK	10.944	10.944
US9713781048	WillScot Mobile Mini Hldgs.Cor Reg.Shares	STK	0	10.192
US98311A1051	Wyndham Hotels & Resorts Inc. Reg.Shares	STK	0	4.989
US98419M1009	Xylem Inc. Reg.Shares	STK	1.544	1.544
US98978V1035	Zoetis Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	2.493
US98980G1022	Zscaler Inc. Reg.Shares	STK	277	543
ZAR				
ZAE000179420	Growthpoint Properties Ltd. Reg.Shares	STK	406.600	406.600
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES0627797907	EDP Renováveis S.A. Anrechte	STK	8.791	8.791
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
EUR				
IE00BJ5FQX74	Uniphar PLC Reg.Shares	STK	0	18.907
SEK				
SE0002480442	Zinzino AB Namn-Aktier B	STK	1.115	114.330
USD				
US78486Q1013	SVB Financial Group Reg.Shares	STK	0	116
BMG9078F1077	Triton International Ltd. Reg.Shs Cl.A	STK	0	4.729
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
CAD				
CA8849037095	Thomson Reuters Corp. Reg.Shares	STK	1.469	1.469
DKK				
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK	267	7.994
EUR				
FR0010242511	Electricité de France (E.D.F.) Actions au Porteur	STK	9.605	9.605
MT0000580101	MGI-Media and Games Invest SE Reg.Shares	STK	0	195.807
SEK				
SE0017768716	Boliden AB Namn-Aktier	STK	0	2.344
SE0020050425	Boliden AB Reg.Redemption Shares	STK	2.344	2.344
USD				
US2644115055	Duke Realty Corp. Reg.Shares	STK	0	4.688
US5312296073	Liberty Media Corp. Reg.Sh. C SiriusXM	STK	0	8.793
US5312298541	Liberty Media Corp. Reg.Sh.C FORMULA ONE GP	STK	0	1.885
IE00BZ12WP82	Linde PLC Reg.Shares	STK	0	2.404
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
IE00BGGJJB67	Baillie G.W.-Health Innovat.Fd Reg.Acc.Shs B	ANT	0	717.000
LU0972633704	GIAdv.Fds-Emerg.Mkts High V. Actions Nom. I Acc.	ANT	900	7.881

WertpapierstrategiePortfolio A

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
LU0861001344	LOYS - LOYS Aktien Global I	ANT	0	4.601
LI0500707901	Lumen Vietnam Fund Inh.-Ant. I2 Acc.	ANT	0	108.057
DE000A2DR3Q9	Metzler Premium Aktien Global D	ANT	72.957	72.957
USD				
LU1378878604	Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.	ANT	62.750	271.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
CAD/EUR	EUR	147
DKK/EUR	EUR	85
JPY/EUR	EUR	466
SEK/EUR	EUR	55
SGD/EUR	EUR	13
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
CHF/EUR	EUR	231
GBP/EUR	EUR	28
NOK/EUR	EUR	25
SEK/EUR	EUR	255
USD/EUR	EUR	771

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.

WertpapierStrategiePortfolio A

Entwicklung des Sondervermögens

			EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			396.596.341,40
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr		--
2	Zwischenausschüttung(en)		--
3	Mittelzufluss (netto)		-19.918.945,82
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	59.771.318,30
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	59.771.318,30
	davon aus Verschmelzung	EUR	0,00
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-79.690.264,12
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-280.453,17
5	Ergebnis des Geschäftsjahres		30.074.234,65
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		20.278.993,26
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		22.265.416,99
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres			406.471.177,06

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
30.09.2020	133.576.135,01	1.047,25
30.09.2021	161.858.848,23	1.251,50
30.09.2022	396.596.341,40	1.073,86
30.09.2023	406.471.177,06	1.155,11

WertpapierStrategiePortfolio A

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.10.2022 - 30.09.2023 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	138.582,00	0,39
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	3.016.246,14	8,57
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	200.106,91	0,57
davon Negative Einlagezinsen	-6.201,62	-0,02
davon Positive Einlagezinsen	206.308,53	0,59
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	1.111.899,08	3,16
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	0,00	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-20.787,30	-0,06
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge	-20.787,30	-0,06
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-306.418,06	-0,87
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-306.418,06	-0,87
10. Sonstige Erträge	10.131,48	0,03
davon Kick-Back-Zahlungen	8.737,32	0,02
davon Quellensteuerrückvergütung Dividenden	1.394,16	0,00
Summe der Erträge	4.149.760,25	11,79
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-19.977,05	-0,06
2. Verwaltungsvergütung	-2.663.361,44	-7,57
3. Verwahrstellenvergütung	-104.750,14	-0,30
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-16.415,40	-0,05
5. Sonstige Aufwendungen	-110.338,98	-0,31
davon Beratungsvergütungen	-675,59	-0,00
davon EMIR-Kosten	-55,89	-0,00
davon fremde Depotgebühren	-106.991,08	-0,30
davon Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	-2.616,42	-0,01
Summe der Aufwendungen	-2.914.843,01	-8,28
III. Ordentlicher Nettoertrag	1.234.917,24	3,51
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	7.564.199,04	21,50
2. Realisierte Verluste	-21.269.291,88	-60,44
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-13.705.092,84	-38,95
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-12.470.175,60	-35,44
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	20.278.993,26	57,63
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	22.265.416,99	63,27
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	42.544.410,25	120,90
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	30.074.234,65	85,46

*) 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	26.259.160,39	74,62
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-12.470.175,60	-35,44
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	12.515.139,41	35,57
III. Gesamtausschüttung¹⁾	1.273.845,38	3,62
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung ²⁾	1.273.845,38	3,62

Umlaufende Anteile: Stück 351.890,99

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

¹⁾ Der Abzug von Kapitalertragsteuer und Solidaritätszuschlag erfolgt gemäß § 44 Abs. 1 Satz 3 EStG über die depotführende Stelle bzw. über die letzte inländische auszahlende Stelle als Entrichtungsverpflichtete.

²⁾ Ausschüttung am 24. November 2023 mit Beschlussfassung vom 14. November 2023.

WertpapierstrategiePortfolio A

Anhang.

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)

dynamisches Vergleichsvermögen

Zusammensetzung zum Stichtag:

WertpapierstrategiePortfolio A	20% MSCI Emerging Markets NR in EUR, 80% MSCI World NR in EUR
U1	
WertpapierstrategiePortfolio A	100% MSCI World NR in EUR
U2	
WertpapierstrategiePortfolio A	100% MSCI World NR in EUR
U3	
WertpapierstrategiePortfolio A	100% MSCI World NR in EUR
U4	

Demnach setzt sich das Vergleichsvermögen des Hauptfonds aus einem Portfolio bestehend aus den zuvor genannten Vergleichsvermögen seiner Segmente zusammen. Die Gewichtung der einzelnen Bestandteile in diesem Portfolio entspricht dem Anteil des jeweiligen Segments am Hauptfonds.

Dem Sondervermögen wird ein derivatfreies 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 derivatfreier Vergleichsmaßstab wird möglichst genau nachgebildet. In Ausnahmefällen kann von der Forderung des derivatfreien 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 5,32%
 größter potenzieller Risikobetrag 6,39%
 durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 6,05%

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 Haltedauer 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% aufwies, 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 derivatfreien Vergleichsvermögens nicht übersteigen. Hierdurch wird das Marktrisiko des Sondervermögens klar limitiert.

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

historische Simulation

Im Berichtszeitraum genutzter Umfang des Leverage:

Brutto-Methode

kleinster Leverage 95,65%
 größter Leverage 103,71%
 durchschnittlicher Leverage 98,33%

Commitment-Methode

kleinster Leverage 95,42%
 größter Leverage 103,60%
 durchschnittlicher Leverage 98,25%

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.

Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	0,00
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	0,00
Umlaufende Anteile	STK	351.890,99
Anteilwert	EUR	1.155,11

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 Umsatzvolumina 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

WertpapierstrategiePortfolio A

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.

Gesamtkostenquote (laufende Kosten) 1,22%

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

Die anteiligen laufenden Kosten für die Zielfondsbestände sind auf Basis der zum Geschäftsjahresende des Dachfonds verfügbaren Daten ermittelt.

Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen der aus dem Fonds an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen 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:

ACATIS AKTIEN GLOBAL FONDS E	0,62
Baillie G.W.-Health Innovat.Fd Reg.Acc.Shs B	0,50
BlackRock Fds I-Gl.Unconst.Eq.Reg.Shs D EUR Acc.	n.v.
Finreon SGKB Carbon Focus D	0,75
GI.Adv.Fds-Emerg.Mkts High V. Actions Nom. I Acc.	1,10
iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	0,20
iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Reg.Shs Acc.	0,20
iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Reg.Shares (Acc)	0,55
LOYS Global MH A (t)	0,90
LOYS - LOYS Aktien Europa I	0,15
LOYS - LOYS Aktien Global I	0,16
Loys - Loys Global S	0,16
Lumen Vietnam Fund Inh.-Ant. I2 Acc.	1,00
Lupus alpha Fds-Micro Champio. C	0,90
Metzler Premium Aktien Global D	0,50
Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.	0,75
Nordea 1-Glob.Stab.Eq.Fd Actions Nom. Cl.BI	0,85
Robeco BP GI Premium Equities Act.Nom. Cl.IB Dis.	0,68
Value Intell.Gold Comp.Fds AMI S (a)	0,75

Wesentliche sonstige Erträge		
Kick-Back-Zahlungen	EUR	8.737,32
Quellensteuerrückvergütung Dividenden	EUR	1.394,16

Wesentliche sonstige Aufwendungen		
Beratungsvergütungen	EUR	675,59
EMIR-Kosten	EUR	55,89
Fremde Depotgebühren	EUR	106.991,08
Gebühren für Quellensteuerrückzahlung	EUR	2.616,42

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt	EUR	200.362,52
--	-----	------------

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 Mitarbeitenden 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. Anlageerfolgsprämien, 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 Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeitenden, 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 Mitarbeitenden 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 Mitarbeitenden erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

WertpapierStrategiePortfolio A

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitenden

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

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeitenden ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeitenden sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deko-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 Mitarbeitenden 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 Deko-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 Mitarbeitenden, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deko-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 Mitarbeitende, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 75 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2022 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 Deko Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2022 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deko Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung

davon feste Vergütung	EUR	57.636.189,51
davon variable Vergütung	EUR	43.854.381,97
	EUR	13.781.807,54

Zahl der Mitarbeiter der KVG

461

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deko Investment GmbH* gezahlten Vergütung an Risk Taker

davon Geschäftsführer	EUR	4.472.814,39
davon andere Risk Taker	EUR	2.094.112,05
	EUR	2.378.702,34

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

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall (Portfolioverwaltung)

Das Auslagerungsunternehmen (First Private Investment Management KAG mbH) hat keine Informationen veröffentlicht.

Das Auslagerungsunternehmen (LOYS AG) hat folgende Informationen veröffentlicht:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung

davon feste Vergütung	EUR	2.014.000,00
davon variable Vergütung	EUR	2.014.000,00
	EUR	0,00

Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens

25

Das Auslagerungsunternehmen (ODDO BHF Asset Management GmbH) hat folgende Informationen veröffentlicht:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung

davon feste Vergütung	EUR	24.731.000,00
davon variable Vergütung	EUR	19.866.000,00
	EUR	4.865.000,00

Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens

179

Zusätzliche Informationspflichten nach § 300 Abs. 1 KAGB

Schwer zu liquidierende Vermögenswerte

Der Anteil der Vermögenswerte des Investmentvermögens, die schwer zu liquidieren sind und für die deshalb besondere Regelungen gelten beträgt 0%.

Grundzüge der Risikomanagement-Systeme

Die von der Gesellschaft eingesetzten Risikomanagement-Systeme beinhalten eine ständige Risikocontrolling-Funktion, welche die Erfassung, Messung, Steuerung und Überwachung aller wesentlichen Risiken, denen das Investmentvermögen ausgesetzt ist oder sein kann, umfasst. Als wesentliche Risiken werden dabei Marktrisiken, Adressenausfallrisiken, Liquiditätsrisiken sowie operationelle Risiken angesehen.

Als Marktrisiko wird das Verlustrisiko für ein Investmentvermögen verstanden, das aus Wertveränderungen der Vermögenswerte aufgrund von nachteiligen Änderungen von Marktpreisen resultiert. Die Messung und Erfassung des Marktpreisrisikos erfolgt im Regelfall durch die Ermittlung des Value-at-Risk (VaR) über die Vermögenswerte des Investmentvermögens. Bei der Ermittlung des Value-at-Risk kommen der Varianz-Kovarianz-Ansatz, die historische Simulation sowie die Monte-Carlo-Simulation zum Einsatz. Die ermittelten Werte sowie die eingesetzten Methoden werden regelmäßig mittels geeigneter Backtesting-Verfahren auf ihre Prognosegüte überprüft.

Sofern der qualifizierte Ansatz / VaR-Ansatz nicht zum Tragen kommt, erfolgt die Messung und Erfassung des Marktpreisrisikos auf Grundlage des einfachen Ansatzes / Commitment-Ansatzes. Dabei werden Positionen in derivativen Finanzinstrumenten in entsprechende Positionen in den zu Grunde liegenden Basiswerten umgerechnet. Die Summe aller einzelnen Anrechnungsbeträge / Commitments (absolute Werte) nach Aufrechnung eventueller Gegenpositionen (Netting) und Deckungsposten (Hedging) darf für Zwecke der Risikobegrenzung den Nettoinventarwert des

WertpapierstrategiePortfolio A

Fonds nicht überschreiten.

Das Liquiditätsrisiko ist das Risiko, dass eine Position im Portfolio des Investmentvermögens nicht innerhalb hinreichend kurzer Zeit mit begrenzten Kosten veräußert, liquidiert oder geschlossen werden kann und dass dadurch die Erfüllung von Rückgabeverlangen der Anleger oder von sonstigen Zahlungsverpflichtungen beeinträchtigt wird. Die Liquidität des Investmentvermögens sowie seiner Vermögenswerte wird durch die von der Gesellschaft festgelegten Liquiditätsmessvorkehrungen regelmäßig erfasst. Die Vorkehrungen zur Liquiditätsmessung beinhalten die Betrachtung von sowohl quantitativen als auch qualitativen Informationen der Vermögenswerte des Investmentvermögens unter Berücksichtigung der jeweiligen Marktsituation.

Adressenausfallrisiken resultieren aus Emittenten- und Kontrahentenrisiken. Als Emittentenrisiko wird die Gefahr von Bonitätsverschlechterungen oder Ausfall eines Emittenten verstanden. Das Kontrahentenrisiko ist das Verlustrisiko für ein Investmentvermögen, das aus der Tatsache resultiert, dass die Gegenpartei eines Geschäfts bei der Abwicklung von Leistungsansprüchen ihren Verpflichtungen möglicherweise nicht nachkommen kann. Die Messung des Adressenausfallrisikos erfolgt auf Basis einer internen Bonitätseinstufung der Adressen. Dabei wird anhand einer Analyse quantitativer und qualitativer Faktoren die Bonität der Adressen in ein internes Ratingsystem überführt.

Operationelles Risiko ist das Verlustrisiko für ein Investmentvermögen, das aus unzureichenden internen Prozessen sowie aus menschlichem oder Systemversagen bei der Kapitalverwaltungsgesellschaft oder aus externen Ereignissen resultiert. Die Erfassung, Messung und Überwachung operationeller Risiken erfolgt auf Ebene der Gesellschaft.

Für die wesentlichen Risiken des Investmentvermögens werden zusätzlich regelmäßig Stressstests durchgeführt, welche die Auswirkungen aus potentiell möglichen Veränderungen der Marktbedingungen im Stressfall auf das Investmentvermögen untersuchen.

Zur Risikosteuerung hat die Gesellschaft für alle wesentlichen Risiken angemessene Risikolimits eingerichtet, denen Frühwarnstufen vorgeschaltet sind. Die Definition der Risikolimits erfolgt unter Berücksichtigung von gesetzlichen oder vertraglichen Vorgaben sowie im Einklang mit dem individuellen Risikoprofil des Investmentvermögens. Die Einhaltung der Risikolimits wird täglich überwacht. Für den Fall eines tatsächlichen oder zu erwartenden Überschreitens von Risikolimits existieren geeignete Informations- und Eskalationsmaßnahmen um Abhilfe im besten Interesse des Anlegers zu schaffen. Daneben erfolgt eine regelmäßige Berichterstattung gegenüber der Geschäftsleitung der Gesellschaft über den aktuellen Risikostand des Investmentvermögens sowie Überschreitungen von Risikolimits sowie den abgeleiteten Maßnahmen.

Die im Rahmen der Risikomanagement-Systeme eingesetzten Risikomessvorkehrungen, -prozesse und -verfahren sowie die Grundsätze für das Risikomanagement werden von der Gesellschaft regelmäßig auf Angemessenheit und Wirksamkeit überprüft.

Unterrichtung über das Risikoprofil des Investmentvermögens sowie Überschreiten von Risikolimits

Zum Berichtsstichtag wurden folgende Sensitivitäten gemessen:

Net Equity Delta: +3.978.428 EUR

Net Equity Delta beschreibt die Veränderung des Fondsvermögens bei einer Aktienkursänderung von +1%. In der Berechnung enthalten sind neben Aktien auch sämtliche konzernfremde Zielfonds ohne Berücksichtigung des Anlageschwerpunkts sowie bestimmte Renten mit Sondermerkmalen (wie z.B. Wandelanleihen oder Zertifikate).

Net DV01: +0 EUR

Net DV01 beschreibt die Veränderung des Fondsvermögens bei einem Anstieg der Zinssätze um einen Basispunkt, ohne Berücksichtigung von konzernfremden Zielfonds.

Net CS01: +0 EUR

Net CS01 beschreibt die Veränderung des Fondsvermögens bei einem Anstieg des Credit Spreads um einen Basispunkt, ohne Berücksichtigung von konzernfremden Zielfonds.

Net Currency Delta: +1.081.039 EUR

Net Currency Delta beschreibt die Veränderung des Fondsvermögens bei einer Devisenkursänderung der zugrundeliegenden Fremdwährung (bzw. der zugrundeliegenden Fremdwährungen) von +1%, ohne Berücksichtigung von konzernfremden Zielfonds.

Liquiditätsrisiken:

Der Anteil der liquiden Positionen am Fondsvermögen beträgt 92%. Als Grundlage dafür wird die im Rahmen des täglichen Liquiditätsrisikokontrollings ermittelte Liquiditätsquote als Durchschnitt über die letzten 20 Werte zum Berichtsstichtag herangezogen.

Der Ermittlung von liquiden und illiquiden Positionen liegt ein konservativer Ansatz zugrunde. Positionen werden dabei als potenziell illiquide beurteilt, wenn unter Stressbedingungen (Notwendigkeit eines ad-hoc-Verkaufs) damit zu rechnen ist, dass der aktuelle Bewertungskurs dieser Position bei der Veräußerung in signifikantem Umfang unterschritten wird. Potenzielle Illiquidität ist kein Indikator für eine grundsätzlich fehlende Handelbarkeit eines Instruments.

Im Rahmen der von der Gesellschaft durchgeführten Überwachung der wesentlichen Risiken gab es im Berichtszeitraum keine Überschreitungen von Risikolimits.

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.

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 werden 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. Verleiene 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

WertpapierStrategiePortfolio A

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 einbezogene 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 12. Dezember 2023
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

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

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Wertpapier-StrategiePortfolio A – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. September 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023 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.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die allgemeinen Angaben zum Management und zur Verwaltung des Sondervermögens.

Unser Prüfungsurteil zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und dementsprechend geben wir dies-

bezüglich weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht des Sondervermögens WertpapierStrategiePortfolio A unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

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 eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzu beziehen. 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 falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern 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 dolosen Handlungen oder Irrtümern 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 falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern 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 aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives 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 Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, 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 bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 14. Dezember 2023

Deloitte GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Andreas Koch
Wirtschaftsprüfer

Mathias Bunge
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 2022

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

Landesbank Baden-Württemberg
Am Hauptbahnhof 2
70173 Stuttgart
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Stuttgart, Karlsruhe, Mannheim, Mainz

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. September 2023

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

