

Halbjahresbericht  
zum 31. März 2021.

# **Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

31. März 2021

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds DekaNachhaltigkeit DividendenStrategie für den Zeitraum vom 1. Oktober 2020 bis zum 31. März 2021.

Die konjunkturelle Erholung der globalen Wirtschaft nach dem Corona-Schock im Frühjahr 2020 schritt trotz eines temporären Rücksetzers im Oktober weiter voran. Die BIP-Zahlen für Deutschland und die USA für das dritte Quartal unterstrichen den dynamischen Aufholprozess der zuvor massiv eingebrochenen Wirtschaftsleistung. Die sich ab November aufbauende zweite Corona-Welle und Lockdown-Maßnahmen in vielen Ländern sorgten dann jedoch für erneute Belastungen. In den letzten Monaten gewannen trotz steigender Infektionszahlen und neuer Virusmutationen optimistisch stimmende Signale die Oberhand. Mit der zunehmenden Zahl an Impfungen und weiteren massiven Konjunkturprogrammen in den USA richteten sich die Anleger auf eine kräftige Erholung hin aus.

Die Geld- und Fiskalpolitik war als Reaktion auf die durch die Corona-Krise gestiegenen konjunkturellen Risiken weiterhin von der Implementierung umfangreicher Unterstützungspakete geprägt. Die EZB stockte im Dezember ihr PEPP-Anleihekaufprogramm auf 1,85 Billionen Euro auf. Auch die US-Notenbank kauft direkt Unternehmensanleihen und beließ die Leitzinsen auf dem zu Pandemiebeginn abgesenkten Niveau. Trotz zuletzt anziehender Inflationswerte ist vorerst nicht von einem Ende der offensiven Geldpolitik auszugehen. An den Rentenmärkten ließen dennoch die Renditen ihre Tiefstände erstmal hinter sich. Ende März rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei minus 0,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries bei plus 1,7 Prozent.

Das Gros der Aktienmärkte erzielte im Betrachtungszeitraum kräftige Kurssteigerungen, unterstützt von staatlichen Hilfspaketen sowie der Flutung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken. Zudem spielten während des Berichtszeitraums auch politische Themen wie die US-Präsidentschaftswahl und die finalen Brexit-Verhandlungen eine Rolle. Trotz der noch nicht überwundenen Pandemie erreichten einige Aktienindizes historische Höchststände.

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Abschnitt Anlagepolitik. Gerne nehmen wir die Gelegenheit zum Anlass, um Ihnen für das uns entgegengebrachte Vertrauen zu danken.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter [www.deka.de](http://www.deka.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. März 2021	6
Vermögensaufstellung zum 31. März 2021	7
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	13

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

# Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie Anlagepolitik.

Das Anlageziel des am 1. Oktober 2020 aufgelegten Fonds Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Fonds enthaltenen Vermögenswerte. Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Mit diesem verfolgt das Fondsmanagement die Strategie, weltweit zu mindestens 61 Prozent in Aktien zu investieren. Dabei strebt das Fondsmanagement an, insbesondere solche Aktien zu berücksichtigen, die eine überdurchschnittliche Dividendenqualität erwarten lassen. Die Aktienauswahl erfolgt auf Basis einer Unternehmensanalyse. In diesem Beurteilungsverfahren werden die wirtschaftlichen Daten auf Unternehmensebene analysiert und zu einer Gesamteinschätzung zusammengeführt. Die aus den Kennzahlen und volkswirtschaftlichen Daten gewonnenen Erkenntnisse bilden die Grundlage für das Management dieses Aktienfonds. Besondere Berücksichtigung in der Aktienselektion findet die Analyse der Dividendenqualität. Im Mittelpunkt stehen die Beurteilung des aktuellen und zukünftig prognostizierten Dividendenwachstums sowie die Stetigkeit der Dividenden-Zahlungen an die Aktionäre. Eine strategische Allokation mit festen Quoten wird explizit nicht angestrebt. Daher wird, aufgrund der fehlenden Vergleichbarkeit in der Zusammensetzung von Index und Fondsallokation, auf die Nutzung eines Referenzwertes verzichtet und eine benchmarkfreie Strategie umgesetzt.

Die Investition in Wertpapiere erfolgt nur in solche, die nach Grundsätzen der Nachhaltigkeit ausgewählt werden. Dazu werden Emittenten nach Kriterien für Umwelt (z.B. Klimaschutz), soziale Verantwortung (z.B. Menschenrechte, Standards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Transparenz und Berichterstattung, Bestechung und Korruption) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten. Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unternehmen sollen z.B. den Schutz der internationalen Menschenrechte achten und sicherstellen. Sie sollen unter anderem die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen. Die Einstufung welche Unternehmen in diesem Sinne kontroverse Geschäftspraktiken anwenden, erfolgt im Rahmen des Investmentprozesses. Unternehmen, die kontroverse Waffen herstellen, werden grundsätzlich aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Das Fondsmanagement hat nach der Fondsauflegung die Mittel rasch entsprechend der Fondsausrichtung investiert und einen hohen Investitionsgrad des Sondervermögens erreicht. Zum Stichtag war der Deka-DividendenStrategie zu 93,5 Prozent in Aktien investiert. Durch den Einsatz von Futures auf Aktienindizes erhöhte sich der Investitionsgrad zudem um 5,1 Prozentpunkte.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie

Performance*	01.10.2020 - 31.03.2021
Anteilklasse CF (A)	17,7%

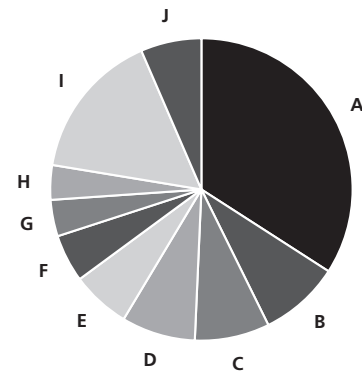
### ISIN

Anteilklasse CF (A)	DE000DK0V521
---------------------	--------------

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

## Fondsstruktur

### Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie



A USA	34,1%
B Deutschland	8,6%
C Frankreich	8,0%
D Schweiz	7,9%
E Großbritannien	6,3%
F Irland	5,1%
G Japan	3,9%
H Niederlande	3,7%
I Sonstige Länder	15,9%
J Barreserve, Sonstiges	6,5%

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

Bei der Betrachtung der absoluten Gewichtungen auf Branchenebene war das Sondervermögen generell breit über die Sektoren hinweg diversifiziert. Mit Blick auf die geografische Struktur bildeten die USA mit Abstand die größte Position, gefolgt von Deutschland, Frankreich, der Schweiz und Großbritannien.

Zur Feinststeuerung des Sondervermögens und zur Erzielung von Zusatzerträgen dienen Derivate. Zum Stichtag befanden sich neben Futures zudem Devisentermingeschäfte im Bestand.

Der Fonds Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie verzeichnete seit Auflegung eine Wertsteigerung um 17,7 Prozent (CF (A)).

# Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie

## Vermögensübersicht zum 31. März 2021.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>23.918.860,88</b>	<b>91,74</b>
China	60.885,15	0,23
Dänemark	259.262,67	1,00
Deutschland	2.230.831,50	8,56
Frankreich	2.084.679,00	8,00
Großbritannien	1.495.540,63	5,75
Hongkong	131.368,51	0,50
Irland	1.372.573,82	5,25
Italien	254.790,00	0,98
Japan	1.012.266,19	3,88
Kaiman-Inseln	49.043,63	0,19
Kanada	902.640,39	3,47
Korea, Republik	618.435,48	2,37
Niederlande	1.068.568,25	4,10
Norwegen	78.529,59	0,30
Portugal	116.568,00	0,45
Schweden	715.284,66	2,74
Schweiz	1.636.156,80	6,26
Spanien	260.792,00	1,00
Taiwan	696.417,27	2,67
USA	8.874.227,34	34,04
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>415.605,68</b>	<b>1,59</b>
Schweiz	415.605,68	1,59
<b>3. Derivate</b>	<b>-25.463,15</b>	<b>-0,10</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.710.908,60</b>	<b>6,56</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>566.626,47</b>	<b>2,18</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-515.564,13</b>	<b>-1,97</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>26.070.974,35</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>23.918.860,88</b>	<b>91,74</b>
CAD	902.640,39	3,47
CHF	1.196.692,88	4,58
DKK	259.262,67	1,00
EUR	6.895.399,50	26,46
GBP	1.531.554,87	5,88
HKD	241.297,29	0,92
JPY	1.012.266,19	3,88
KRW	417.992,27	1,60
NOK	78.529,59	0,30
SEK	715.284,66	2,74
TWD	333.528,71	1,28
USD	10.334.411,86	39,63
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>415.605,68</b>	<b>1,59</b>
CHF	415.605,68	1,59
<b>3. Derivate</b>	<b>-25.463,15</b>	<b>-0,10</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>1.710.908,60</b>	<b>6,56</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>566.626,47</b>	<b>2,18</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-515.564,13</b>	<b>-1,97</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>26.070.974,35</b>	<b>100,00</b>

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





# Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2021	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK		3.500	3.500	0	USD 135,450	404.069,89	1,55
IE00BK9ZQ967	Trane Technologies PLC Reg.Shares	STK		650	1.400	750	USD 166,950	92.493,07	0,35
US9029733048	U.S. Bancorp Reg.Shares	STK		4.000	5.500	1.500	USD 55,870	190.479,44	0,73
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares	STK		950	950	0	USD 373,560	302.477,73	1,16
US9202531011	Valmont Industries Inc. Reg.Shares	STK		450	450	0	USD 238,080	91.315,58	0,35
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		900	1.250	350	USD 211,900	162.548,48	0,62
US9290891004	Voya Financial Inc. Reg.Shares	STK		3.300	3.300	0	USD 63,650	179.028,34	0,69
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>								<b>415.605,68</b>	<b>1,59</b>
<b>CHF</b>								<b>415.605,68</b>	<b>1,59</b>
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK		1.500	1.500	0	CHF 306,300	415.605,68	1,59
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>409.500,00</b>	<b>1,57</b>
<b>Aktien</b>								<b>409.500,00</b>	<b>1,57</b>
<b>EUR</b>								<b>409.500,00</b>	<b>1,57</b>
IE00BF2NR112	Greencoat Renewables PLC Reg.Shares	STK		350.000	350.000	0	EUR 1,170	409.500,00	1,57
<b>Summe Wertpapiervermögen<sup>1)</sup></b>								<b>24.334.466,56</b>	<b>93,33</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>-36.017,73</b>	<b>-0,14</b>
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Juni 21		XEUR	EUR	Anzahl -13				-16.900,00	-0,06
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) Juni 21		XCME	USD	Anzahl 6				2.079,69	0,01
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Juni 21		XCME	USD	Anzahl 2				5.685,06	0,02
E-Mini S&P Energy Future (XAE) Juni 21		XCME	USD	Anzahl 6				-13.168,55	-0,05
H-Shares Index Future (HSE) Apr. 21		XHKF	HKD	Anzahl 6				-14.483,93	-0,06
STXE 600 Oil & Gas Index Future (FSTE) Juni 21		XEUR	EUR	Anzahl 25				770,00	0,00
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR -36.017,73</b>	<b>-0,14</b>
<b>Devisen-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>								<b>10.554,58</b>	<b>0,04</b>
<b>Offene Positionen</b>									
USD/EUR 1.000.000,00			OTC					10.554,58	0,04
<b>Summe Devisen-Derivate</b>								<b>EUR 10.554,58</b>	<b>0,04</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	263.994,74			% 100,000	263.994,74	1,01
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	53.282,35			% 100,000	7.163,87	0,03
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	2.019.423,98			% 100,000	201.697,34	0,77
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	142.799,00			% 100,000	13.961,71	0,05
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	133.573,41			% 100,000	86.622,08	0,33
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	111.450,44			% 100,000	75.377,18	0,29
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	111.518,43			% 100,000	100.876,47	0,39
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	27.761,68			% 100,000	32.523,82	0,12
DekaBank Deutsche Girozentrale			HKD	336.790,31			% 100,000	36.926,94	0,14
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	16.279.712,00			% 100,000	125.315,31	0,48
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	899.236,45			% 100,000	766.449,14	2,95
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR 1.710.908,60</b>	<b>6,56</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 1.710.908,60</b>	<b>6,56</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Dividendenansprüche			EUR	43.287,58				43.287,58	0,17
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	184.682,54				184.682,54	0,71
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	337.127,58				337.127,58	1,29
Forderungen aus Quellensteuerrückstattung			EUR	1.528,77				1.528,77	0,01
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR 566.626,47</b>	<b>2,18</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-823,41				-823,41	0,00
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften			EUR	-487.901,17				-487.901,17	-1,87
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-26.839,55				-26.839,55	-0,10
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR -515.564,13</b>	<b>-1,97</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>EUR 26.070.974,35</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile Klasse CF (A)</b>								<b>STK 221.480,000</b>	
<b>Anteilwert Klasse CF (A)</b>								<b>EUR 117,71</b>	

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

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



# Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.03.2021

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85358 = 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43765 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,01215 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	10,22790 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,10550 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,17325 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,47857 = 1 Euro (EUR)
Südkorea, Won	(KRW)	1.328,01500 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	129,91000 = 1 Euro (EUR)
Taiwan, Neue Dollar	(TWD)	33,43940 = 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	9,12045 = 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,54203 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XHKF	Hongkong - HKEx - Hong Kong Futures Exchange (HKFE)
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)

### OTC

Over-the-Counter

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>AUD</b>				
AU000000APA1	APA Group Stapled Securities	STK	7.900	7.900
<b>CAD</b>				
CA0084741085	Agnico Eagle Mines Ltd. Reg.Shares	STK	1.550	1.550
CA0158571053	Algonquin Power&Utilities Corp Reg.Shares	STK	10.300	10.300
CA3495531079	Fortis Inc. Reg.Shares	STK	1.500	1.500
CA6665111002	Northland Power Inc. Reg.Shares	STK	2.300	2.300
<b>CHF</b>				
CH0012221716	ABB Ltd. Namens-Aktien	STK	3.700	3.700
CH0225173167	Cembra Money Bank AG Namens-Aktien	STK	500	500
CH0030170408	Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.)	STK	60	60
CH0024608827	Partners Group Holding AG Namens-Aktien	STK	65	65
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien	STK	1.100	1.100
<b>DKK</b>				
DK0060094928	Orsted A/S Indehaver Aktier	STK	500	500
<b>EUR</b>				
ES0125220311	Acciona S.A. Acciones Port.	STK	500	500
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien	STK	180	180
NL0013267909	Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder	STK	900	900
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port.	STK	1.400	1.400
NL0011872643	ASR Nederland N.V. Aandelen op naam	STK	1.700	1.700
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien	STK	1.200	1.200
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK	7.500	7.500
DE000EVNK013	Evonik Industries AG Namens-Aktien	STK	2.000	2.000
DE0005772206	Fielmann AG Inhaber-Aktien	STK	750	750
IT0000072170	Fincobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom.	STK	4.300	4.300
DE000A13SX22	HELLA GmbH & Co. KGaA Inhaber-Aktien	STK	1.200	1.200
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK	2.100	2.100
IE0004927939	Kingspan Group PLC Reg.Shares	STK	850	850
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder	STK	1.300	1.300
DE0005470405	Lanxess AG Inhaber-Aktien	STK	2.100	2.100
IE00BZ12WP82	Linde PLC Reg.Shares	STK	600	600
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK	400	400
FI0009014575	Metso Outotec Oyj Reg.Shares	STK	10.000	10.000
FI0009013296	Neste Oyj Reg.Shs	STK	700	700
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien	STK	450	450
FR000120271	Total S.E. Actions au Porteur	STK	2.500	2.500
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien	STK	850	850
<b>GBP</b>				
GB00BYX91H57	JD Sports Fashion PLC Reg.Shares	STK	5.700	5.700
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC Reg.Shares	STK	3.400	3.400
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC Reg.Shares	STK	110.000	110.000
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK	2.800	2.800
<b>JPY</b>				
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd. Reg.Shares	STK	2.000	2.000
JP3783600004	East Japan Railway Co. Reg.Shares	STK	1.100	1.100
JP3837800006	Hoya Corp. Reg.Shares	STK	400	400
<b>KRW</b>				
KR7005380001	Hyundai Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	230	230
<b>NOK</b>				

# Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
NO0010096985	Equinor ASA Navne-Aksjer	STK	5.800	5.800
NO0010715139	Scatec ASA Navne-Aksjer	STK	5.500	5.500
NO0010063308	Telenor ASA Navne-Aksjer	STK	6.400	6.400
<b>USD</b>				
US0152711091	Alexandria Real Est. Equ. Inc. Reg.Shares	STK	400	400
CA0158571053	Algonquin Power&Utilities Corp Reg.Shares	STK	4.000	4.000
US0226631085	Amalgamated Bank Reg.Shs Cl.A	STK	14.000	14.000
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK	300	300
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares	STK	2.400	2.400
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares	STK	1.300	1.300
GB00BLP5YB54	Atlantica Sustainable Infr.PLC Reg.Shares	STK	2.500	2.500
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares	STK	1.200	1.200
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares	STK	350	350
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	2.500	2.500
US1264081035	CSX Corp. Reg.Shares	STK	750	750
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares	STK	1.800	1.800
US2910111044	Emerson Electric Co. Reg.Shares	STK	2.100	2.100
US30040W1080	Eversource Energy Reg.Shares	STK	1.750	1.750
US4523081093	Illinois Tool Works Inc. Reg.Shares	STK	350	350
IE00BY7QL619	Johnson Controls Internat. PLC Reg.Shares	STK	2.400	2.400
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares	STK	560	560
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A	STK	200	200
US5950171042	Microchip Technology Inc. Reg.Shares	STK	400	400
US68902V1070	Otis Worldwide Corp. Reg.Shares	STK	1.100	1.100
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK	3.000	3.000
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares	STK	350	350
US7739031091	Rockwell Automation Inc. Reg.Shares	STK	300	300
US4165151048	The Hartford Finl SvcsGrp Inc. Reg.Shares	STK	2.200	2.200
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares	STK	500	500
US9182041080	V.F. Corp. Reg.Shares	STK	1.600	1.600
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares	STK	1.600	1.600
US92556V1061	Viatrix Inc. Reg.Shares	STK	186	186
<b>Andere Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES06445809L2	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	8.500	8.500
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>EUR</b>				
ES0144583236	Iberdrola S.A. Acciones Port. Em.01/21	STK	121	121
NL0000388619	Unilever N.V. Aandelen op naam	STK	3.850	3.850
<b>SEK</b>				
SE0008585525	Intl.Eng.Skol.Sver.Hldgs.II AB Namn-Aktier	STK	7.000	7.000
<b>Andere Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
FR0014000I00	Alstom S.A. Anrechte	STK	1.200	1.200

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>27.389</b>
(Basiswert(e): DAX Performance-Index, ESTX Banks Index (Price) (EUR), FTSE 250 Index, Hang Seng China Enterprises Index, Hang Seng Index, Nasdaq-100 Index, Russell 2000 Index, S&P 500 Index, S&P Energy Select Sector Index, S&P/ASX 200 Index, STXE 600 Basic Resources Index (Price) (EUR), STXE 600 Index (Price) (EUR), STXE 600 Oil & Gas Index (Price) (EUR), TOPIX Index (Price) (JPY))		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>11.311</b>
(Basiswert(e): DAX Performance-Index, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index, STXE 600 Index (Price) (EUR))		
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	<b>EUR</b>	<b>577</b>
(Basiswert(e): S&P 500 Index)		
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisentermingeschäfte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
CAD/EUR	<b>EUR</b>	<b>91</b>
GBP/EUR	<b>EUR</b>	<b>168</b>
JPY/USD	<b>EUR</b>	<b>44</b>
<b>Devisentermingeschäfte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
CHF/USD	<b>EUR</b>	<b>60</b>
GBP/EUR	<b>EUR</b>	<b>167</b>
HKD/EUR	<b>EUR</b>	<b>55</b>
USD/EUR	<b>EUR</b>	<b>465</b>

# Deka-Nachhaltigkeit DividendenStrategie

## Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF (A)	STK	221,480
Anteilwert Klasse CF (A)	EUR	117,71

### Angaben zu Bewertungsverfahren

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgt durch die Verwaltungsgesellschaft auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch (§ 168) und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und -Bewertungsverordnung (KARBV).

### Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen / Investmentanteile

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzolumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte, z.B. Broker-Quotes, zugrunde gelegt, welche sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Investmentanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs bewertet.

### Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Verzinsliche Wertpapiere, rentenähnliche Genussscheine, Zertifikate und Schuldscheindarlehen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mittels externer Modellkurse, z.B. Broker-Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.

### Bankguthaben

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

### Derivate

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Die Bewertung von Futures und Optionen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, erfolgt anhand von Fair Values, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Black-Scholes-Merton) ermittelt werden. Die Bewertung von Swaps erfolgt anhand von Fair Values, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Discounted-Cash-Flow-Verfahren) ermittelt werden. Devisentermingeschäfte werden nach der Forward Point Methode bewertet.

### Sonstiges

Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Fonds geführt werden, wird in diese Währung zu den jeweiligen Devisenkursen (i.d.R. Reuters-Fixing) umgerechnet.

### Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

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

---

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

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2019

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

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. März 2021

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



**Deka Investment GmbH**

Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39  
[www.deka.de](http://www.deka.de)