

Jahresbericht
zum 31. Dezember 2023.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. Dezember 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023.

Sowohl die im gesamten Berichtszeitraum anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren (Ukraine-Krieg, Nahost-Konflikt) als auch die teilweise drastischen Preissteigerungen, welche die wirtschaftliche Stimmung eintrübten, waren zentrale Themen des Jahres 2023. Vor dem Hintergrund hoher Lebenshaltungskosten, einer schwachen Auslandsnachfrage und einer strafferen Geldpolitik verlor die europäische Wirtschaftsentwicklung spürbar an Schwung. In Deutschland muss für das Jahr 2023 sogar mit einem leichten Rückgang des Bruttoinlandsprodukts gerechnet werden. Im Laufe des Jahres zeigte die Inflation jedoch Anzeichen einer Normalisierung, was in den letzten Monaten zu einer aufgehellten Stimmung an den Finanzmärkten führte.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtsjahr die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu restriktiven Maßnahmen veranlasste. Während sich die Fed zuletzt in einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bewegte, erhöhte die EZB den Hauptrefinanzierungssatz bis auf 4,50 Prozent. An den Rentenmärkten zogen die Renditen in diesem Umfeld bis in das dritte Quartal hinein signifikant an. Angesichts von Anzeichen eines Endes des Zinserhöhungs-Zyklus entfernten sich jedoch die Verzinsungen zuletzt merklich von ihren zuvor erreichten mehrjährigen Höchstständen. Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen ging auf Jahressicht von 2,6 Prozent auf 2,0 Prozent zurück. Laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten Ende 2023 bei 3,9 Prozent und damit exakt auf dem Niveau des Vorjahres.

Angesichts der verschiedenen wirtschaftlichen und geopolitischen Belastungsfaktoren wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode einige Schwankungen auf, konnten jedoch auf Jahressicht überwiegend deutlich zulegen. Lediglich China litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise. Am Devisenmarkt notierte der Euro Ende Dezember mit 1,10 US-Dollar etwas höher als zu Jahresbeginn, während bei den Rohstoffen Rohöl den Berichtszeitraum bei rund 77 US-Dollar pro Barrel (Brent Future) beendete. Die Feinunze Gold kletterte über die Marke von 2.000 US-Dollar und erreichte im Dezember kurzzeitig ein neues Allzeit-Hoch.

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
Anteilklassen im Überblick	8
Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023	9
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023	11
Anhang	29
Ökologische und/oder soziale Merkmale	34
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	53
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	55

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 01.01.2023 bis 31.12.2023

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Tätigkeitsbericht.

Anlageziel des Fonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset ist es einen mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachs durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und die positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte zu erreichen. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, kann der fundamental und aktiv gemanagte Fonds weltweit in unterschiedliche Anlageklassen investieren. Im Rahmen des Auswahlprozesses für Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Investmentanteile werden neben wirtschaftlichen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien (Ökologie, Soziales und Governance) berücksichtigt. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Aktien, Aktienfonds und Aktienderivate investiert werden darf, beträgt maximal 60 Prozent. Höchstens 40 Prozent des Wertes des Fondsvermögens darf in nicht gegen Euro abgesicherte Fremdwährungsbestände angelegt werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental geprägte Investmentansatz erfolgt nach einer Top-Down und Bottom-up Betrachtung. Der Ausgangspunkt ist zunächst die weltweite volkswirtschaftliche Untersuchung (Top-down-Perspektive), um die wesentlichen makroökonomischen Einflussfaktoren auf die Investmententscheidung zu bestimmen. Anschließend erfolgt bei der Zusammensetzung des Portfolios eine qualitative Einschätzung der einzelnen Vermögensgegenstände anhand verschiedener Kriterien (Bottom-up-Perspektive). Bei Aktien sind dies z.B. die Bewertung des Geschäftsmodells oder der Managementqualität, bei Anleihen z.B. die Kreditqualität oder die relative Bewertung einer Anleihe zur eigenen Zinskurve. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus. 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.

Wichtige Kennzahlen

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	seit Auflegung p.a.
Anteilklasse CF	8,6%	0,8%	1,3%
Anteilklasse TF	8,1%	0,3%	0,8%

ISIN

Anteilklasse CF	DE000DKOV5FO
Anteilklasse TF	DE000DKOV5G8

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

Veräußerungsergebnisse im Berichtszeitraum

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset CF

Realisierte Gewinne aus	in Euro
Renten und Zertifikate	310.043,42
Aktien	3.479.247,29
Zielfonds und Investmentvermögen	483.150,49
Optionen	432.648,88
Futures	3.537.103,02
Swaps	1.720.042,50
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	6.132.135,77
Devisenkassageschäften	32.444,78
sonstigen Wertpapieren	1,24
Summe	16.126.817,39

Realisierte Verluste aus	in Euro
Renten und Zertifikate	-1.478.263,33
Aktien	-1.557.787,17
Zielfonds und Investmentvermögen	-3.819.479,97
Optionen	-444.641,16
Futures	-3.013.258,77
Swaps	-1.436.180,02
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	-6.392.889,92
Devisenkassageschäften	-197.875,91
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	-18.340.376,25

Die Angaben spiegeln das Verhältnis der Veräußerungsergebnisse in den anderen Anteilklassen des Sondervermögens wider.

Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie 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. Nicht investiert wird zudem in Staaten, die nach dem Freedom-House Index als "unfrei" ("not free") eingestuft werden und/oder nach dem Corruption-Perceptions-Index einen Score von weniger als 40 aufweisen. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens "BBB" oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

Detaillierte Angaben zur Nachhaltigkeitsstrategie und deren Merkmale können Sie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung im Anhang des Verkaufsprospekts, dem entsprechenden Anhang des Jahresberichts sowie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung auf der Webseite des Fonds entnehmen.

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

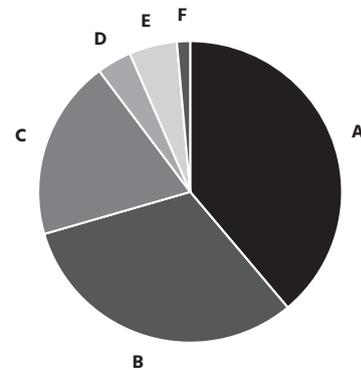
Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Unternehmensanleihen aufgestockt

Vor dem Hintergrund wirtschaftlicher und geopolitischer Belastungsfaktoren verloren 2023 die europäische wie auch die deutsche Wirtschaft an Schwung. Angesichts weltweit hoher Inflationsraten über weite Strecken des Berichtszeitraums sahen sich die internationalen Währungshüter gezwungen, ein ehrgeiziges geldpolitisches Straffungsprogramm zügig voranzutreiben. Die US-Notenbank und die EZB erhöhten in diesem Umfeld die Leitzinsen deutlich. An den Rentenmärkten zogen die Renditen bis in das dritte Quartal hinein signifikant an, entfernten sich zuletzt jedoch wieder von ihren zuvor erreichten Höchstständen. Wesentlicher Faktor hierfür war, dass die Inflationsentwicklung Anzeichen einer Normalisierung zeigte, was in den letzten Monaten zu einer aufgehellten Stimmung an den Finanzmärkten führte. Die internationalen Aktienindizes verzeichneten in der Betrachtungsperiode einige Schwankungen, konnten auf Jahressicht jedoch überwiegend spürbar zulegen. Das Fondsmanagement erhöhte in der Berichtsperiode die Aktienmarktpositionierung, wobei die Steuerung auch über Derivate erfolgte. Ende Dezember umfassten Aktien und Aktienfonds insgesamt 42,7 Prozent des Fondsvolumens. Zudem nutzte das Fondsmanagement Futures auf Aktienindizes, die den wirtschaftlichen Investitionsgrad in Aktien um 17,2 Prozentpunkte erhöhten. Unter regionalen Gesichtspunkten standen nordamerikanische, europäische und japanische Einzeltitel im Fokus der Investitionen, wobei US-Titel spürbar ausgebaut wurden. In China erfolgten nur taktische Investments, strategisch bleibt dort das politische Risiko vorerst zu hoch. Unter Branchenaspekten fanden per saldo nur leichte Anpassungen statt. Industrie, Technologie und Pharma bildeten die größten Sektorbestände im Portfolio, wobei der Anteil von Pharma etwas zurückging und Technologie hingegen zulegte.

Fondsstruktur

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset



A	Aktien	38,9%
B	Rentenfonds	31,6%
C	Renten	19,3%
D	Aktienfonds	3,7%
E	Wertpapiere mit besonderen Merkmalen	5,1%
F	Barreserve, Sonstiges	1,4%

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

Wertentwicklung im Berichtszeitraum

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Index: 31.12.2022 = 100



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

Zyklische Branchen wurden hingegen eher zurückhaltend berücksichtigt. Die Ausrichtung lag auf einem balancierten Portfolio mit Diversifikationseffekten und vorbereitet auf unterschiedliche Marktphasen. Drei ETF (Exchange Traded Funds) mit unterschiedlichen regionalen Ausrichtungen ergänzten das Aktiensegment.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Die Anlagen im Rentenbereich wurden insgesamt erhöht und die Duration aktiv gesteuert. Zum Stichtag entfielen auf den Rentenbereich 56,0 Prozent des Fondsvolumens (inkl. Wertpapiere mit besonderen Merkmalen), wobei der größere Teil auf nachhaltige Rentenfonds mit unterschiedlichen thematischen und regionalen Schwerpunkten entfiel.

Zudem umfasste das Segment Unternehmensanleihen, teilweise mit besonderen Merkmalen ausgestattet, welche spürbar aufgestockt wurden. Corporate Bonds erschienen mit einem attraktiven Chance/Risiko-Verhältnis und überzeugten auch bei den laufenden Erträgen. Kleinere Positionen des Rentensegments entfielen auf europäische Staatsanleihen und Titel halbstaatlicher Emittenten. Daneben kamen Zinsterminkontrakte und Swaps mit Rentenkomponente zur Steuerung des Segments zum Einsatz. Der Fonds setzte auf die Vereinnahmung von Prämien durch den systematischen Verkauf von (Zins-) Optionen. Darüber hinaus nutzte das Fondsmanagement Devisentermingeschäfte auf verschiedene Währungen.

Positive Effekte für die Fondsentwicklung lieferte die Akzentuierung des Aktieninvestitionsgrades und zeitweilige Anhebung der Duration. Das Timing der Verlängerung) der Duration war jedoch etwas zu früh gewählt, da sich die Zinsen zunächst noch weiter erhöhten, bevor es im Anschluss zu einem massiven Rückgang kam.

In der Berichtsperiode verzeichnete der Fonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset eine Wertentwicklung von plus 8,6 Prozent (Anteilklasse CF) bzw. plus 8,1 Prozent (Anteilklasse TF).

Anteile an dem Sondervermögen sind Wertpapiere, deren Preise durch die börsentäglichen Kursschwankungen der im Fonds befindlichen Vermögensgegenstände bestimmt werden und deshalb steigen oder auch fallen können (Marktpreisrisiken).

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen i.d.R. die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Durch die Investition des Fonds in Anleihen können bei Ausfall eines Emittenten Verluste für den Fonds entstehen.

Aufgrund der Investitionen in fremde Währungen unterlag der Fonds Fremdwährungsrisiken. Darüber hinaus waren Derivate im Portfolio enthalten, sodass auch hierfür spezifische Risiken wie das Kontrahentenrisiko zu beachten waren.

Die Risiken von Investmentanteilen, die für einen Fonds erworben werden (so genannte „Zielfonds“), stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Zielfonds enthaltene Vermögensgegenständen. 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 spezi-

fischen Risiken wie dem Zinsänderungs- und Adressenausfallrisiko sowie Aktienkursrisiken.

Die Einschätzung der im Berichtsjahr eingegangenen Liquiditätsrisiken orientiert sich an der Veräußerbarkeit von Vermögenswerten, die potenziell eingeschränkt sein kann. Der Fonds verzeichnete im Berichtszeitraum keine wesentlichen Liquiditätsrisiken. Zur Bewertung und Vermeidung operationeller Risiken führt die Gesellschaft detaillierte Risikoüberprüfungen durch. Das Sondervermögen unterlag im Berichtszeitraum keinen besonderen operationellen Risiken.

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung*, der Währung des Anteilwertes, der Vertriebsvergütung**, der erfolgsabhängigen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von zwei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags und der Verwaltungsvergütung sowie der Vertriebsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung CF und TF.

Weitere Details zu den Merkmalen der jeweiligen Anteilklasse entnehmen Sie bitte der untenstehenden Tabelle. Näheres ist im Verkaufsprospekt geregelt.

Der Erwerb von Vermögensgegenständen ist nur einheitlich für den gesamten Fonds und nicht für eine einzelne Anteilklasse oder eine Gruppe von Anteilklassen zulässig. Die Bildung neuer Anteilklassen ist zulässig, sie liegt im Ermessen der Gesellschaft. Es ist weder notwendig, dass Anteile einer Anteilklasse im Umlauf sind, noch dass Anteile einer neu gebildeten Anteilklasse umgehend auszugeben sind. Bei erstmaliger Ausgabe von Anteilen einer Anteilklasse ist deren Wert auf der Grundlage des für das gesamte Sondervermögen nach § 168 Absatz 1 Satz 1 KAGB ermittelten Wertes zu berechnen.

Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	1,00% p.a.	3,00%	Ausschüttung
Anteilklasse TF**	1,50% p.a.	keiner	Ausschüttung

* Der Verwaltungsvergütungssatz wird auf das durchschnittliche Fondsvermögen berechnet, das sich aus den Tageswerten zusammensetzt.

** Die Vertriebsvergütung wird durch die Verwaltungsvergütung abgedeckt und wird dem Sondervermögen nicht gesondert belastet.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	91.777.794,44	38,85
Belgien	409.072,12	0,18
Bermuda	70.360,73	0,03
Dänemark	4.222.753,81	1,78
Deutschland	4.009.316,11	1,70
Finnland	975.952,36	0,41
Frankreich	7.542.723,97	3,21
Großbritannien	5.641.094,07	2,39
Irland	1.783.050,98	0,75
Italien	1.898.344,01	0,80
Japan	11.463.092,74	4,85
Niederlande	5.170.145,16	2,19
Norwegen	646.611,08	0,28
Österreich	98.044,10	0,04
Schweden	946.729,36	0,39
Schweiz	5.470.543,29	2,31
Spanien	1.831.469,55	0,78
USA	39.598.491,00	16,76
2. Anleihen	56.964.153,18	24,12
Belgien	953.188,75	0,40
Dänemark	476.725,00	0,20
Deutschland	9.790.500,65	4,16
Finnland	2.082.348,88	0,88
Frankreich	7.927.241,50	3,36
Griechenland	1.005.802,10	0,43
Großbritannien	2.704.642,22	1,14
Irland	948.483,17	0,40
Italien	5.108.469,90	2,16
Kroatien	1.069.500,00	0,45
Lettland	147.141,75	0,06
Luxemburg	1.197.184,00	0,50
Niederlande	7.633.001,73	3,24
Norwegen	701.351,00	0,29
Österreich	141.730,20	0,06
Polen	90.526,00	0,04
Portugal	374.336,00	0,16
San Marino	1.288.100,00	0,55
Schweden	666.562,50	0,28
Schweiz	396.342,00	0,17
Slowakei	2.160.590,00	0,93
Slowenien	1.085.991,10	0,46
Spanien	3.814.086,50	1,60
Ungarn	768.750,00	0,33
USA	4.279.561,63	1,81
Zypern	151.996,60	0,06
3. Investmentanteile	83.255.126,13	35,32
Irland	46.109.144,17	19,57
Luxemburg	37.145.981,96	15,75
4. Derivate	-3.763.914,93	-1,59
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	673.184,92	0,27
6. Sonstige Vermögensgegenstände	8.516.793,88	3,63
II. Verbindlichkeiten	-1.414.287,29	-0,60
III. Fondsvermögen	236.008.850,33	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	91.777.794,44	38,85
CHF	4.475.850,56	1,89
DKK	4.222.753,81	1,78
EUR	23.208.104,43	9,85
GBP	5.305.742,83	2,24
JPY	11.463.092,74	4,85
NOK	646.611,08	0,28
SEK	946.729,36	0,39
USD	41.508.909,63	17,57
2. Anleihen	56.964.153,18	24,12
EUR	53.427.407,83	22,62
GBP	609.731,52	0,26
USD	2.927.013,83	1,24
3. Investmentanteile	83.255.126,13	35,32
EUR	32.784.676,00	13,91
USD	50.470.450,13	21,41
4. Derivate	-3.763.914,93	-1,59
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	673.184,92	0,27
6. Sonstige Vermögensgegenstände	8.516.793,88	3,63
II. Verbindlichkeiten	-1.414.287,29	-0,60
III. Fondsvermögen	236.008.850,33	100,00

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Gliederung nach Anlageart - Währung

Kurswert
in EUR

% des Fonds-
vermögens *)

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

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								131.564.545,23	55,69
Aktien								91.777.794,44	38,85
EUR								23.208.104,43	9,85
ES0125220311	Acciona S.A. Acciones Port.	STK		410	0	0	EUR 133,100	54.571,00	0,02
ES0167050915	ACS, Act.de Construy Serv. SA Acciones Port.	STK		3.899	3.899	0	EUR 40,170	156.622,83	0,07
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien	STK		2.502	0	460	EUR 185,000	462.870,00	0,20
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A. Actions au Porteur	STK		530	530	0	EUR 118,200	62.646,00	0,03
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		17.950	0	0	EUR 26,035	467.328,25	0,20
NL0013267909	Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder	STK		2.984	0	0	EUR 74,960	223.680,64	0,09
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port.	STK		7.573	7.573	0	EUR 64,880	491.336,24	0,21
IT0004056880	Amplifon S.p.A. Azioni nom.	STK		1.538	0	0	EUR 31,380	48.262,44	0,02
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		2.713	93	80	EUR 687,100	1.864.102,30	0,79
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK		16.709	16.709	0	EUR 19,140	319.810,26	0,14
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		32.498	0	0	EUR 29,495	958.528,51	0,41
FR0013280286	bioMerieux Actions au Porteur (P.S.)	STK		710	0	0	EUR 100,950	71.674,50	0,03
FR0000120172	Carrefour S.A. Actions Port.	STK		10.814	10.814	0	EUR 16,570	179.187,98	0,08
FR001400AJ45	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom.	STK		10.584	0	0	EUR 32,450	343.450,80	0,15
NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam	STK		15.783	0	0	EUR 10,865	171.482,30	0,07
FR0000045072	Crédit Agricole S.A. Actions Port.	STK		20.784	20.784	0	EUR 12,848	267.032,83	0,11
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port.	STK		10.800	0	0	EUR 58,720	634.176,00	0,27
FR0014003TT8	Dassault Systemes SE Actions Port.	STK		11.659	11.659	0	EUR 44,340	516.960,06	0,22
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien	STK		3.291	0	0	EUR 185,400	610.151,40	0,26
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK		16.666	16.666	0	EUR 45,000	749.970,00	0,32
CH1216478797	DSM-Firmenich AG Namens-Aktien	STK		3.417	3.417	0	EUR 92,470	315.969,99	0,13
ES0127797019	EDP Renováveis S.A. Acciones Port.	STK		4.689	62	0	EUR 18,520	86.840,28	0,04
BE0003822393	Elia Group Actions au Port.	STK		542	0	0	EUR 112,400	60.920,80	0,03
FI0009007884	Elisa Oyj Reg.Shares CLA	STK		2.275	0	0	EUR 41,800	95.095,00	0,04
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK		75.000	75.000	0	EUR 6,747	506.025,00	0,21
IT0000072170	Finacobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom.	STK		10.599	10.599	0	EUR 13,635	144.517,37	0,06
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK		2.700	0	0	EUR 37,500	101.250,00	0,04
DE000A161408	HelloFresh SE Inhaber-Aktien	STK		3.401	3.401	0	EUR 14,315	48.685,32	0,02
DE0006048408	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien	STK		1.599	0	0	EUR 64,840	103.679,16	0,04
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien	STK		2.745	0	0	EUR 72,680	199.506,60	0,08
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur	STK		530	270	0	EUR 1.925,400	1.020.462,00	0,43
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK		80.000	80.000	0	EUR 11,870	949.600,00	0,40
BE0003565737	KBC Groep N.V. Parts Sociales au Port.	STK		3.858	0	0	EUR 58,540	225.847,32	0,10
IE0004906560	Kerry Group PLC Reg.Shares A	STK		2.496	0	0	EUR 78,740	196.535,04	0,08
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares CLB	STK		4.249	0	0	EUR 18,020	76.566,98	0,03
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		3.900	0	209	EUR 450,900	1.758.510,00	0,75
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK		8.800	8.800	0	EUR 11,190	98.472,00	0,04
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		2.242	220	0	EUR 143,400	321.502,80	0,14
FI0009014575	Metso Oyj Reg.Shares	STK		11.100	11.100	0	EUR 9,258	102.763,80	0,04
IT0004965148	Moncler S.p.A. Azioni nom.	STK		3.400	3.400	0	EUR 55,960	190.264,00	0,08
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		2.400	2.400	0	EUR 376,200	902.880,00	0,38
FI0009013296	Neste Oyj Reg.Shs	STK		6.664	0	0	EUR 32,450	216.246,80	0,09
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder	STK		7	256	4.741	EUR 36,020	252,14	0,00
FI0009000681	Nokia Oyj Reg.Shares	STK		85.000	85.000	0	EUR 3,085	262.225,00	0,11
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A. Azioni nom.	STK		9.100	9.100	0	EUR 10,270	93.457,00	0,04
NL0013654783	Prosus N.V. Reg.Shares	STK		27.833	15.063	1.030	EUR 27,150	755.665,95	0,32
IT0004176001	Prysmian S.p.A. Azioni nom.	STK		4.340	0	0	EUR 41,400	179.676,00	0,08
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien	STK		1.667	0	0	EUR 50,540	84.250,18	0,04
ES0173093024	Redeia Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		6.208	3.000	0	EUR 14,900	92.499,20	0,04
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK		30.048	0	0	EUR 35,760	1.074.516,48	0,46
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port.	STK		9.252	0	0	EUR 182,000	1.683.864,00	0,71
IT0003153415	Sham S.p.A. Azioni nom.	STK		32.073	0	0	EUR 4,656	149.331,89	0,06
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder	STK		10.776	10.776	0	EUR 45,445	489.715,32	0,21
FI0009005961	Stora Enso Oyj Reg.Shares CLR	STK		9.100	0	0	EUR 12,595	114.614,50	0,05
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom.	STK		22.369	0	0	EUR 7,534	168.528,05	0,07
BE0974320526	Umicore S.A. Actions Nom. ¹⁾	STK		4.900	1.855	0	EUR 24,960	122.304,00	0,05
NL00150001Y2	Universal Music Group N.V. Aandelen op naam	STK		13.381	13.381	0	EUR 25,800	345.229,80	0,15
FR0013176526	Valéo S.E. Actions Port.	STK		3.294	0	0	EUR 14,035	46.231,29	0,02
AT0000746409	Verbund AG Inhaber-Aktien	STK		1.177	0	0	EUR 83,300	98.044,10	0,04
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien	STK		11.735	11.735	0	EUR 28,790	337.850,65	0,14
FI00090003727	Wärtsilä Corp. Reg.Shares	STK		8.178	0	0	EUR 13,260	108.440,28	0,05
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		4.176	0	0	EUR 129,000	538.704,00	0,23
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien	STK		4.000	0	0	EUR 21,680	86.720,00	0,04
CHF								4.475.850,56	1,89
CH0010645932	Givaudan SA Namens-Aktien	STK		161	0	0	CHF 3.461,000	598.705,29	0,25
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien	STK		3.700	3.700	0	CHF 47,230	187.760,96	0,08
CH0025238863	Kuehne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien	STK		846	0	0	CHF 288,700	262.423,53	0,11

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CH0025751329	Logitech International S.A. Namens-Aktien		STK	3.300	3.300	0	CHF 79,740	282.732,54	0,12
CH0013841017	Lonza Group AG Namens-Aktien		STK	1.291	0	0	CHF 353,500	490.344,47	0,21
CH1256740924	SGS S.A. Namen-Aktien		STK	2.375	2.375	0	CHF 72,180	184.190,03	0,08
CH0435377954	SIG Group AG Namens-Aktien		STK	5.220	5.220	0	CHF 19,250	107.965,96	0,05
CH0012549785	Sonova Holding AG Namens-Aktien		STK	840	0	0	CHF 273,300	246.663,30	0,10
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien		STK	5.462	717	0	CHF 94,520	554.703,66	0,24
CH0012453913	Temenos AG Nam.-Aktien		STK	1.198	1.198	0	CHF 77,740	100.066,10	0,04
CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien		STK	491	491	0	CHF 421,600	222.416,86	0,09
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien		STK	2.637	2.637	0	CHF 436,900	1.237.877,86	0,52
DKK								4.222.753,81	1,78
DK0060448595	Coloplast AS Navne-Aktier B		STK	1.873	0	0	DKK 775,200	194.798,43	0,08
DK0060079531	DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier		STK	3.202	3.202	0	DKK 1.193,000	512.502,15	0,22
DK0010272202	GENMAB AS Navne-Aktier		STK	1.159	0	0	DKK 2.156,000	335.247,93	0,14
DK0062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B		STK	22.700	22.700	0	DKK 698,700	2.127.896,59	0,90
DK0060336014	Novozymes A/S Navne-Aktier B		STK	3.163	0	0	DKK 371,900	157.819,00	0,07
DK0060094928	Orsted A/S Indehaver Aktier		STK	3.009	0	0	DKK 374,500	151.184,73	0,06
DK0060252690	Pandora A/S Navne-Aktier		STK	1.568	0	0	DKK 936,000	196.904,58	0,08
DK0061539921	Vestas Wind Systems A/S Navne-Aktier		STK	19.000	4.100	0	DKK 214,350	546.400,40	0,23
GBP								5.305.742,83	2,24
GB00BF8Q6K64	Abrdn PLC Reg.Shares		STK	28.989	0	0	GBP 1,791	59.800,39	0,03
GB00B02J6398	Admiral Group PLC Reg.Shares		STK	3.970	3.970	0	GBP 26,890	122.957,92	0,05
GB0006731235	Associated British Foods PLC Reg.Shares		STK	6.061	1.730	0	GBP 23,650	165.101,36	0,07
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC Reg.Shares		STK	16.020	16.020	0	GBP 7,184	132.557,42	0,06
GB0000811801	Barratt Developments PLC Reg.Shares		STK	15.842	0	0	GBP 5,630	102.729,13	0,04
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares		STK	1.808	0	0	GBP 47,220	98.333,08	0,04
GB0030913577	BT Group PLC Reg.Shares		STK	133.700	0	0	GBP 1,235	190.183,83	0,08
GB0031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares		STK	6.270	0	0	GBP 14,260	102.982,23	0,04
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien		STK	2.743	0	0	GBP 23,000	72.665,60	0,03
IE0001827041	CRH PLC Reg.Shares		STK	11.864	11.864	0	GBP 54,160	740.090,81	0,31
GB00BJFFLV09	Croda International PLC Reg.Shares		STK	2.188	0	0	GBP 50,720	127.820,87	0,05
IE0002424939	DCC PLC Reg.Shares		STK	1.267	0	0	GBP 57,800	84.348,95	0,04
JE00BJVNS543	Ferguson PLC Reg.Shares		STK	1.250	1.250	0	GBP 151,150	217.617,28	0,09
GB00BMJ6DW54	Informa PLC Reg.Shares		STK	23.064	0	0	GBP 7,770	206.410,06	0,09
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group Reg.Shares		STK	2.800	0	0	GBP 70,920	228.718,86	0,10
GB0031638363	Intertek Group PLC Reg.Shares		STK	2.700	0	0	GBP 42,630	132.572,76	0,06
GB00B019KW72	J. Sainsbury PLC Reg.Shs		STK	29.498	0	0	GBP 2,995	101.757,07	0,04
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC Reg.Shares		STK	2.637	0	0	GBP 17,100	51.937,55	0,02
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg.Shares		STK	32.691	0	0	GBP 2,446	92.100,06	0,04
GB0005603997	Legal & General Group PLC Reg.Shares		STK	100.000	0	0	GBP 2,508	288.870,20	0,12
GB00B1CRLC47	Mondi PLC Reg.Shares		STK	7.692	0	0	GBP 15,395	136.393,66	0,06
GB0006776081	Pearson PLC Reg.Shares		STK	11.600	0	0	GBP 9,674	129.252,60	0,05
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares		STK	12.841	741	0	GBP 54,400	804.586,91	0,34
GB00BP9LHF23	Schroders PLC Reg.Shares		STK	13.129	0	0	GBP 4,324	65.387,18	0,03
GB00B5ZN1N88	Segro PLC Reg.Shares		STK	18.662	0	0	GBP 8,916	191.647,63	0,08
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC Reg.Shares		STK	4.035	0	0	GBP 25,790	119.858,85	0,05
GB0007669376	St. James's Place PLC Reg.Shares		STK	8.361	0	0	GBP 6,834	65.812,50	0,03
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC Reg.Shares		STK	60.000	0	0	GBP 1,456	100.620,82	0,04
GB00B8C3BL03	The Sage Group PLC Reg.Shares		STK	17.562	17.562	0	GBP 11,810	238.890,61	0,10
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC Reg.Shares		STK	10.923	0	0	GBP 10,630	133.736,64	0,06
JPY								11.463.092,74	4,85
JP3388200002	Aeon Co. Ltd. Reg.Shares		STK	10.900	1.800	0	JPY 3.151,000	219.420,56	0,09
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc. Reg.Shares		STK	7.200	1.100	800	JPY 5.440,000	250.226,79	0,11
JP3429800000	ANA Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.500	2.500	0	JPY 3.060,000	48.872,42	0,02
JP3111200006	Asahi Kasei Corp. Reg.Shares		STK	20.000	0	0	JPY 1.039,000	132.754,10	0,06
JP3937200008	Azbil Corp. Reg.Shares		STK	1.700	0	0	JPY 4.666,000	50.675,27	0,02
JP3830000000	Brother Industries Ltd. Reg.Shares		STK	3.600	3.600	0	JPY 2.250,500	51.758,77	0,02
JP3475350009	Daiichi Sankyo Co. Ltd. Reg.Shares		STK	13.700	0	3.300	JPY 3.872,000	338.889,67	0,14
JP3481800005	Daikin Industries Ltd. Reg.Shares		STK	2.600	400	400	JPY 22.985,000	381.786,24	0,16
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd. Reg.Shares		STK	10.000	10.000	0	JPY 4.272,000	272.918,93	0,12
JP3502200003	Daiwa Securities Group Inc. Reg.Shares		STK	19.100	19.100	0	JPY 949,100	115.810,45	0,05
JP3802400006	Fanuc Corp. Reg.Shares		STK	14.500	11.600	0	JPY 4.147,000	384.153,20	0,16
JP3820000002	Fuji Electric Co. Ltd. Reg.Shares		STK	2.000	2.000	0	JPY 6.069,000	77.544,24	0,03
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Reg.Shares		STK	2.700	300	700	JPY 21.275,000	366.974,38	0,16
JP3774200004	Hankyu Hanshin Holdings Inc. Reg.Shares		STK	4.000	1.300	0	JPY 4.489,000	114.712,83	0,05
JP3788600009	Hitachi Ltd. Reg.Shares		STK	8.900	8.900	0	JPY 10.170,000	578.246,98	0,25
JP3837800006	Hoya Corp. Reg.Shares		STK	5.000	5.000	0	JPY 17.625,000	562.991,12	0,24
JP3148800000	Ibiden Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.900	500	0	JPY 7.815,000	94.860,41	0,04
JP3143900003	Itochu Techno-Solutions Corp. Reg.Shares		STK	1.600	1.600	0	JPY 4.315,000	44.106,56	0,02
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares		STK	16.800	1.600	900	JPY 4.486,000	481.471,92	0,20
JP3240400006	Kikkoman Corp. Reg.Shares		STK	2.400	0	0	JPY 8.634,000	132.381,01	0,06
JP3266400005	Kubota Corp. Reg.Shares		STK	16.000	0	0	JPY 2.122,500	216.955,22	0,09
JP3256000005	Kyowa Kirin Co. Ltd. Reg.Shares		STK	4.500	4.500	0	JPY 2.370,000	68.133,90	0,03
JP3626800001	LIXIL Corp. Reg.Shares		STK	4.600	4.600	0	JPY 1.760,500	51.736,41	0,02
JP3933800009	LY Corp. Reg.Shares		STK	45.000	12.200	0	JPY 499,700	143.656,17	0,06
JP3869010003	MatsukiyoCocokara & Co. Reg.Shares		STK	5.400	5.400	0	JPY 2.497,000	86.141,95	0,04
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Group Corp Reg.Shares		STK	22.000	5.300	0	JPY 864,000	121.433,59	0,05
JP3888300005	Mitsui Chemicals Inc. Reg.Shares		STK	2.600	2.600	0	JPY 4.182,000	69.464,00	0,03
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co. Ltd. Reg.Shares		STK	14.400	14.400	0	JPY 3.458,000	318.119,21	0,13
JP3733000008	NEC Corp. Reg.Shares		STK	3.900	3.900	0	JPY 8.350,000	208.043,19	0,09
JP3047550003	Nippon Prologis REIT Inc. Reg.Shares		STK	28	0	0	JPY 271.400,000	48.547,88	0,02

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
JP3762800005	Nomura Research Institute Ltd. Reg.Shares	STK		7.000	1.500	0	JPY 4.101,000	183.396,15	0,08
JP3197800000	Omron Corp. Reg.Shares	STK		2.800	0	0	JPY 6.583,000	117.756,34	0,05
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares	STK		5.600	5.600	0	JPY 2.516,000	90.012,14	0,04
JP3198900007	Oriental Land Co. Ltd. Reg.Shares	STK		14.900	14.900	0	JPY 5.251,000	499.839,65	0,21
JP3967200001	Rakuten Group Inc. Reg.Shares	STK		18.200	18.200	0	JPY 628,000	73.018,59	0,03
JP3164720009	Renasas Electronics Corp. Reg.Shares	STK		18.900	18.900	0	JPY 2.549,000	307.775,51	0,13
JP3421800008	Secom Co. Ltd. Reg.Shares	STK		3.400	3.400	0	JPY 10.155,000	220.577,53	0,09
JP3414750004	Seiko Epson Corp. Reg.Shares	STK		4.700	4.700	0	JPY 2.110,500	63.370,28	0,03
JP3162770006	SG Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK		5.300	1.600	0	JPY 2.024,000	68.531,27	0,03
JP3732000009	SoftBank Corp. Reg.Shares	STK		45.800	0	0	JPY 1.759,500	514.822,08	0,22
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares	STK		4.700	1.100	600	JPY 6.896,000	207.060,63	0,09
JP3435000009	Sony Group Corp. Reg.Shares	STK		5.500	0	500	JPY 13.410,000	471.187,63	0,20
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK		27.000	9.300	0	JPY 344,000	59.336,87	0,03
JP3402600005	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. Reg.Shares	STK		3.700	3.700	0	JPY 4.246,000	100.365,43	0,04
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group Reg.Shares	STK		13.800	1.800	4.000	JPY 6.880,000	606.554,65	0,26
JP3351100007	Sysmex Corp. Reg.Shares	STK		2.500	0	0	JPY 7.858,000	125.503,10	0,05
JP3538800008	TDK Corp. Reg.Shares	STK		6.300	6.300	0	JPY 6.717,000	270.344,98	0,11
JP3104890003	TIS Inc. Reg.Shares	STK		4.000	4.000	0	JPY 3.107,000	79.396,92	0,03
JP3597800006	Tobu Railway Co. Ltd. Reg.Shares	STK		3.100	3.100	0	JPY 3.789,000	75.039,29	0,03
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares	STK		26.200	26.200	0	JPY 3.529,000	590.684,21	0,25
JP3621000003	Toray Industries Inc. Reg.Shares	STK		22.000	0	0	JPY 733,100	103.035,84	0,04
JP3951600000	Unicharm Corp. Reg.Shares	STK		6.600	6.600	0	JPY 5.098,000	214.954,32	0,09
JP3942600002	Yamaha Corp. Reg.Shares	STK		2.600	1.000	0	JPY 3.257,000	54.099,53	0,02
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK		14.700	11.300	0	JPY 1.259,500	118.281,80	0,05
JP3940000007	Yamato Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK		4.800	4.800	0	JPY 2.605,500	79.897,78	0,03
JP3932000007	Yaskawa Electric Corp. Reg.Shares	STK		3.600	3.600	0	JPY 5.890,000	135.462,85	0,06
NOK								646.611,08	0,28
NO0010161896	DNB Bank ASA Navne-Aksjer	STK		14.307	0	0	NOK 215,200	273.402,40	0,12
NO0003054108	Mowi ASA Navne-Aksjer	STK		10.150	3.189	0	NOK 181,100	163.228,49	0,07
NO0003733800	Orkla ASA Navne-Aksjer	STK		13.977	0	0	NOK 78,680	97.653,94	0,04
NO0010063308	Telenor ASA Navne-Aksjer	STK		10.793	0	0	NOK 117,200	112.326,25	0,05
SEK								946.729,36	0,39
SE0015949748	Beijer Ref AB Namn-Aktier B	STK		6.325	6.325	0	SEK 136,200	77.889,09	0,03
SE0020050417	Boliden AB Namn-Aktier	STK		4.402	4.402	0	SEK 318,000	126.565,73	0,05
SE0009922164	Essity AB Namn-Aktier B	STK		9.485	0	0	SEK 249,600	214.052,79	0,09
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB Namn-Aktier B (fria)	STK		9.295	0	0	SEK 152,250	127.951,59	0,05
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A	STK		23.884	23.884	0	SEK 109,300	236.029,46	0,10
SE0005190238	Tele2 AB Namn-Aktier B	STK		8.835	0	0	SEK 86,440	69.049,46	0,03
SE0000667925	Telia Company AB Namn-Aktier	STK		41.014	0	0	SEK 25,670	95.191,24	0,04
USD								41.508.909,63	17,57
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares	STK		2.444	0	332	USD 595,520	1.315.840,23	0,56
US00766T1007	AECOM Reg.Shares	STK		900	900	0	USD 92,910	75.598,05	0,03
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK		1.610	0	0	USD 139,770	203.444,26	0,09
IE00BFR13W74	Allegion PLC Reg.Shares	STK		703	0	0	USD 126,860	80.627,95	0,03
US0258161092	American Express Co. Reg.Shares	STK		3.736	0	0	USD 187,800	634.319,50	0,27
US0304201033	American Water Works Co. Inc. Reg.Shares	STK		1.500	470	0	USD 132,980	180.336,32	0,08
US03076C1062	Ameriprise Financial Inc. Reg.Shares	STK		621	0	0	USD 381,150	213.989,83	0,09
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK		3.240	192	0	USD 288,460	844.960,13	0,36
JE00B783TY65	Aptiv PLC Reg.Shares	STK		1.931	0	0	USD 157,940	127.940,12	0,07
US0495601058	Atmos Energy Corp. Reg.Shares	STK		832	0	0	USD 116,080	87.314,49	0,04
US0527691069	Autodesk Inc. Reg.Shares	STK		1.275	1.275	0	USD 244,910	282.307,43	0,12
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares	STK		2.428	0	0	USD 232,490	510.338,78	0,22
US05352A1007	Avantor Inc. Reg.Shares	STK		4.400	4.400	0	USD 23,080	91.810,87	0,04
US0536111091	Avery Dennison Corp. Reg.Shares	STK		500	500	0	USD 202,780	91.664,41	0,04
US05464C1018	Axon Enterprise Inc. Reg.Shares	STK		450	450	0	USD 258,590	105.203,42	0,04
US0584981064	Ball Corp. Reg.Shares	STK		1.896	0	0	USD 57,950	99.333,88	0,04
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares	STK		1.780	251	0	USD 243,030	391.097,91	0,17
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares	STK		1.035	0	0	USD 78,460	73.416,60	0,03
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares	STK		862	0	0	USD 260,580	203.073,83	0,09
US09247X1019	Blackrock Inc. Reg.Shares	STK		881	0	0	USD 814,410	648.671,20	0,27
US09857L1089	Booking Holdings Inc. Reg.Shares	STK		230	230	0	USD 3.550,470	738.276,92	0,31
US1133T1034	Broadridge Financial Solutions Reg.Shares	STK		686	686	0	USD 205,830	127.655,17	0,05
US12008R1077	Builders Firstsource Inc. Reg.Shares	STK		797	797	0	USD 168,660	121.527,91	0,05
CHI300646267	Bunge Global S.A. Namens-Aktien	STK		965	965	0	USD 101,620	88.656,81	0,04
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)	STK		1.017	0	0	USD 86,890	79.890,72	0,03
US14448C1045	Carrier Global Corp. Reg.Shares	STK		4.939	0	0	USD 57,640	257.376,33	0,11
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		1.836	0	0	USD 93,820	155.730,51	0,07
US15135B1017	Centene Corp. Reg.Shares	STK		3.131	0	0	USD 73,890	209.157,93	0,09
US15677J1088	Ceridian HCM Holding Inc. Reg.Shares	STK		1.000	1.000	0	USD 67,990	61.468,22	0,03
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares	STK		2.550	257	0	USD 224,430	517.400,33	0,22
US1713401024	Church & Dwight Co. Inc. Reg.Shares	STK		1.508	1.508	0	USD 93,990	128.141,14	0,05
US2058871029	ConAgra Brands Inc. Reg.Shares	STK		3.319	0	0	USD 28,570	85.728,08	0,04
US2091151041	Consolidated Edison Inc. Reg.Shares	STK		2.000	0	0	USD 90,650	163.909,23	0,07
US2166484020	Cooper Companies Inc. Reg.Shares	STK		314	314	0	USD 379,370	107.695,67	0,05
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares	STK		808	0	0	USD 240,580	175.742,37	0,07
US2358511028	DanaHER Corp. Reg.Shares	STK		4.243	4.243	0	USD 233,130	894.286,76	0,38
US2372661015	Darling Ingredients Inc. Reg.Shares	STK		1.200	1.200	0	USD 50,220	54.483,32	0,02

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US2435371073	Deckers Outdoor Corp. Reg.Shares		STK	160	160	0	USD 675,520	97.715,58	0,04
US2600031080	Dover Corp. Reg.Shares		STK	970	0	0	USD 154,160	135.191,39	0,06
US2788651006	Ecolab Inc. Reg.Shares		STK	1.375	0	0	USD 198,870	247.216,57	0,10
US28176E1082	Edwards Lifesciences Corp. Reg.Shares		STK	3.860	0	0	USD 76,710	267.697,86	0,11
US2855121099	Electronic Arts Inc. Reg.Shares		STK	1.585	0	0	USD 136,760	195.971,97	0,08
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	1.500	110	0	USD 468,670	635.570,92	0,27
US29670G1022	Essential Utilities Inc. Reg.Shares		STK	1.200	0	0	USD 37,640	40.835,37	0,02
US30040W1080	Eversource Energy Reg.Shares		STK	1.885	0	0	USD 105,591,36	105.591,36	0,04
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares		STK	1.220	0	0	USD 127,580	140.717,48	0,06
US3030751057	FactSet Research Systems Inc. Reg.Shares		STK	240	0	0	USD 476,790	103.453,21	0,04
US3119001044	Fastenal Co. Reg.Shares		STK	3.072	0	0	USD 64,840	180.081,80	0,08
US31620M1062	Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Reg.Shares		STK	3.734	3.734	0	USD 60,800	205.250,16	0,09
US3377381088	Fiserv Inc. Reg.Shares		STK	3.691	3.691	0	USD 133,380	445.082,34	0,19
US34959J1088	Fortive Corp. Reg.Shares		STK	2.030	2.030	0	USD 73,580	135.039,69	0,06
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares		STK	4.095	849	0	USD 64,970	240.531,73	0,10
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	7.460	689	0	USD 81,140	547.242,02	0,23
US3841091040	Graco Inc. Reg.Shares		STK	966	966	0	USD 86,850	75.849,47	0,03
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	1.326	0	0	USD 270,480	324.253,21	0,14
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares		STK	787	0	0	USD 76,060	54.117,37	0,02
US43300A2033	Hilton Worldwide Holdings Inc. Reg.Shares		STK	1.476	0	0	USD 181,740	242.517,17	0,10
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	1.389	0	0	USD 71,260	89.485,71	0,04
US4456581077	Hunt (J.B.) Transport Svcs Inc Reg.Shares		STK	631	0	0	USD 201,860	115.155,65	0,05
US4461501045	Huntington Bancshares Inc. Reg.Shares		STK	8.991	0	0	USD 12,810	104.126,85	0,04
US45167R1041	IDEX Corp. Reg.Shares		STK	443	0	0	USD 217,060	86.933,89	0,04
US45168D1046	IDEXX Laboratories Inc. Reg.Shares		STK	453	0	0	USD 557,020	228.125,90	0,10
US4523081093	Illinois Tool Works Inc. Reg.Shares		STK	1.857	0	0	USD 261,880	439.662,92	0,19
US4523271090	Illumina Inc. Reg.Shares		STK	793	0	0	USD 142,130	101.897,74	0,04
US45687V1061	Ingersoll-Rand Inc. Reg.Shares		STK	2.678	0	0	USD 77,780	188.314,66	0,08
US45784P1012	Insulet Corporation Reg.Shares		STK	416	0	0	USD 219,430	82.526,79	0,03
US4601461035	International Paper Co. Reg.Shares		STK	2.115	0	0	USD 36,250	69.314,48	0,03
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares		STK	2.464	0	0	USD 32,940	73.378,68	0,03
US4595061015	Intl Flavors & Fragrances Inc. Reg.Shares		STK	1.372	0	0	USD 81,850	101.526,26	0,04
US4612021034	Intuit Inc. Reg.Shares		STK	1.631	1.631	0	USD 628,020	926.047,03	0,39
US8326964058	J.M. Smucker Co. Reg.Shares		STK	652	652	0	USD 125,780	74.142,08	0,03
IE00BY7QL619	Johnson Controls Internat. PLC Reg.Shares		STK	3.682	0	0	USD 57,700	192.072,51	0,08
US4878361082	Kellanova Co. Reg.Shares		STK	1.532	0	0	USD 55,620	77.036,29	0,03
US4990491049	Knight-Swift Transp. Hldgs Inc Reg.Shs Cl.A		STK	900	0	0	USD 58,410	47.526,44	0,02
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares		STK	612	0	0	USD 227,060	125.631,24	0,05
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares		STK	855	855	0	USD 789,670	610.403,99	0,26
US5132721045	Lamb Weston Holdings Inc. Reg.Shares		STK	903	903	0	USD 108,130	88.275,37	0,04
US5218652049	Lear Corp. Reg.Shares		STK	500	500	0	USD 141,770	64.085,53	0,03
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares		STK	190	0	0	USD 447,380	76.848,57	0,03
BMG611881274	Liberty Global Ltd. Reg.Shares C		STK	4.200	4.200	0	USD 18,530	70.360,73	0,03
US5018892084	LKQ Corp. Reg.Shares		STK	1.659	0	0	USD 47,890	71.828,51	0,03
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares		STK	3.686	0	0	USD 222,900	742.798,48	0,31
US57060D1081	MarketAxess Holdings Inc. Reg.Shares		STK	210	0	0	USD 296,420	56.277,19	0,02
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	2.951	0	0	USD 188,790	503.678,95	0,21
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	127	0	0	USD 1.225,260	140.681,69	0,06
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	7.250	0	520	USD 375,280	2.459.795,68	1,04
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	360	360	0	USD 356,420	116.003,25	0,05
US6153691059	Moody's Corp. Reg.Shares		STK	895	0	0	USD 390,630	316.077,98	0,13
US6311031081	Nasdaq Inc. Reg.Shares		STK	2.317	2.317	0	USD 58,240	121.998,08	0,05
US6658591044	Northern Trust Corp. Reg.Shares		STK	1.054	0	0	USD 84,960	80.958,18	0,03
NL0009538784	NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder		STK	1.503	1.503	0	USD 231,070	313.984,46	0,13
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc. Reg.Shares		STK	607	0	0	USD 411,060	225.579,44	0,10
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	630	0	0	USD 148,750	84.723,35	0,04
US70438V1061	Paylocity Holding Corp. Reg.Shares		STK	400	400	0	USD 167,230	60.475,54	0,03
IE00BLS09M33	Pentair PLC Reg.Shares		STK	1.500	1.005	0	USD 73,000	98.996,47	0,04
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares		STK	8.331	460	0	USD 169,390	1.275.823,24	0,54
US6934751057	PNC Financial Services Group Reg.Shares		STK	2.567	0	0	USD 155,630	361.180,91	0,15
US73278L1052	Pool Corp. Reg.Shares		STK	295	0	0	USD 402,390	107.318,55	0,05
US6935061076	PPG Industries Inc. Reg.Shares		STK	1.275	0	0	USD 150,380	173.342,83	0,07
US7433151039	Progressive Corp. Reg.Shares		STK	3.650	3.650	0	USD 158,340	522.503,39	0,22
US7443201022	Prudential Financial Inc. Reg.Shares		STK	1.994	0	0	USD 104,230	187.898,58	0,08
US74762E1029	Quanta Services Inc. Reg.Shares		STK	933	0	0	USD 216,470	182.593,36	0,08
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares		STK	715	0	0	USD 137,660	88.985,53	0,04
US7591EP1005	Regions Financial Corp. Reg.Shares		STK	5.353	0	0	USD 19,550	94.612,74	0,04
US7599161095	RepliGen Corp. Reg.Shares		STK	450	450	0	USD 185,350	75.406,83	0,03
US76954A1034	Rivian Automotive Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	2.800	0	0	USD 23,540	59.589,55	0,03
US7739031091	Rockwell Automation Inc. Reg.Shares		STK	636	0	0	USD 310,620	178.604,39	0,08
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares		STK	1.963	0	0	USD 441,840	784.135,18	0,33
US8574771031	State Street Corp. Reg.Shares		STK	1.975	1.975	0	USD 78,420	140.023,05	0,06
US8581191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares		STK	1.005	0	0	USD 119,080	108.195,82	0,05
IE00BFY8C754	Steris PLC Reg.Shares		STK	585	0	0	USD 221,740	117.275,02	0,05
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares		STK	2.600	2.600	0	USD 38,370	90.192,57	0,04
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares		STK	1.340	0	0	USD 109,010	132.061,66	0,06
US8740541094	Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares		STK	1.020	0	0	USD 161,470	148.901,00	0,06
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares		STK	9.250	600	200	USD 253,180	2.117.272,40	0,90
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares		STK	5.700	396	0	USD 171,720	884.914,56	0,37

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US0640581007	The Bk of New York Mellon Corp. Reg.Shares		STK	4.368	0	0	USD 52,220	206.217,30	0,09
US1255231003	The Cigna Group Reg.Shares		STK	1.745	0	0	USD 299,400	472.337,94	0,20
US1890541097	The Clorox Co. Reg.Shares		STK	666	0	0	USD 142,060	85.536,53	0,04
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares		STK	24.907	1.500	0	USD 58,750	1.322.924,01	0,56
US4165151048	The Hartford Finl SvcsGrp Inc. Reg.Shares		STK	1.914	1.914	0	USD 80,420	139.159,10	0,06
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	6.057	210	0	USD 347,360	1.902.142,23	0,81
US89417E1091	The Travelers Companies Inc. Reg.Shares		STK	1.307	0	0	USD 189,330	223.717,85	0,09
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares		STK	10.933	0	0	USD 90,400	893.538,74	0,38
US8910921084	Toro Co. Reg.Shares		STK	700	700	0	USD 96,850	61.291,93	0,03
US8923561067	Tractor Supply Co. Reg.Shares		STK	684	0	0	USD 215,900	133.510,17	0,06
IE00BK9ZQ967	Trane Technologies PLC Reg.Shares		STK	1.239	0	0	USD 243,810	273.104,23	0,12
US89832Q1094	Truist Financial Corp. Reg.Shares		STK	8.483	0	0	USD 37,290	285.987,77	0,12
US9029733048	U.S. Bancorp Reg.Shares		STK	8.609	8.609	0	USD 43,630	339.581,11	0,14
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares		STK	456	0	0	USD 578,690	238.570,33	0,10
US91879Q1094	Vail Resorts Inc. Reg.Shares		STK	183	0	0	USD 218,230	36.105,32	0,02
US91913Y1001	Valero Energy Corp. Reg.Shares		STK	2.292	0	300	USD 130,090	269.565,39	0,11
US92338C1036	Veralto Corp. Reg.Shares		STK	1.414	1.414	0	USD 83,040	106.155,47	0,04
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	26.378	26.378	0	USD 37,490	894.052,27	0,38
US92942W1071	W.K. Kellogg Co. Reg.Shares		STK	383	383	0	USD 13,140	4.549,88	0,00
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	230	0	0	USD 827,100	171.985,35	0,07
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares		STK	421	0	0	USD 332,770	126.657,78	0,05
US95040Q1040	Welltower Inc. Reg.Shares		STK	2.870	0	0	USD 91,160	236.533,04	0,10
US9553061055	West Pharmaceutic.Services Inc Reg.Shares		STK	400	0	0	USD 354,930	128.353,68	0,05
US98138H1014	Workday Inc. Reg.Shares A		STK	1.220	1.220	0	USD 276,080	304.509,18	0,13
US98419M1009	Xylem Inc. Reg.Shares		STK	1.312	0	0	USD 114,320	135.600,61	0,06
US98956P1021	Zimmer Biomet Holdings Inc. Reg.Shares		STK	1.174	1.174	0	USD 121,630	129.096,48	0,05
US98978V1035	Zoetis Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	2.537	0	0	USD 197,160	452.214,92	0,19
Verzinsliche Wertpapiere								39.786.750,79	16,84
EUR								38.838.894,33	16,44
FR0014006ND8	2,3750 % ACCOR S.A. Bonds 21/28		EUR	400.000	400.000	0	% 95,875	383.500,00	0,16
FR0013457157	2,6250 % ACCOR S.A. FLR Bonds 19/Und.		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 98,050	980.500,00	0,42
ES0200002071	3,5000 % Adif - Alta Velocidad MTN 22/29		EUR	200.000	0	0	% 102,118	204.235,00	0,09
XS2596537972	3,5000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Notes 23/28		EUR	200.000	200.000	0	% 102,178	204.355,00	0,09
XS2230399441	2,8750 % AIB Group PLC FLR MTN 20/31		EUR	340.000	340.000	0	% 95,956	326.250,40	0,14
XS2531420730	2,6250 % Alliander N.V. MTN 22/27		EUR	200.000	0	0	% 99,558	199.116,00	0,08
XS2590758822	4,3000 % AT & T Inc. Notes 23/34		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 105,934	1.059.340,00	0,45
FR0014006G24	1,0000 % Atos SE Obl. 21/29		EUR	500.000	500.000	0	% 54,500	272.500,00	0,12
XS2545206166	4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/29		EUR	500.000	0	0	% 106,355	531.772,50	0,23
XS2530053789	6,0000 % Banco BPM S.p.A. Non-Pref. MTN 22/26		EUR	300.000	300.000	0	% 105,582	316.746,00	0,13
XS2365097455	0,8750 % Banco BPM S.p.A. Preferred MTN 21/26		EUR	360.000	360.000	0	% 93,840	337.824,00	0,14
PTBCPEOM0069	1,7500 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR Pref. MTN 21/28 ¹⁾		EUR	400.000	400.000	0	% 93,584	374.336,00	0,16
XS2353366268	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28		EUR	300.000	300.000	0	% 90,401	271.203,00	0,11
XS2455392584	2,6250 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26		EUR	300.000	300.000	0	% 98,069	294.205,50	0,12
XS2553801502	5,1250 % Banco de Sabadell S.A. FLR Preferred MTN 22/28		EUR	300.000	300.000	0	% 105,239	315.717,00	0,13
XS2357417257	0,6250 % Banco Santander S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/29		EUR	400.000	0	0	% 88,648	354.592,00	0,15
XS2340236327	1,3750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 21/31		EUR	370.000	370.000	0	% 93,403	345.589,25	0,15
XS2535283548	8,0000 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 22/26		EUR	300.000	300.000	0	% 104,250	312.750,00	0,13
XS2363719050	1,2500 % Bca Pop. di Sondrio S.c.p.A. FLR MTN 21/27		EUR	360.000	360.000	0	% 93,216	335.577,60	0,14
FR0013465358	0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 19/26		EUR	300.000	0	0	% 95,693	287.077,50	0,12
FR0014006N17	0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28 ¹⁾		EUR	400.000	0	0	% 90,638	362.552,00	0,15
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27 ¹⁾		EUR	32.000	0	0	% 94,785	30.331,20	0,01
DE0001102481	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 19/50		EUR	30.000	0	0	% 55,971	16.791,15	0,01
DE0001030708	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30		EUR	200.000	0	0	% 88,499	176.998,00	0,07
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24		EUR	20.000	0	0	% 97,522	19.504,30	0,01
DE0001104867	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 21/23 ²⁾		EUR	4.500.000	4.500.000	0	% 100,000	4.500.000,00	1,92
FR001400D0F9	4,1250 % Carrefour S.A. MTN 22/28		EUR	400.000	0	0	% 104,335	417.340,00	0,18
XS2533012790	2,7500 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 22/25		EUR	500.000	0	0	% 99,111	495.552,50	0,21
XS2443438051	1,3750 % Danske Bank AS FLR Non-Pref. MTN 22/27		EUR	500.000	0	0	% 95,345	476.725,00	0,20

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2534985523	3,1250 % DNB Bank ASA FLR Preferred MTN 22/27		EUR	200.000	0	0	% 99,741	199.481,00	0,08
XS2103014291	0,3750 % E.ON SE MTN 20/27		EUR	300.000	0	0	% 91,453	274.359,00	0,12
XS2327420977	0,6000 % E.ON SE MTN 21/32		EUR	400.000	0	0	% 81,537	326.148,00	0,14
XS2542914986	3,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/30		EUR	400.000	0	0	% 103,765	415.060,00	0,18
XS2695011978	4,0000 % Elisa Oyj MTN 23/29		EUR	350.000	350.000	0	% 103,711	362.986,75	0,15
XS1937665955	1,5000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 19/25		EUR	500.000	0	0	% 97,129	485.642,50	0,21
XS2390400716	0,3750 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 21/29		EUR	500.000	0	0	% 86,294	431.470,00	0,18
XS2432544349	1,0000 % ESB Finance DAC MTN 22/34		EUR	150.000	0	0	% 80,726	121.088,25	0,05
XS2532681074	3,7500 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA MTN 22/27		EUR	775.000	0	0	% 101,098	783.509,50	0,33
BE0002889716	3,2500 % Flaemische Gemeinschaft MTN 22/43		EUR	500.000	0	0	% 99,505	497.522,50	0,21
XS2530219349	2,6250 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 22/27		EUR	400.000	0	0	% 99,584	398.334,00	0,17
XS2613472963	4,2500 % Hera S.p.A. MTN 23/33		EUR	200.000	200.000	0	% 104,085	208.169,00	0,09
FI4000523550	4,2500 % Hultamaeki Oyj Notes 22/27		EUR	300.000	300.000	0	% 100,412	301.234,50	0,13
XS2580221658	4,8750 % Iberdrola Finanzas S.A. FLR MTN 23/Und.		EUR	900.000	900.000	0	% 100,750	906.750,00	0,38
XS2407593222	2,1250 % ICCREA Banca - Ist.C.d.Cred.C. FLR Pref. MTN 21/27		EUR	350.000	350.000	0	% 96,288	337.008,00	0,14
XS2592650373	5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Non-Pref.MTN 23/28 ¹⁾		EUR	525.000	1.025.000	500.000	% 103,301	542.330,25	0,23
XS2534891978	3,2500 % Knorr-Bremse AG MTN 22/27		EUR	500.000	0	0	% 100,990	504.950,00	0,21
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25 ¹⁾		EUR	140.000	0	0	% 97,335	136.269,00	0,06
BE0000341504	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.81 17/27		EUR	100.000	0	0	% 95,256	95.256,00	0,04
BE0000346552	1,2500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.86 18/33		EUR	250.000	0	0	% 89,657	224.141,25	0,09
NL0013552060	0,5000 % Königreich Niederlande Anl. 19/40		EUR	40.000	0	0	% 74,182	29.672,60	0,01
FR00140044X1	0,7500 % La Banque Postale Non-Pref. MTN 21/31		EUR	200.000	0	0	% 82,296	164.592,00	0,07
FR001400CN47	2,6250 % La Poste MTN 22/28		EUR	500.000	0	0	% 99,255	496.275,00	0,21
XS2148623106	3,5000 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 20/26		EUR	500.000	0	0	% 99,757	498.782,50	0,21
XS2238789460	0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 20/28		EUR	800.000	0	0	% 89,248	713.984,00	0,30
DE000A289RN6	2,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. MTN 20/25		EUR	250.000	0	0	% 99,108	247.770,00	0,10
XS2237982769	2,7500 % National Bank of Greece S.A. FLR Pref. MTN 20/26		EUR	340.000	340.000	0	% 97,932	332.967,10	0,14
XS2488809612	4,3750 % Nokia Oyj MTN 23/31		EUR	275.000	275.000	0	% 100,748	277.055,63	0,12
XS2443893255	1,1250 % Nordea Bank Abp Non Preferred MTN 22/27		EUR	400.000	0	0	% 94,033	376.130,00	0,16
XS2171253912	0,5000 % OP Yrityspankki Oyj Preferred MTN 20/25		EUR	400.000	0	0	% 95,605	382.420,00	0,16
FR001400GDJ1	5,3750 % Orange S.A. FLR MTN 23/Und.		EUR	100.000	100.000	0	% 105,205	105.205,00	0,04
XS2346125573	1,1250 % Orlen S.A. MTN 21/28		EUR	100.000	0	0	% 90,526	90.526,00	0,04
XS2047619064	0,6250 % PostNL N.V. Notes 19/26		EUR	500.000	0	0	% 92,620	463.100,00	0,20
XS2625194811	4,6250 % Prologis Euro Finance LLC Notes 23/33		EUR	400.000	400.000	0	% 107,020	428.080,00	0,18
IE00BDHDP144	0,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 18/28		EUR	36.000	0	0	% 95,270	34.297,02	0,01
IE00BKFCV899	0,2000 % Republik Irland Treasury Bonds 20/30		EUR	75.000	0	0	% 87,270	65.452,50	0,03
IE00BKFCV345	0,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 20/35		EUR	70.000	0	0	% 79,723	55.805,75	0,02
XS2636439684	4,0000 % Republik Kroatien Notes 23/35		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 106,950	1.069.500,00	0,45
XS2420426038	0,2500 % Republik Lettland MTN 21/30		EUR	175.000	0	0	% 84,081	147.141,75	0,06
AT0000A269M8	0,5000 % Republik Österreich MTN 19/29		EUR	55.000	0	0	% 91,344	50.239,20	0,02
AT0000A2EJ08	0,7500 % Republik Österreich MTN 20/51		EUR	150.000	0	0	% 60,994	91.491,00	0,04
SI0002103842	1,1875 % Republik Slowenien Bonds 19/29		EUR	70.000	0	0	% 92,855	64.998,50	0,03
SI0002103990	0,8750 % Republik Slowenien Bonds 20/30		EUR	220.000	0	0	% 88,933	195.652,60	0,08
SI0002104196	0,1250 % Republik Slowenien Bonds 21/31		EUR	1.000.000	0	0	% 82,534	825.340,00	0,35
XS2610236445	4,1250 % Republik Zypern MTN 23/33		EUR	140.000	840.000	700.000	% 108,569	151.996,60	0,06
FR001400H5F4	3,3750 % Schneider Electric SE MTN 23/25		EUR	400.000	400.000	0	% 100,103	400.412,00	0,17
SK4120010430	1,3750 % Slowakei Anl. 15/27		EUR	90.000	0	0	% 96,245	86.620,50	0,04
SK4000017158	0,2500 % Slowakei Anl. 20/25		EUR	1.000.000	0	0	% 96,360	963.600,00	0,41
SK4000017166	1,0000 % Slowakei Anl. 20/32		EUR	70.000	0	0	% 84,885	59.419,50	0,03
SK4000022547	4,0000 % Slowakei Anl. 23/43		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 105,095	1.050.950,00	0,45
XS2532312548	2,8750 % Statkraft AS MTN 22/29		EUR	500.000	0	0	% 100,374	501.870,00	0,21
XS2550868801	5,1250 % Suedzucker Intl Finance B.V. Sustain.Lkd Nts 22/27		EUR	400.000	0	0	% 105,700	422.800,00	0,18
FR001400AFL5	1,8750 % Suez S.A. MTN 22/27		EUR	400.000	0	0	% 95,758	383.030,00	0,16
XS2348325494	0,5000 % TenneT Holding B.V. MTN 21/31		EUR	100.000	0	0	% 89,536	89.535,50	0,04
XS2477935345	1,6250 % TenneT Holding B.V. MTN 22/26		EUR	375.000	0	0	% 98,028	367.603,13	0,16
XS2549543143	3,8750 % TenneT Holding B.V. MTN 22/28		EUR	500.000	0	0	% 104,647	523.232,50	0,22
XS2437854487	2,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA FLR Nts 22/Und.		EUR	370.000	370.000	0	% 89,875	332.537,50	0,14

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CH0409606354	1,2500 % UBS Group AG FLR Notes 18/25		EUR	400.000	0	0	% 99,086	396.342,00	0,17
XS2181689659	1,7500 % Ungarn Bonds 20/35		EUR	1.000.000	0	0	% 76,875	768.750,00	0,33
ES0380907065	7,2500 % Unicaja Banco S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/27		EUR	300.000	300.000	0	% 105,621	316.861,50	0,13
XS2360310044	0,8000 % UniCredit Sp.A. FLR Preferred MTN 21/29		EUR	1.000.000	0	0	% 89,029	890.290,00	0,38
XS2237434803	3,2500 % Unipol Gruppo S.p.A. MTN 20/30		EUR	330.000	330.000	0	% 98,524	325.127,55	0,14
XS2478685931	2,2500 % UPM Kymmene Corp. MTN 22/29		EUR	400.000	0	0	% 95,631	382.522,00	0,16
FR0014004UE6	1,0000 % Valéo S.E. MTN 21/28		EUR	400.000	400.000	0	% 87,567	350.268,00	0,15
FR0014003G27	1,6250 % Verallia SA Notes 21/28		EUR	400.000	400.000	0	% 93,830	375.320,00	0,16
FR0014006EGO	1,8750 % Verallia SA Notes 21/31		EUR	300.000	300.000	0	% 88,075	264.225,00	0,11
XS2630490717	6,5000 % Vodafone Group PLC FLR MTN 23/84		EUR	250.000	250.000	0	% 107,125	267.812,50	0,11
XS2582404724	5,7500 % ZF Finance GmbH MTN 23/26		EUR	200.000	200.000	0	% 103,300	206.600,00	0,09
GBP								609.731,52	0,26
XS2636324274	8,3750 % British Telecommunications PLC FLR MTN 23/83		GBP	500.000	500.000	0	% 105,875	609.731,52	0,26
USD								338.124,94	0,14
USG15820EA02	4,2500 % British Telecommunications PLC FLR Nts 21/81 Reg.S		USD	400.000	400.000	0	% 93,500	338.124,94	0,14
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								17.177.402,39	7,28
Verzinsliche Wertpapiere								17.177.402,39	7,28
EUR								14.588.513,50	6,18
DE000A30VPL3	3,4500 % Amprion GmbH MTN 22/27		EUR	500.000	0	0	% 100,945	504.725,00	0,21
XS2079716853	0,0000 % Apple Inc. Notes 19/25		EUR	600.000	0	0	% 94,847	569.079,00	0,24
XS2114413565	2,8750 % AT & T Inc. FLR Pref.Secs 20/Und.		EUR	400.000	400.000	0	% 96,375	385.500,00	0,16
XS2558591967	6,0000 % Banco BPM S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 22/28		EUR	310.000	310.000	0	% 104,855	325.050,50	0,14
XS2335148024	3,1250 % Constellium SE Notes 21/29 Reg.S		EUR	380.000	380.000	0	% 92,200	350.360,00	0,15
XS2351382473	2,2500 % Derichebourg S.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	360.000	360.000	0	% 94,000	338.400,00	0,14
XS2354685575	0,3610 % EEW Energy from Waste GmbH Anl. 21/26		EUR	200.000	0	0	% 91,465	182.930,00	0,08
DE000A30VPZ3	2,5000 % Emissionskons.Landesfoerderins. IHS 22/29		EUR	1.300.000	0	0	% 100,035	1.300.455,00	0,55
XS2405483301	2,7500 % Forvia SE Notes 21/27		EUR	360.000	360.000	0	% 96,000	345.600,00	0,15
XS2312733871	2,3750 % Forvia SE Notes 21/29		EUR	390.000	390.000	0	% 91,375	356.362,50	0,15
XS2553825949	7,2500 % Forvia SE Notes 22/26		EUR	300.000	300.000	0	% 106,250	318.750,00	0,14
XS2247623643	3,5000 % Getlink SE Notes 20/25 Reg.S		EUR	320.000	320.000	0	% 99,300	317.760,00	0,13
XS2326548562	2,5000 % Hapag-Lloyd AG Anl. 21/28 Reg.S		EUR	350.000	350.000	0	% 92,750	324.625,00	0,14
XS2649707846	9,3750 % HT Troplast GmbH Anl. 23/28 Reg.S		EUR	1.000.000	1.550.000	550.000	% 102,375	1.023.750,00	0,43
XS2486270858	6,0000 % Kon. KPN N.V. FLR Notes 22/Und.		EUR	310.000	310.000	0	% 103,875	322.012,50	0,14
XS2337604479	2,2500 % Mytilineos S.A. Notes 21/26		EUR	340.000	340.000	0	% 95,875	325.975,00	0,14
XS2369906644	0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33		EUR	300.000	0	0	% 79,622	238.864,50	0,10
XS2077666316	2,8750 % OI European Group B.V. Notes 19/25 Reg.S		EUR	320.000	320.000	0	% 99,075	317.040,00	0,13
XS2400040460	3,8750 % Piraeus Bank SA FLR MTN 21/27		EUR	360.000	360.000	0	% 96,350	346.860,00	0,15
XS2485265214	3,1250 % ProLogis Intl Funding II S.A. MTN 22/31		EUR	500.000	0	0	% 96,640	483.200,00	0,20
XS2552369469	4,6250 % Redeia Corporacion S.A. FLR Notes 23/Und.		EUR	300.000	300.000	0	% 102,000	306.000,00	0,13
XS2619991883	6,5000 % Republik San Marino Obbl. 23/27		EUR	1.250.000	1.425.000	175.000	% 103,048	1.288.100,00	0,55
XS2332306344	2,1250 % Rexel S.A. Notes 21/28		EUR	350.000	350.000	0	% 94,400	330.400,00	0,14
XS2403428472	2,1250 % Rexel S.A. Notes 21/28		EUR	350.000	350.000	0	% 93,375	326.812,50	0,14
XS2646608401	6,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 23/Und.		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 107,125	1.392.625,00	0,59
XS2462605671	7,1250 % Telefónica Europe B.V. FLR Notes 22/Und.		EUR	500.000	500.000	0	% 108,865	544.325,00	0,23
XS2240978085	2,5000 % Volvo Car AB MTN 20/27		EUR	350.000	350.000	0	% 95,100	332.850,00	0,14
XS2486825669	4,2500 % Volvo Car AB MTN 22/28 ¹⁾		EUR	330.000	330.000	0	% 101,125	333.712,50	0,14
XS2431015655	3,5000 % VZ Secured Financing B.V. Notes 22/32 Reg.S		EUR	380.000	380.000	0	% 88,540	336.452,00	0,14
XS2272845798	2,8750 % VZ Vendor Financing II B.V. Notes 20/29 Reg.S		EUR	390.000	390.000	0	% 88,625	345.637,50	0,15
XS2437324333	3,8750 % Webuild S.p.A. Notes 22/26		EUR	380.000	380.000	0	% 98,500	374.300,00	0,16
USD								2.588.888,89	1,10
US594918AR51	3,5000 % Microsoft Corp. Notes 12/42		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 88,416	1.598.698,13	0,68
US92857WBW91	4,1250 % Vodafone Group PLC FLR Notes 21/81		USD	1.300.000	1.300.000	0	% 84,250	990.190,76	0,42
Nichtnotierte Wertpapiere								0,00	0,00
Aktien								0,00	0,00
USD								0,00	0,00
US003CVR0169	Abiomed Inc. Reg.Shares		STK	276	276	0	USD 0,000	0,00	0,00
Wertpapier-Investmentanteile								83.255.126,13	35,32
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								83.255.126,13	35,32
EUR								32.784.676,00	13,91

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.		ANT	1.000	684.000	3.878.000	EUR 5,177	5.176,60	0,00
IE00BYVJRP78	iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares		ANT	1.374.000	550.000	1.000.000	EUR 6,250	8.587.500,00	3,65
IE00BYZTVT56	iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares		ANT	5.101.000	5.100.000	0	EUR 4,708	24.017.548,40	10,19
IE00B52VJ196	iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)		ANT	900	50.000	54.100	EUR 64,390	57.951,00	0,02
LU0514695690	xtrackers MSCI China 1C		ANT	10.000	550.000	540.000	EUR 11,650	116.500,00	0,05
USD								50.470.450,13	21,41
LU1806495575	AIS-Amun.Idx US Corp. SRI A.N.UCIT.ETF USD A.N		ANT	718.000	320.000	0	USD 57,045	37.029.481,96	15,70
IE00BFZPF322	In.M.I Invesco AT1 Cap Bd ETF Reg.Shs Acc.		ANT	100	0	96.900	USD 24,295	2.196,46	0,00
IE00BKF09C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	1.000	550.000	3.049.000	USD 4,545	4.109,39	0,00
IE00BLRPRF81	L&G ESG Em.Mkts Corp.Bd ETF Reg.Shs Dis.		ANT	850.000	0	0	USD 8,664	6.657.987,52	2,83
IE00B4613386	SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist)		ANT	128.000	90.000	0	USD 58,560	6.776.674,80	2,88
Summe Wertpapiervermögen							EUR	231.997.073,75	98,29
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								255.845,44	0,11
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) März 24			XEUR	EUR	Anzahl 550			-137.500,00	-0,06
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) März 24			XCME	USD	Anzahl 50			70.134,95	0,03
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) März 24			XCME	USD	Anzahl 30			154.371,21	0,07
Mini Sized DJIA Index Future (1YM) März 24			XCBT	USD	Anzahl 25			168.839,28	0,07
Summe Aktienindex-Derivate							EUR	255.845,44	0,11
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								-96.821,33	-0,04
EURO Bund Future (FGBL) März 24			XEUR	EUR	-10.000.000			-23.500,00	-0,01
EURO Buxl Future (FGBX) März 24			XEUR	EUR	-4.000.000			29.800,00	0,01
Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) März 24			XCBT	USD	-20.000.000			-103.121,33	-0,04
Summe Zins-Derivate							EUR	-96.821,33	-0,04
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)								20.601,01	0,01
Offene Positionen									
CHF/EUR 3.860.000,00			OTC					132.183,86	0,06
USD/EUR 19.900.000,00			OTC					-111.582,85	-0,05
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								485.658,74	0,21
Offene Positionen									
CHF/EUR 7.571.478,78			OTC					-266.916,09	-0,12
DKK/EUR 12.250.000,00			OTC					1.178,94	0,00
GBP/EUR 3.425.000,00			OTC					-23.604,69	-0,01
JPY/EUR 1.705.000.000,00			OTC					15.596,34	0,01
JPY/USD 730.000.000,00			OTC					-42.368,42	-0,02
USD/EUR 60.376.734,00			OTC					801.772,66	0,35
Summe Devisen-Derivate							EUR	506.259,75	0,22
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsswaps (Erhalten/Zahlen)								-4.429.198,79	-1,88
IRS 0.414% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 21.12.2025			OTC	USD	200.000			-13.820,98	-0,01
IRS 0.495% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 22.12.2025			OTC	USD	200.000			-13.522,02	-0,01
IRS 0.622% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 21.12.2027			OTC	USD	130.000			-14.312,44	-0,01
IRS 0.884% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 21.12.2030			OTC	USD	150.000			-24.135,77	-0,01
IRS 1.21% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 22.10.2026			OTC	USD	2.900.000			-222.299,65	-0,09
IRS 1.353% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 21.12.2050			OTC	USD	150.000			-53.405,68	-0,02
IRS 1.435% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 22.10.2028			OTC	USD	1.500.000			-153.374,59	-0,06
IRS 1.59% USD / SOFR USD / BNP_PAR 01.02.2032			OTC	USD	8.000.000			-1.194.210,58	-0,51
IRS 1.628% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 22.10.2031			OTC	USD	1.000.000			-136.626,21	-0,06
IRS 1.6531% USD / SOFR USD / BNP_PAR 01.02.2052			OTC	USD	4.000.000			-1.193.725,05	-0,51
IRS 1.847% USD / SOFR + 0,26161 USD / DGZ_FRA 22.10.2051			OTC	USD	2.650.000			-758.262,80	-0,32
IRS 2.2295% USD / SOFR USD / JPMORGAN_FRA 04.04.2024			OTC	USD	11.200.000			-316.248,17	-0,13
IRS 2.5275% USD / SOFR USD / BNP_PAR 27.04.2024			OTC	USD	13.000.000			-335.254,85	-0,14
Summe Swaps							EUR	-4.429.198,79	-1,88

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei									
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	8.112,45			% 100,000	8.112,45	0,00
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CZK	8.929,81			% 100,000	361,57	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	37.465,54			% 100,000	5.026,50	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	145.882,75			% 100,000	12.954,34	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		PLN	0,20			% 100,000	0,05	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	64.162,68			% 100,000	5.801,25	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	8.166,23			% 100,000	5.036,61	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	186,68			% 100,000	127,49	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	7.074,94			% 100,000	7.601,66	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	48.832,60			% 100,000	56.245,15	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	3.855.054,49			% 100,000	446.184,28	0,19
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	12.626.416,00			% 100,000	80.664,51	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		MXN	100.574,80			% 100,000	5.369,79	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	69.302,63			% 100,000	39.693,36	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		ZAR	121,21			% 100,000	5,91	0,00
	Summe Bankguthaben³⁾						EUR	673.184,92	0,27
	Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR	673.184,92	0,27
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	667.222,44				667.222,44	0,28
	Dividendenansprüche		EUR	63.920,64				63.920,64	0,03
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	3.676.130,11				3.676.130,11	1,56
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	328,35				328,35	0,00
	Forderungen aus Anteilschneingeschäften		EUR	13.215,94				13.215,94	0,01
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	35.976,40				35.976,40	0,02
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	4.060.000,00				4.060.000,00	1,73
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	8.516.793,88	3,63
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
EUR-Kredite bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	-1.041.503,97			% 100,000	-1.041.503,97	-0,44
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	-73.694,80			% 100,000	-66.625,80	-0,03
	Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						EUR	-1.108.129,77	-0,47
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-108,36				-108,36	0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften		EUR	-73.654,45				-73.654,45	-0,03
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-232.394,71				-232.394,71	-0,10
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-306.157,52	-0,13
Fondsvermögen									
	Umlaufende Anteile Klasse CF						EUR	236.008.850,33	100,00
	Umlaufende Anteile Klasse TF						STK	1.954.437,000	
	Anteilwert Klasse CF						STK	359.201,000	
	Anteilwert Klasse TF						EUR	102,26	
							EUR	100,62	

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

¹⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

²⁾ Die Anleihe ist seit längerer Zeit endfällig / ausgefallen. Sie wird in der Vermögensaufstellung ausgewiesen, um etwaige Forderungen, die als werthaltig erachtet werden, sichtbar zu machen.

³⁾ Diese Bankguthaben sind ganz oder teilweise als Sicherheit für sonstige Derivate an einen Dritten übertragen.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
Umicore S.A. Actions Nom.	STK 4,000		99.840,00	
1,7500 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR Pref. MTN 21/28	EUR 400.000		374.336,00	
0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28	EUR 300.000		271.914,00	
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR 32.000		30.331,20	
5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Non-Pref.MTN 23/28	EUR 200.000		206.602,00	
0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25	EUR 140.000		136.269,00	
4,2500 % Volvo Car AB MTN 22/28	EUR 300.000		303.375,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		1.422.667,20	1.422.667,20

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.12.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,86821	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45360	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,26130	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,06015	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,93071	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,34440	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	24,69750	= 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	20,52645	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10610	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46423	= 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso	(MXN)	18,72975	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	156,53000	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,64005	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,62138	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,74595	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
CHF				
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien	STK	0	495
DKK				
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK	0	147
DK0060738599	Demant AS Navne Aktier A	STK	0	1650
EUR				
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK	0	6.921
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK	0	113.031
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien	STK	0	1.598
FR0006174348	Bureau Veritas SA Actions au Porteur	STK	0	4.736
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien	STK	0	700
ES0105563003	Corporacion Acciona Energias R Acciones Port.	STK	1.234	1.234
FR0000064578	Covivio S.A. Actions Port.	STK	0	815
IE0001827041	CRH PLC Reg.Shares	STK	0	13.400
BE0974259880	D'leteren Group S.A. Parts Sociales au Port.	STK	0	420
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port.	STK	102	5.169
NL0010801007	IMCD N.V. Aandelen op naam	STK	0	1.015
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK	1.800	18.223
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK	0	287.000
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.V. Reg.Shares	STK	0	3.200
FR0000121964	Klépierre S.A. Actions Port.	STK	0	3.650
FI0009014377	Orion Corp. Reg.Shares Cl.B	STK	0	1.720
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK	0	3.900
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien	STK	0	16.674
FR0000127771	Vivendi SE Actions Porteur	STK	0	11.223
GBP				
GB00B0744B38	Bunzl PLC Reg.Shares	STK	0	5.935
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK	0	2.650
GB0001367019	The British Land Co. PLC Reg.Shares	STK	0	10.878
GB00B1KJ408	Whitbread PLC Reg.Shares	STK	0	3.300
JPY				
JP3497400006	Daifuku Co. Ltd. Reg.Shares	STK	4.700	6.000
JP3476480003	Dai-ichi Life Holdings Inc. Reg.Shares	STK	2.900	16.300
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.000
JP3360800001	Hulic Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.900
JP3027680002	Japan Real Estate Inv. Corp. Reg.Shares	STK	0	16
JP3205800000	Kao Corp. Reg.Shares	STK	0	7.500
JP3304200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares	STK	0	14.800
JP3270000007	Kurita Water Industries Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.800
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co. Ltd. Reg.Shares	STK	3.400	18.900
JP3890310000	MS&AD Insurance Grp Hldgs Inc. Reg.Shares	STK	0	6.900
JP3688370000	Nippon Express Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	1.000
JP3684000007	Nitto Denko Corp. Reg.Shares	STK	0	2.000
JP3866800000	Panasonic Holdings Corp. Reg.Shares	STK	4.300	39.000
JP3970300004	Recruit Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	3.800	17.700
JP3500610005	Resona Holdings Inc. Reg.Shares	STK	6.500	38.000
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares	STK	1.700	10.200
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Hldg.Inc Reg.Shares	STK	900	5.600

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
JP3409000001	Sumitomo Realty & Dev. Co.Ltd. Reg.Shares	STK	1.700	5.200
JP3336560002	Suntory Beverage & Food Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.000
JP3546800008	Terumo Corp. Reg.Shares	STK	0	10.400
JP3571400005	Tokyo Electron Ltd. Reg.Shares	STK	2.900	4.350
JP3574200006	Tokyu Corp. Reg.Shares	STK	3.000	9.000
JP3596200000	Toto Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.800
SEK				
SE0016589188	Electrolux, AB Namn-Aktier B	STK	0	4.101
SE0001662230	Husqvarna AB Namn-Aktier B	STK	0	7.602
USD				
US02005N1000	Ally Financial Inc. Reg.Shares	STK	0	1.139
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	3.570	3.570
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares	STK	3.460	3.460
US03027X1000	American Tower Corp. Reg.Shares	STK	0	2.775
US14149Y1082	Cardinal Health Inc. Reg.Shares	STK	0	1.770
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares	STK	0	3.105
US03073E1055	Cencora Inc. Reg.Shares	STK	0	847
US12572Q1058	CME Group Inc. Reg.Shares	STK	293	2.210
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC Reg.Shares	STK	0	3.114
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares	STK	0	4.305
US23918K1088	DaVita Inc. Reg.Shares	STK	0	113
US24906P1093	Dentsply Sirona Inc. Reg.Shares	STK	0	988
US28414H1032	Elanco Animal Health Inc. Reg.Shares	STK	0	3.300
US29444U7000	Equinix Inc. Reg.Shares	STK	0	487
US34965K1079	Fortrea Holdings Inc. Reg.Shares	STK	612	612
US34964C1062	Fortune Brands Innovations Inc Reg.Shares	STK	0	523
US35137L1052	Fox Corp. Reg.Shares A	STK	2.000	2.000
US4180561072	Hasbro Inc. Reg.Shares	STK	0	515
US42250P1030	Healthpeak Properties Inc. Reg.Shares	STK	0	4.106
US4404521001	Hormel Foods Corp. Reg.Shares	STK	0	1.720
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares	STK	0	693
BMG491BT1088	Invesco Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.200
IE00B4Q5ZN47	Jazz Pharmaceuticals PLC Reg.Shares	STK	0	363
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc. Reg.Shares	STK	0	4.550
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares	STK	0	1.806
US57638P1049	MasterBrand Inc. Reg.Shares	STK	0	523
US5797802064	McCormick & Co. Inc. Reg.Shares (non voting)	STK	0	1.659
JE00BYSS4X48	Novocure Ltd. Reg.Shares	STK	0	570
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares	STK	1.090	12.403
US68902V1070	Otis Worldwide Corp. Reg.Shares	STK	0	2.525
US72919P2020	Plug Power Inc. Reg.Shares	STK	0	2.305
US7607591002	Republic Services Inc. Reg.Shares	STK	0	1.349
US7611521078	ResMed Inc. Reg.Shares	STK	0	775
US7703231032	Robert Half Inc. Reg.Shares	STK	0	352
US7757111049	Rollins Inc. Reg.Shares	STK	0	1.350
US8318652091	Smith Corp., A.O. Reg.Shares	STK	0	800
US87612E1064	Target Corp. Reg.Shares	STK	0	2.870
US9182041080	V.F. Corp. Reg.Shares	STK	0	2.027
US92276F1003	Ventas Inc. Reg.Shares	STK	0	2.755
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	200	1.566
US96145D1054	WRKCo Inc. Reg.Shares	STK	0	1.237
US98980F1049	Zoominfo Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	965
Verzinsliche Wertpapiere				
CZK				
CZ0001004600	0,4500 % Tschechien Bonds S.97 15/23	CZK	97.500.000	97.500.000
EUR				
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 20/30	EUR	0	300.000
XS2711801287	7,1250 % APA Infrastructure Ltd. FLR Bonds 23/83	EUR	400.000	400.000
XS2590758400	3,5500 % AT & T Inc. Notes 23/25	EUR	1.000.000	1.000.000
XS2577572188	4,8750 % Banco BPM S.p.A. Preferred MTN 23/27	EUR	950.000	950.000
XS2576362839	4,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 23/28	EUR	250.000	250.000
XS2662538425	4,9180 % Barclays PLC FLR MTN 23/30	EUR	600.000	600.000
BE0002582600	3,6250 % Belfius Bank S.A. FLR Securities 18/Und.	EUR	200.000	200.000
XS2625968776	3,6250 % BMW Finance N.V. MTN 23/35	EUR	850.000	850.000
FR001400F2H9	7,3750 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 23/Und.	EUR	600.000	600.000
XS2325743990	1,3750 % BPER Banca S.p.A. FLR MTN 21/27	EUR	360.000	360.000
FR001400HMF8	4,3750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Non-Pref. MTN 23/30	EUR	1.500.000	1.500.000
XS2596458591	4,2500 % Brambles Finance PLC MTN 23/31	EUR	300.000	300.000
XS2582814039	3,7500 % British Telecommunications PLC MTN 23/31	EUR	375.000	375.000
FR0014004EF7	0,7500 % C.N.d.Reas.Mut.Agrico.Group.SA Notes 21/28	EUR	0	700.000
FR001400HU68	3,7500 % Carrefour S.A. MTN 23/30	EUR	1.400.000	1.400.000
XS2381671671	0,2500 % Credit Suisse AG MTN 21/28	EUR	0	400.000
FR0013292828	1,7500 % Danone S.A. FLR MTN 17/Und.	EUR	2.000.000	2.000.000
FR0014005EJ6	1,0000 % Danone S.A. FLR MTN 21/Und.	EUR	200.000	200.000
DE000DL19VZ9	4,6250 % Deutsche Bank AG FLR Nachr. Anl. 21/Und.	EUR	600.000	600.000
PTEDPUOM0008	3,8750 % EDP - Energias de Portugal SA MTN 23/28	EUR	200.000	200.000
XS2589260996	4,5000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 23/43	EUR	1.075.000	1.075.000
XS2000719992	3,5000 % ENEL S.p.A. FLR Cap. Secs 19/Und.	EUR	300.000	300.000
XS2312744217	1,3750 % ENEL S.p.A. FLR Nts 21/Und.	EUR	100.000	100.000
FR001400F1I9	4,0000 % Engie S.A. MTN 23/35	EUR	300.000	300.000
FR001400HZE3	7,0000 % Eramet S.A. Obl. 23/28	EUR	1.100.000	1.100.000
DE000A3E5WW4	1,3750 % Evonik Industries AG FLR Nachr.-Anl. 21/81	EUR	400.000	400.000

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2627121259	4,1250 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA MTN 23/29	EUR	300.000	300.000
XS2587352340	4,3000 % General Motors Financial Co. MTN 23/29	EUR	400.000	400.000
GR0124037715	0,7500 % Griechenland Notes 21/31	EUR	0	1.200.000
XS2704918478	4,8750 % H&M Finance B.V. MTN 23/31	EUR	1.175.000	1.175.000
HK0000895893	3,8750 % Hong Kong MTN 23/25	EUR	150.000	150.000
FR0013444304	0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. MTN 19/27	EUR	0	200.000
FR001400M998	4,7500 % IMERYS S.A. Obl. 23/29	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2678939427	9,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Cap.Notes 29/Und.	EUR	1.200.000	1.200.000
XS2223761813	5,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Nts 20/Und.	EUR	250.000	250.000
XS2317069685	0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Preferred MTN 21/28	EUR	0	500.000
XS2583742239	3,6250 % Intl Business Machines Corp. Notes 23/31	EUR	625.000	625.000
XS2626007939	4,2500 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. Notes 23/35	EUR	325.000	325.000
BE0002935162	4,3750 % KBC Groep N.V. FLR MTN 23/30	EUR	500.000	500.000
FR001400KHZ0	3,6250 % Kering S.A. MTN 23/27	EUR	1.500.000	1.500.000
ES0000012107	1,0000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/42	EUR	0	300.000
ES0000012K20	0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32	EUR	0	3.800.000
ES0000012108	0,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 21/28	EUR	0	200.000
ES0000012B62	0,3500 % Königreich Spanien Bonos 18/23	EUR	0	85.000
ES00000127G9	2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25	EUR	0	140.000
ES0000012G26	0,8000 % Königreich Spanien Obligaciones 20/27	EUR	0	200.000
FR001400I5S6	3,5000 % Legrand S.A.Obl. 23/29	EUR	900.000	900.000
BE6343825251	3,8750 % Lonza Finance International NV Notes 23/33	EUR	125.000	125.000
DE000A3LH6U5	3,7000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. MTN 23/31	EUR	625.000	625.000
XS2218405772	1,6250 % Merck KGaA FLR Sub.Anl. 20/80	EUR	300.000	300.000
XS2575973776	3,8750 % National Grid PLC MTN 23/29	EUR	375.000	375.000
XS2717310945	3,7500 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 23/35	EUR	1.200.000	1.200.000
FR001400HOF5	5,5000 % Nexans S.A. Obl. 23/28	EUR	100.000	100.000
XS2563353361	5,2500 % Orsted A/S FLR Notes 22/Und.	EUR	500.000	500.000
XS2712525109	7,2500 % Paprec Holding S.A. Notes 23/29 Reg.S	EUR	1.175.000	1.175.000
XS2611221032	6,6250 % Permanent TSB Group Hldgs PLC FLR MTN 23/28	EUR	1.350.000	1.350.000
XS2577396430	4,2500 % Pirelli & C. S.p.A. MTN 23/28	EUR	125.000	125.000
IT0005542359	4,0000 % Republik Italien B.T.P. 23/31	EUR	1.600.000	1.600.000
XS2582522681	6,9600 % Republik Nordmazedonien Bonds 23/27 Reg.S	EUR	250.000	250.000
PTOTEQOE0015	5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24	EUR	0	1.567.000
PTOTEXOE0024	1,9500 % Republik Portugal Obr. 19/29	EUR	0	21.000
PTOTEMOE0035	0,7000 % Republik Portugal Obr. 20/27	EUR	0	63.000
PTOTENOE0034	0,9000 % Republik Portugal Obr. 20/35	EUR	0	90.000
PTOTECOE0037	1,0000 % Republik Portugal Obr. 21/52	EUR	0	300.000
XS2538441598	6,6250 % Republik Rumänien MTN 22/29 Reg.S	EUR	350.000	350.000
SI0002103974	0,2000 % Republik Slowenien Bonds 20/23	EUR	0	140.000
XS2297209293	0,0000 % Republik Zypern MTN 21/26	EUR	0	120.000
XS2589790109	3,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 23/31	EUR	400.000	400.000
XS2671251127	4,8750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA Non-Pref. MTN 23/28	EUR	950.000	950.000
XS2618731256	4,8740 % Standard Chartered PLC FLR MTN 23/31	EUR	725.000	725.000
XS2178833773	3,8750 % Stellantis N.V. MTN 20/26	EUR	0	350.000
XS2597110027	4,3750 % Stellantis N.V. MTN 23/30	EUR	425.000	425.000
XS2613209670	4,3750 % Sydney Airport Fin.Co.Pty Ltd. MTN 23/33	EUR	775.000	775.000
XS2056371334	2,8750 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 19/Und.	EUR	400.000	400.000
XS2109819859	2,5020 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 20/Und.	EUR	400.000	400.000
XS2535725159	4,6250 % Vier Gas Transport GmbH MTN 22/32	EUR	500.000	500.000
XS2671621402	3,8750 % Volvo Treasury AB MTN 23/26	EUR	950.000	950.000
XS2626343375	3,6250 % Volvo Treasury AB MTN 23/27	EUR	250.000	250.000
DE000A3MQS56	1,3750 % Vonovia SE MTN 22/26	EUR	0	300.000
USD				
US62954WAH88	4,1420 % NTT Finance Corp. Notes 22/24 144A	USD	0	200.000
USF8600KAA46	10,0000 % Société Générale S.A. FLR Nts 23/Und. Reg.S	USD	750.000	750.000
Sonstige Beteiligungswertpapiere				
CHF				
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK	1.000	5.960
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES0627797907	EDP Renováveis S.A. Anrechte	STK	4.627	4.627
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
USD				
US78486Q1013	SVB Financial Group Reg.Shares	STK	0	327
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS2598332133	4,2500 % Autoliv Inc. MTN 23/28	EUR	550.000	550.000
XS2638924709	8,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. FLR Bonds 23/Und.	EUR	1.000.000	1.000.000
XS2585932275	3,5530 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl Notes 23/29	EUR	700.000	700.000
XS2623668634	3,7420 % Caterpillar Fin.Services Corp. MTN 23/26	EUR	725.000	725.000
XS2010039035	0,9500 % Deutsche Bahn Finance GmbH Sub. FLR Nts 19/Und.	EUR	200.000	200.000
XS2673437484	4,3890 % East Japan Railway Co. MTN 23/43	EUR	800.000	800.000
BE6343437255	6,7500 % Ethias Vie Notes 23/33	EUR	500.000	500.000
XS2728560959	4,5000 % JDE Peet's N.V. MTN 23/34	EUR	1.425.000	1.425.000
XS2624554320	6,2500 % OI European Group B.V. Notes 23/28 Reg.S	EUR	250.000	250.000
XS2388183381	1,0000 % Smurfit Kappa Treasury PUC Notes 21/33	EUR	0	225.000
USD				
US06738ECN31	9,6250 % Barclays PLC FLR Cap.Nts 23/Und.	USD	200.000	200.000
XS1956051145	6,7500 % ING Groep N.V. FLR Cap. Secs 19/Und.	USD	1.000.000	1.000.000

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US87264ACW36	5,6500 % T-Mobile USA Inc. Notes 22/53	USD	1.000.000	1.000.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
CHF				
CH0002497458	SGS S.A. Namens-Aktien	STK	0	95
DKK				
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK	0	14.000
EUR				
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	2.773
SEK				
SE0017768716	Boliden AB Namn-Aktier	STK	0	4.402
SE0020050425	Boliden AB Reg.Redemption Shares	STK	4.402	4.402
USD				
XF0004217208	Abiomed Contingent Value Rights	STK	276	276
US0036541003	Abiomed Inc. Reg.Shares	STK	0	276
BMG169621056	Bunge Ltd. Reg.Shares	STK	0	965
GB00B8W67B19	Liberty Global PLC Reg.Shares C	STK	0	4.200
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000A351550	1,3750 % Vonovia SE z.Umt.eing.Tend.onl. 22/26	EUR	300.000	300.000
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06670509N0	ACS, Act.de Constry. Serv. SA Anrechte	STK	3.714	3.714
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	ANT	0	85.000
LU0446734369	UBSLFS-MSCI EMU Val.UCITS ETF Inhaber-Ant. A-dis	ANT	0	125.000
USD				
IE00BYVJRP78	iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares	ANT	0	870.000
IE00BYVJRR92	iShsIV-MSCI USA SRI UCITS ETF Reg.Shares	ANT	205.000	345.000
Geldmarktfonds				
Gruppeneigene Geldmarktfonds				
LU0052863874	DekaLux-Geldmarkt: Euro	ANT	674.500	674.500

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.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): Dow Jones Industrial Average Index (Price) (USD), EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Hang Seng China Enterprises Index, MSCI Emerging Markets Index (Total Return) (USD), MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, Russell 2000 Index, S&P 500 Index)	EUR	195.759
Verkaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): DAX Performance-Index, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index)	EUR	58.745
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX))	EUR	229.898
Verkaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): 10 Year Japanese Gov. Bond Future (JGB), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY), US Treasury Long Bond Future (US))	EUR	247.699
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):		
(Basiswert(e): Hang Seng China Enterprises Index, Nasdaq-100 Index)	EUR	18.462
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	49.312
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))	EUR	19.170
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Verkaufte Kaufoptionen (Call):		
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	22.160
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	46.450
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	158
AUD/USD	EUR	12.002

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
CHF/EUR	EUR	16.798
CZK/EUR	EUR	11.364
DKK/EUR	EUR	20.476
GBP/EUR	EUR	26.251
HKD/EUR	EUR	2.267
JPY/EUR	EUR	88.169
JPY/USD	EUR	23.358
MXN/EUR	EUR	1.001
MXN/USD	EUR	1.011
NOK/EUR	EUR	18.833
NZD/USD	EUR	5.617
SEK/EUR	EUR	4.645
THB/EUR	EUR	53
USD/EUR	EUR	258.179
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	198
AUD/USD	EUR	10.351
CHF/EUR	EUR	18.047
CZK/EUR	EUR	7.437
DKK/EUR	EUR	23.663
GBP/EUR	EUR	26.040
GBP/USD	EUR	2.063
HKD/EUR	EUR	1.479
JPY/EUR	EUR	101.306
JPY/USD	EUR	24.466
MXN/USD	EUR	2.001
NOK/EUR	EUR	19.032
NZD/USD	EUR	3.767
SEK/EUR	EUR	5.561
USD/EUR	EUR	219.305
Swaps (In Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)		
Zinsswaps		
(Erhalten/Zahlen)	EUR	23.777
(Basiswert(e): IRS 4.582% USD / SOFR USD, IRS 4.642% USD / SOFR USD, IRS SOFR USD / 3.438% USD, IRS SOFR USD / 3.56% USD)		
Credit Default Swaps (CDS)		
Protection Buyer:		
(Basiswert(e): CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S39 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S40 V1 5Y)	EUR	14.000
Protection Seller:		
(Basiswert(e): CDS CDX.NA.HY. S40 V1 5Y, CDS CDX.NA.HY. S41 V2 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S39 V1 5Y, CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S40 V1 5Y)	EUR	33.308
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
befristet		
(Basiswert(e): 4,0000 % Republik Kroatien Notes 23/35)	EUR	493
unbefristet		
(Basiswert(e): 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30, 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24, 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 21/23, 0,1250 % Republik Slowenien Bonds 21/31, 0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27, 0,2500 % Republik Lettland MTN 21/30, 0,5000 % TenneT Holding B.V. MTN 21/31, 0,6000 % E.ON SE MTN 21/32, 0,6250 % Banco Santander S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/29, 0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32, 0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25, 0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.81 17/27, 0,8000 % UniCredit S.p.A. FLR Preferred MTN 21/29, 0,8750 % Republik Slowenien Bonds 20/30, 0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33, 1,0000 % Valéo S.E. MTN 21/28, 1,1250 % Orlen S.A. MTN 21/28, 1,2500 % Bca Pop. di Sondrio S.p.A. FLR MTN 21/27, 1,3750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 21/31, 1,3750 % BPER Banca S.p.A. FLR MTN 21/27, 1,3750 % Danske Bank AS FLR Non-Pref. MTN 22/27, 1,3750 % Evonik Industries AG FLR Nachr.-Anl. 21/81, 1,3750 % Vonovia SE MTN 22/26, 1,6250 % Verallia SA Notes 21/28, 1,7500 % Banco Com. Português SA (BCP) FLR Pref. MTN 21/28, 1,8750 % Verallia SA Notes 21/31, 2,1250 % Rexel S.A. Notes 21/28, 2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25, 2,2500 % Mytilineos S.A. Notes 21/26, 2,2500 % UPM Kymmene Corp. MTN 22/29, 2,3750 % ACCOR S.A. Bonds 21/28, 2,3750 % Forvia SE Notes 21/29, 2,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA FLR Nts 22/Und., 2,5000 % Volvo Car AB MTN 20/27, 2,6250 % Alliantier N.V. MTN 22/27, 2,6250 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26, 2,6250 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 22/27, 2,6250 % La Poste MTN 22/28, 2,7500 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 22/25, 2,8750 % Statkraft AS MTN 22/29, 2,8750 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 19/Und., 2,8750 % VZ Vendor Financing II B.V. Notes 20/29 Reg.S, 3,1250 % ProLogis Intl Funding II S.A. MTN 22/31, 3,4500 % Amprion GmbH MTN 22/27, 3,5000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Notes 23/28, 3,5000 % Getiink SE Notes 20/25 Reg.S, 3,5000 % VZ Secured Financing B.V. Notes 22/32 Reg.S, 3,5530 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl Notes 23/29, 3,7500 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA MTN 22/27, 3,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/30, 3,8750 % TenneT Holding B.V. MTN 22/28, 3,8750 % Webuild S.p.A. Notes 22/26, 4,0000 % Republik Kroatien Notes 23/35, 4,1250 % Republik Zypern MTN 23/33, 4,2500 % Autoliv Inc. MTN 23/28, 4,2500 % Huhtamaeki Oyj Notes 22/27, 4,2500 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. Notes 23/35, 4,2500 % Volvo Car AB MTN 22/28, 4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/29, 4,3750 % Nokia Oyj MTN 23/31, 4,3750 % Stellantis N.V. MTN 23/30, 4,6250 % Redeia Corporacion S.A. FLR Notes 23/Und., 4,8740 % Standard Chartered PLC FLR MTN 23/31, 4,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 23/28, 4,8750 % Iberdrola Finanzas S.A. FLR MTN 23/Und., 5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Non-Pref.MTN 23/28, 5,7500 % ZF Finance GmbH MTN 23/26, 5,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Nts 20/Und., 6,0000 % Banco BPM S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 22/28, 6,0000 % Banco BPM S.p.A. Non-Pref. MTN 22/26, 6,0000 % Kon. KPN N.V. FLR Notes 22/Und., 6,5000 % Vodafone Group PLC FLR MTN 23/84, 6,7500 % Telefónica Europe B.V. FLR Bonds 23/Und., 6,9600 % Republik Nordmazedonien Bonds 23/27 Reg.S, 7,1250 % Telefónica Europe B.V. FLR Notes 22/Und., 7,2500 % Forvia SE Notes 22/26, 7,2500 % Unicaja Banco S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/27, 8,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. FLR Bonds 23/Und., Acciona S.A. Acciones Port., adidas AG Namens-Aktien, Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder, Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder, Allianz SE vinkNamens-Aktien, ASML Holding N.V. Aandelen op naam, AXA S.A. Actions au Porteur, Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom., Carrefour S.A. Actions Port., Caterpillar Inc. Reg.Shares, Crédit Agricole S.A. Actions Port., Danone S.A. Actions Port., Deutsche Börse AG Namens-Aktien, EDP Renováveis S.A. Acciones Port., EDP Renováveis S.A. Anrechte, Elia Group Actions au Port., Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien, Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien, Hermes International S.C.A. Actions au Porteur, IMCD N.V. Aandelen op naam, Industria de Diseño Textil SA Acciones Port., Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom., Intl Flavors & Fragrances Inc. Reg.Shares, Just Eat Takeaway.com N.V. Reg.Shares, KBC Groep N.V. Parts Sociales au Port., Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B, Plug Power Inc. Reg.Shares, Reckitt Benckiser Group Reg.Shares, Redeia Corporacion S.A. Acciones Port., Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine, Schneider Electric SE Actions Port., Swiss Re AG Namens-Aktien, Target Corp. Reg.Shares, The Home Depot Inc. Reg.Shares, Universal Music Group N.V. Aandelen op naam, Verbund AG Inhaber-Aktien, Wärtsilä Corp. Reg.Shares, Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam, Zalando SE Inhaber-Aktien)	EUR	145.304

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 16,44 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 65.565.351 Euro.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (CF)

Entwicklung des Sondervermögens

				EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres				175.941.546,50
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr			-3.199.885,38
2	Zwischenausschüttung(en)			--
3	Mittelzufluss (netto)			11.510.175,84
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	24.231.161,72	
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	24.231.161,72	
	davon aus Verschmelzung	EUR	0,00	
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-12.720.985,88	
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			62.447,58
5	Ergebnis des Geschäftsjahres			15.552.849,92
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne			8.197.159,60
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste			7.818.240,89
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres				199.867.134,46

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
31.12.2020	22.197.636,00	102,65
31.12.2021	141.467.398,38	111,65
31.12.2022	175.941.546,50	95,81
31.12.2023	199.867.134,46	102,26

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (CF)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2023 - 31.12.2023 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	93.981,86	0,05
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	1.903.593,44	0,97
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	127.321,12	0,07
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	1.133.548,90	0,58
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	514.388,66	0,26
davon Negative Einlagezinsen	-376,79	-0,00
davon Positive Einlagezinsen	514.765,45	0,26
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	420.022,32	0,21
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	6.958,83	0,00
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	6.958,83	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-14.097,21	-0,01
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividenden	-14.097,21	-0,01
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-292.830,73	-0,15
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-287.571,37	-0,15
davon aus Zinsen aus ausländischen Wertpapieren/Liquiditätsanlagen	-5.259,36	-0,00
10. Sonstige Erträge	109.874,94	0,06
davon Kick-Back-Zahlungen	2.288,76	0,00
davon Kompensationszahlungen	101.089,17	0,05
davon Quellensteuerrückvergütung Dividenden	6.493,63	0,00
davon Zinsgutschrift auf Quellensteuerrückvergütung Fokusbank	3,38	0,00
Summe der Erträge	4.002.762,13	2,05
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-12.290,10	-0,01
2. Verwaltungsvergütung	-1.895.427,20	-0,97
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-344.036,54	-0,18
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-2.296,22	-0,00
davon EMIR-Kosten	-11.131,48	-0,01
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-27.340,36	-0,01
davon Kostenpauschale	-303.268,48	-0,16
Summe der Aufwendungen	-2.251.753,84	-1,15
III. Ordentlicher Nettoertrag	1.751.008,29	0,90
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	16.126.817,39	8,25
2. Realisierte Verluste	-18.340.376,25	-9,38
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-2.213.558,86	-1,13
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-462.550,57	-0,24
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	8.197.159,60	4,19
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	7.818.240,89	4,00
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	16.015.400,49	8,19
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	15.552.849,92	7,96

*) 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	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-462.550,57	-0,24
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹⁾	3.667.827,25	1,88
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung²⁾	3.205.276,68	1,64
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung ³⁾	3.205.276,68	1,64

Umlaufende Anteile: Stück 1.954.437

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

¹⁾ Betrag, um den die Ausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres übersteigt.

²⁾ 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.

³⁾ Ausschüttung am 23. Februar 2024 mit Beschlussfassung vom 13. Februar 2024.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (TF)

Entwicklung des Sondervermögens

				EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres				34.644.010,86
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr			-620.172,54
2	Zwischenausschüttung(en)			-,-
3	Mittelzufluss (netto)			-622.204,62
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	3.509.337,12	
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	3.509.337,12	
	davon aus Verschmelzung	EUR	0,00	
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-4.131.541,74	
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			-6.962,35
5	Ergebnis des Geschäftsjahres			2.747.044,52
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne			1.523.570,56
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste			1.480.076,63
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres				36.141.715,87

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
31.12.2020	6.095.979,88	102,13
31.12.2021	32.462.330,58	110,75
31.12.2022	34.644.010,86	94,74
31.12.2023	36.141.715,87	100,62

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (TF)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2023 - 31.12.2023 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	17.050,35	0,05
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	345.051,48	0,96
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	23.072,64	0,06
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	205.436,06	0,57
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	93.264,39	0,26
davon Negative Einlagezinsen	-68,20	-0,00
davon Positive Einlagezinsen	93.332,59	0,26
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	76.202,80	0,21
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	1.261,71	0,00
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	1.261,71	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-2.557,50	-0,01
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge	-2.557,50	-0,01
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-53.097,27	-0,15
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-52.145,33	-0,15
davon aus Zinsen aus ausländischen Wertpapieren/Liquiditätsanlagen	-951,94	-0,00
10. Sonstige Erträge	19.910,14	0,06
davon Kick-Back-Zahlungen	414,46	0,00
davon Kompensationszahlungen	18.320,21	0,05
davon Quellensteuerrückvergütung Dividenden	1.174,84	0,00
davon Zinsgutschrift auf Quellensteuerrückvergütung Fokusbank	0,63	0,00
Summe der Erträge	725.594,80	2,02
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-2.226,38	-0,01
2. Verwaltungsvergütung	-515.575,62	-1,44
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-62.386,64	-0,17
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-416,36	-0,00
davon EMIR-Kosten	-2.018,02	-0,01
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-4.957,51	-0,01
davon Kostenpauschale	-54.994,75	-0,15
Summe der Aufwendungen	-580.188,64	-1,62
III. Ordentlicher Nettoertrag	145.406,16	0,40
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	2.922.019,11	8,13
2. Realisierte Verluste	-3.324.027,94	-9,25
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-402.008,83	-1,12
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-256.602,67	-0,71
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	1.523.570,56	4,24
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	1.480.076,63	4,12
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	3.003.647,19	8,36
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	2.747.044,52	7,65

*) 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	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-256.602,67	-0,71
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹⁾	838.508,29	2,33
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung²⁾	581.905,62	1,62
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung ³⁾	581.905,62	1,62

Umlaufende Anteile: Stück 359.201

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

¹⁾ Betrag, um den die Ausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres übersteigt.

²⁾ 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.

³⁾ Ausschüttung am 23. Februar 2024 mit Beschlussfassung vom 13. Februar 2024.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset Anhang.

Zusätzliche Angaben zu den Derivaten

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure in EUR

223.758.779,37

Vertragspartner der derivativen Geschäfte

Barclays Bank Ireland PLC
BNP Paribas S.A.
DekaBank Deutsche Girozentrale
J.P. Morgan SE
UBS AG [London Branch]

Gesamtbetrag der Kurswerte der Bankguthaben, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 4.060.000,00

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)

5% ICE BofA BB & Lower Sovereign External Debt Index in EUR, 13% ICE BofA Global Corporate Index in EUR, 30% ICE BofA Global Government Index in EUR, 7% ICE BofA Global High Yield Index in EUR, 40% MSCI AC World NR in EUR, 5% Zinsbenchmark mit tgl. EUROSTR mit täglichem Zinsszins (30/360)

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 2,96%
größter potenzieller Risikobetrag 5,47%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 4,47%

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 gemäß der Brutto-Methode (§ 37 Abs. 4 Satz 4 DerivateV i. V. m. § 5 Abs. 2 DerivateV)

172,21%

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.

Zusätzliche Angaben zu den Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäften (besichert)

Instrumentenart

Wertpapier-Darlehen

Kontrahent

DekaBank Deutsche Girozentrale

Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)

1.422.667,20

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:

EUR 4.366.546,21

davon:

Schuldverschreibungen

EUR 4.366.546,21

Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse CF

EUR 6.958,83

Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse CF

EUR 2.296,22

Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse TF

EUR 1.261,71

Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse TF

EUR 416,36

Umlaufende Anteile Klasse CF

STK 1.954.437

Umlaufende Anteile Klasse TF

STK 359.201

Anteilwert Klasse CF

EUR 102,26

Anteilwert Klasse TF

EUR 100,62

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzolumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Für die Bewertung von Renten, rentenähnlichen Genussscheinen und Zertifikaten, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind, wird grundsätzlich

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

der letzte verfügbare handelbare Kurs zugrunde gelegt. Renten, rentenähnliche Genussscheine und Zertifikate, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mit marktnahen Kursstellungen (in der Regel Brokerquotes, alternativ mit sonstigen Preisquellen) bewertet, welche auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden. Die Bewertung von Schuldscheindarlehen erfolgt in der Regel mit Modellbewertungen, die von externen Dienstleistern bezogen und auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden.

Investmentanteile

Investmentanteile werden zum letzten von der Investmentgesellschaft festgestellten Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Börsenkurs bewertet.

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

Gesamtkostenquote (laufende Kosten) Anteilklasse CF	1,25%
Gesamtkostenquote (laufende Kosten) Anteilklasse TF	1,75%

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.

Für das Sondervermögen ist gemäß den Anlagebedingungen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Kostenpauschale von insgesamt 0,16% p.a. vereinbart. Davon entfallen bis zu 0,10% p.a. auf die Verwahrstelle und bis zu 0,10% p.a. auf Dritte. Die Kostenpauschale deckt die in den Besonderen Anlagebedingungen und im Verkaufsprospekt aufgeführten Vergütungen und Kosten ab, die dem Sondervermögen nicht separat belastet werden. Die Verwaltungsvergütung ist nicht Bestandteil der Kostenpauschale und wird dem Sondervermögen gesondert belastet.

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

AIS-Amun.Idx US Corp. SRI A.N.UCIT.ETF USD A.N	0,14
DekaLux-Geldmarkt: Euro	0,10
In.M.I Invesco AT1 Cap Bd ETF Reg.Shs Acc.	0,39
iShs II-S H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	0,25
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.	0,25
iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares	0,15
iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)	0,20
iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	0,20
iShsIV-MSCI USA SRI UCITS ETF Reg.Shares	0,20
iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares	0,25
iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares	0,25
L&G ESG Em.Mkts Corp.Bd ETF Reg.Shs Dis.	0,35
SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist)	0,55
UBSLFS-MSCI EMU Val.UCITS ETF Inhaber-Ant. A-dis	0,25
xtrackers MSCI China 1C	0,40

Wesentliche sonstige Erträge

Anteilklasse CF		
Kick-Back-Zahlungen	EUR	2.288,76
Kompensationszahlungen	EUR	101.089,17
Quellensteuerrückvergütung Dividenden	EUR	6.493,63
Zinsgutschrift auf Quellensteuerrückvergütung Fokusbank	EUR	3,38

Anteilklasse TF

Kick-Back-Zahlungen	EUR	414,46
Kompensationszahlungen	EUR	18.320,21
Quellensteuerrückvergütung Dividenden	EUR	1.174,84
Zinsgutschrift auf Quellensteuerrückvergütung Fokusbank	EUR	0,63

Wesentliche sonstige Aufwendungen

Anteilklasse CF		
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	2.296,22
EMIR-Kosten	EUR	11.131,48
Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	EUR	27.340,36
Kostenpauschale	EUR	303.268,48

Anteilklasse TF

Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	416,36
EMIR-Kosten	EUR	2.018,02
Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	EUR	4.957,51
Kostenpauschale	EUR	54.994,75

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt

EUR 160.586,42

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.

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 Deka-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 Deka-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 Deka-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 Deka Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2022 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka 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 Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**

Geschäftsführer	EUR	11.962.579,80
weitere Risk Taker	EUR	2.094.112,05
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR	1.991.350,34
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risk Taker	EUR	387.352,00
	EUR	7.489.765,41

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

** weitere Risk Taker: alle sonstigen Risk Taker, die nicht Geschäftsführer oder Risk Taker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risk Taker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risk Taker oder Geschäftsführer befinden.

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Aktien	99.840,00	0,04
Verzinsliche Wertpapiere	1.322.827,20	0,56

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)
DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
1.422.667,20

Sitzstaat
Deutschland

Art(en) von Abwicklung/Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem), per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte) oder trilateral (Agency-Geschäfte). Total Return Swaps werden als bilaterales OTC-Geschäft abgeschlossen.

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)
unbefristet

absolute Beträge in EUR
1.422.667,20

Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen
EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen
unbefristet

absolute Beträge in EUR
4.366.546,21

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	8.183,79	100,00
Kostenanteil des Fonds	2.700,66	33,00
Ertragsanteil der KVG	2.700,66	33,00

Der oben ausgewiesene Kostenanteil des Fonds bzw. Ertragsanteil der KVG beinhaltet sowohl den Aufwandsersatz der Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) als auch zusätzliche Kosten Dritter. Damit werden der Infrastrukturaufwand der Kapitalverwaltungsgesellschaft und die Kosten des externen Wertpapierdarlehen-Serviceproviders für die Anbahnung, Durchführung und Abwicklung inklusive der Sicherheitenstellung abgegolten.

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

0,61% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Wertpapier-Darlehen

	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
UBS Group AG	1.724.476,66
Caisse Francaise de Financement Local	1.657.692,82
Berlin Hyp AG	496.401,00
LfA Förderbank Bayern	487.975,74

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer	2
J.P.Morgan AG Frankfurt	1.724.476,66 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt	2.642.069,56 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

Eine Zuordnung der Kontrahenten zu den erhaltenen Sicherheiten ist auf Geschäftsartenebenen durch die Globalbesicherung im Einzelnen bei Total Return Swaps nicht möglich. Der ausgewiesene Wert enthält daher ausdrücklich keine Total Return Swaps, diese sind innerhalb der Globalbesicherung jedoch ausreichend besichert.

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps	
gesonderte Konten/Depots	0,00%
Sammelkonten/Depots	0,00%
andere Konten/Depots	0,00%
Verwahrt bestimmt Empfänger	0,00%

Da eine Zuordnung begebener Sicherheiten bei Total Return Swaps auf Geschäftsartenebene durch die Globalbesicherung im Einzelnen nicht möglich ist, erfolgt der %-Ausweis für die Verwahrarten ohne deren Berücksichtigung.

Die Summenangabe der Sicherheiten nach Instrumentenart, Restlaufzeit, Sicherheitenaussteller und Verwahrer kann rundungsbedingt von der Summe der angegebenen Einzelwerte

abweichen.

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. Verliehene 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

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.

Auf Grund der Buchungssystematik bei Fonds mit Anteilklassen, wonach täglich die Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste zum Vortag auf Gesamtfondsebene berechnet und entsprechend dem Verhältnis der Anteilklassen zueinander verteilt wird, kann es bei Überwiegen der täglich negativen Veränderungen über die täglich positiven Veränderungen über den Berichtszeitraum innerhalb der Anteilklasse zum Ausweis von negativen nicht realisierten Gewinnen bzw. im umgekehrten Fall zu positiven nicht realisierten Verlusten kommen.

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.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Unternehmenskennung (LEI-Code):
52990077YOW516YQPO53

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja
 Nein

<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,90% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum überwiegend in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Investmentanteile (im Folgenden „Zielfonds“), die nach Grundsätzen der Nachhaltigkeit ausgewählt wurden. Bei der Auswahl der Investitionen wurden sowohl ökologische als auch soziale und die verantwortungsvolle Unternehmens- und Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dies erfolgte durch die Anwendung von Ausschlusskriterien sowie einer Analyse und Bewertung der Unternehmen und/oder Staaten anhand von ESG-Kriterien und unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitschancen und -risiken im Rahmen der ESG-Strategie. Die ESG-Strategie zielte darauf ab

- sofern Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen getätigt werden, nur in Unternehmen zu investieren, die verantwortungsvolle Geschäftspraktiken anwenden und keine Umsätze bzw. nur einen geringen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschaften. Als kontrovers werden Geschäftsfelder erachtet, die mit hohen negativen Auswirkungen auf Umwelt und/ oder soziale Belange verbunden sind, da zum Beispiel die Produktion zum Klimawandel, zur

sozialen Ungleichheit oder zu Konflikten beiträgt

- sofern Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten getätigt werden, in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten zu investieren, die Verfahrensweisen verantwortungsvoller Staatsführung anwenden, indem sie beispielsweise politische Rechte und bürgerliche Freiheiten achten
- sofern Investitionen in Zielfonds getätigt werden, in Zielfonds zu investieren, die eine gute Nachhaltigkeitsbewertung aufweisen.

Hierzu wurden im Rahmen der ESG-Strategie Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen ausgeschlossen, die

- Umsätze aus der Herstellung oder dem Vertrieb gemäß internationalen Konventionen (z.B. Chemiewaffenkonventionen) verbotener geächteter Waffen und/oder Atom- und/oder Handfeuerwaffen generierten
- Umsätze aus der unkonventionellen Förderung von Erdöl und/oder Erdgas (inklusive Fracking) generierten
- Umsätze aus der Förderung von Kohle generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung oder dem Vertrieb im Geschäftsfeld Rüstungsgüter generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung in den Geschäftsfeldern Tabak und/oder Alkohol generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% in den Geschäftsfeldern Glücksspiel generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% in den Geschäftsfeldern Pornografie generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Energiegewinnung durch Kernspaltung (Atomenergie) generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus der Förderung von Erdöl generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus dem Abbau, der Exploration und aus Dienstleistungen für Ölsand und Ölschiefer generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz von/aus fossiler Brennstoffe (exklusive Erdgas) generierten
- gegen den UN Global Compact verstießen
- eine ESG-Bewertung von schlechter als „B“ von MSCI ESG Research LLC aufwiesen.

Zudem wurden im Rahmen der ESG-Strategie Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten ausgeschlossen, die

- als „unfrei“ („not free“) nach dem Freedom-House-Index klassifiziert waren
- einen Corruption Perceptions-Index von weniger als 40 aufwiesen
- als Atommacht nach SIPRI (Stockholm International Peace Research Institute) galten
- die UN-Biodiversitäts-Konventionen nicht berücksichtigten
- eine ESG-Bewertung von schlechter als „B“ von MSCI ESG Research LLC aufwiesen

Im Rahmen der ESG-Strategie wurden Zielfonds ausgeschlossen,

- die eine ESG-Bewertung von schlechter als „BBB“ von MSCI ESG Research LLC erhielten
- die bezüglich ihrer ESG-Bewertung zu den schlechtesten 50% ihrer Vergleichsgruppe gehörten
- deren Fondsmanager oder die Kapitalverwaltungsgesellschaften, welche die Zielfonds verwalten, nicht die Principles for Responsible Investment (PRI) der Vereinten Nationen zugrunde legten.

Die Bewertung des MSCI ESG Ratings umfasst eine siebenstufige Skala mit den Kategorien AAA, AA, A, BBB, BB, B und CCC, wobei CCC die niedrigste Bewertung und AAA die höchste Bewertung darstellt.

Darüber hinaus tätigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungs-Verordnung ((EU) 2019/2088). Mit den nachhaltigen Investitionen wurde angestrebt einen Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen bis 2030 (UN Sustainable Development Goals, SDGs) zu leisten. Die SDGs umfassen 17 Zielsetzungen, die darauf ausgerichtet sind durch eine wirtschaftlich nachhaltige Entwicklung weltweit Armut zu reduzieren und Wohlstand zu fördern. Dabei werden gleichzeitig soziale Bedürfnisse wie Bildung, Gesundheit und Beschäftigung wie auch Klimawandel und Umweltschutz berücksichtigt.

Dies erfolgte durch direkte Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente oder indirekte Investitionen über Zielfonds in Unternehmen und Staaten, die mit ihren (Geschäfts-) Tätigkeiten zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs beitragen. Weitere Details zu den Zielen der nachhaltigen Investitionen sind im Abschnitt „Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“ zu finden.

Mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt tätigte, wurden keine Umweltziele gemäß Artikel 9 der EU Taxonomie (Verordnung (EU) 2020/852) verfolgt.

Inwieweit die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale des Finanzprodukts erfüllt wurden, wird anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Details zur Ausprägung der Nachhaltigkeitsindikatoren im Berichtszeitraum finden sich im folgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

1. Einhaltung der in der Anlagestrategie vereinbarten Ausschlusskriterien

Während des Berichtszeitraums investierte das Finanzprodukt nicht in gemäß der ESG-Strategie ausgeschlossene Unternehmen, Staaten und Zielfonds. Damit hielt das Finanzprodukt die im Rahmen der ESG-Strategie festgelegten Ausschlusskriterien während des Berichtszeitraums vollumfänglich und dauerhaft ein. Durch die Einhaltung der Ausschlusskriterien wurde erreicht, dass das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Unternehmen angelegt wurde, die keine verantwortungsvollen Geschäftspraktiken anwendeten und damit gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstießen und/ oder Umsätze bzw. einen gewissen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschafteten. Zudem wurde das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Staaten angelegt, die keine Verfahrensweisen verantwortungsvoller Staatsführung anwenden, indem sie beispielsweise politische Rechte und bürgerliche Freiheiten nicht achteten. Abschließend wurde das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Zielfonds angelegt, deren ESG-Bewertung nicht den Mindeststandards des Finanzprodukts entsprachen. Eine ausführliche Auflistung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen, Staaten und/ oder Zielfonds geführt haben, findet sich im vorherigen Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“ wieder.

2. Ökologische Wirkung

Der Indikator „ökologische Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 53,55 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

Der Indikator berechnet sich aus der Summe der Umsätze der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen in den Geschäftsfeldern alternative Energien, Energieeffizienz, nachhaltiges Bauen, nachhaltige Landwirtschaft, nachhaltige Wasserwirtschaft und Vermeidung von Umweltverschmutzung durch eine Minimierung der Abfallerzeugung, jeweils gewichtet mit dem Anteil der Investition am Fondsvermögen. Dabei handelt es sich um Geschäftsfelder, in denen Produkte oder Dienstleistungen angeboten werden, die zur Erreichung von Umweltzielen (basierend auf den SDGs) beitragen. Es werden sowohl direkte Investitionen in Unternehmen über Aktien und Anleihen als auch indirekte Investitionen über Zielfonds berücksichtigt. Die Gesamtsumme wird mit 1.000 Euro investiertem Kapital ins Verhältnis gesetzt. Die Berechnung des Indikators basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt den Durchschnitt der Datenlage an den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum wider.

Hinweis: Der Indikator dient lediglich zur Veranschaulichung. Die Investitionen in die Unternehmen sind nicht zweckgebunden an die Bereitstellung von Produkten bzw. Dienstleistungen, die zur Erreichung von Umweltzielen beitragen, d.h. es besteht kein kausaler Zusammenhang zwischen einer Investition in den Fonds und den Umsätzen der investierten Unternehmen.

3. Soziale Wirkung

Der Indikator „soziale Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 47,22 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

Der Indikator berechnet sich aus der Summe der Umsätze der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen in den Geschäftsfeldern nahrhafte Nahrung, erschwingliche Immobilien, Behandlung von Krankheiten, Sanitärprodukte, Konnektivität, Finanzierung von kleineren und mittleren Unternehmen und hochwertige Bildung, jeweils gewichtet mit dem Anteil der Investition am Fondsvermögen. Dabei handelt es sich um Geschäftsfelder, in denen Produkte oder Dienstleistungen angeboten werden, die zur Erreichung von sozialen Zielen (basierend auf den SDGs) beitragen. Es werden sowohl direkte Investitionen in Unternehmen über Aktien und Anleihen als auch indirekte Investitionen über Zielfonds berücksichtigt. Die Gesamtsumme wird mit 1.000 Euro investiertem Kapital ins Verhältnis gesetzt. Die Berechnung des Indikators basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt den Durchschnitt der Datenlage an den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum wider.

Hinweis: Der Indikator dient lediglich zur Veranschaulichung. Die Investitionen in die Unternehmen sind nicht zweckgebunden an die Bereitstellung von Produkten bzw. Dienstleistungen, die zur Erreichung von Umweltzielen beitragen, d.h. es besteht kein kausaler Zusammenhang zwischen einer Investition in den Fonds und den Umsätzen der investierten Unternehmen.

4. Durchschnittlicher MSCI Government ESG Score

Der Indikator „Government ESG Score“ betrug im Berichtszeitraum 6,49.

Der Indikator misst den durchschnittlichen MSCI Government ESG Score der staatlichen und staatsnahen Emittenten im Portfolio. Der MSCI Government ESG Score ist ein Indikator für Staaten, der von dem Researchanbieter MSCI ESG Research LLC bereitgestellt wird. Der Score misst die Fähigkeit von Staaten, zentrale mittel- bis langfristige Risiken und Chancen zu steuern, die mit ESG-Faktoren zusammenhängen. Er wird zum einen auf Basis von Indikatoren berechnet, die die Gefährdung der Staaten gegenüber Nachhaltigkeitsrisiken aufgrund natürlicher und institutioneller Gegebenheiten (z.B. deren Anfälligkeit für Umweltereignisse, wirtschaftliche Rahmenbedingungen und Strafrechtssysteme) messen. Zum anderen werden zur Ermittlung des Scores Indikatoren herangezogen, die den Umgang der Staaten mit Nachhaltigkeitsrisikofaktoren (z.B. deren Umgang mit Energie- und Wasserressourcen, deren Fähigkeit soziale Grundbedürfnisse zu decken und deren Umgang mit politischen Rechten und bürgerlichen Freiheiten) bewerten. Der Wert kann zwischen 0 (schlechtester Wert) und 10 (bester Wert) liegen. Je höher der Wert, desto besser wird die langfristige Nachhaltigkeit des jeweiligen Staates bewertet. Die Berechnung des Indikators basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt den Durchschnitt der Datenlage an den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum wider.

Der Score wurde erreicht durch den Ausschluss von Staaten, die beispielsweise politische Rechte und bürgerliche Freiheiten einschränken, und die Anlage des Fondsvermögens in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und sozialem Ziel.

● ...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Referenzperiode	31.12.2022- 31.12.2023	31.12.2021- 31.12.2022
ESG Government Score	6,49 ESG6,12	ESG Score
	Score	Score
Anzahl Verletzungen der Ausschlusskriterien	0,00	0,00
	Verletzungen	Verletzungen
Ökologische Wirkung (pro 1.000 €)	53,55 €	41,90 €
Soziale Wirkung (pro 1.000 €)	47,22 €	51,16 €
Anteil Investitionen mit E/S-Merkmal	96,66%	86,68%
Nachhaltige Investitionen	24,90%	14,27%
Anteil der taxonomiekonformen Investitionen	0,00%	0,00%
Anteil der anderen ökologisch nachhaltigen Investitionen	16,06%	7,53%
Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen	8,84%	6,74%
Andere E/S Merkmale	71,76%	72,41%
Anteil der Sonstigen Investitionen	3,34%	13,32%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen verfolgten das Ziel, einen Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der 17 SDGs zu leisten.

Dazu wurde im Berichtsjahr teilweise direkt und indirekt in Unternehmen investiert, die Produkte oder Dienstleistungen anbieten, die zur Erreichung eines oder mehrerer SDGs beitragen. Dazu wurden bestimmte Geschäftsfelder mit Beitrag zu den SDGs identifiziert. Dies umfasst die Geschäftsfelder alternative Energien, Energieeffizienz, nachhaltiges Bauen, nachhaltige Landwirtschaft, nachhaltige Wasserwirtschaft, Vermeidung von Umweltverschmutzung durch eine Minimierung der Abfallerzeugung, nahrhafte Nahrung, erschwingliche Immobilien, Behandlung von Krankheiten, Sanitärprodukte, Konnektivität, Finanzierung von kleineren und mittleren Unternehmen und hochwertige Bildung. Der positive Beitrag der Unternehmen zu den nachhaltigen Investitionszielen wurde an den Umsätzen gemessen, die die Unternehmen in diesen Geschäftsfeldern erwirtschafteten. Dabei wurde jeweils nur der Umsatzanteil der Unternehmen als nachhaltige Investition gewertet, der in den zuvor genannten Geschäftsfeldern mit Beitrag zu den SDGs erfolgte. Die Daten zur Messung des Beitrags zu den nachhaltigen Investitionszielen basieren auf internem Research sowie dem externen Researchanbieter MSCI ESG Research LLC.

Sofern darüber hinaus in Staaten investiert wurde, wurden die Staaten ausgewählt, die im Vergleich zum Rest der Welt fortschrittlicher bei der Erreichung der SDGs sind. Der positive Beitrag von Staaten wird anhand deren Nachhaltigkeitsbewertung im Vergleich zum Rest der Welt gemessen. Dazu wurde eine Kennzahl herangezogen, die den Fortschritt von Staaten bei der Erreichung der SDGs misst. Zur Berechnung der Kennzahl werden jedem SDG quantitative Indikatoren mit einem Optimalwert zugrunde gelegt, an dem die Leistung der Staaten gemessen wird. Die Kennzahl wird vom UN Sustainable Development Solutions Network (SDSN) in Zusammenarbeit mit der Cambridge University Press und der Bertelsmann Stiftung bereitgestellt und basiert unter anderem auf Daten öffentlicher Institutionen wie der Weltgesundheitsorganisation oder der Weltbank. Die Messung des Beitrags der nachhaltigen Investitionen in Staaten erfolgte auf Basis der Nachhaltigkeitsbewertung unter Anwendung eines Best-In-Class-Ansatz. Hierbei wurde nur der Anteil der Nachhaltigkeitsbewertung, der in der oberen Hälfte liegt zum Anteil nachhaltiger Investitionen angerechnet. Staaten, deren Nachhaltigkeitsbewertung in der unteren Hälfte liegt, wurden nicht als nachhaltig bewertet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Zudem konnten nachhaltige Investitionen in der Form von Staats- oder Unternehmensanleihen getätigt werden, deren Mittelverwendung an die Finanzierung von ökologischen und/ oder sozialen Projekten z.B. aus den Bereichen Erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Gesundheitswesen, Bildung oder Sanitäreinrichtungen gebunden ist (sogenannte Green Bonds, Social Bonds oder Sustainability Bonds) und die damit zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs beitragen.

Mit den nachhaltigen Investitionen, die dieses Finanzprodukt tätigte, wurden keine Umweltziele gemäß Artikel 9 der EU Taxonomie (Verordnung (EU) 2020/852) verfolgt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Damit die nachhaltigen Investitionen den ökologischen oder sozialen Anlagezielen trotz eines positiven Beitrags nicht gleichzeitig erheblich schaden, wurden die nachteiligen Auswirkungen der Unternehmen und Staaten, in die der Fonds investierte, auf Nachhaltigkeitsfaktoren aus den Bereichen Umwelt und Soziales berücksichtigt. Hierzu wurden die von der EU entwickelten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (nachfolgend auch Principal Adverse Impacts oder PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1) herangezogen. Diese PAI-Indikatoren sollen dazu dienen, die negativen Effekte zu messen, die Unternehmen und Staaten auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung haben.

Die Auswahl der Emittenten erfolgte unter Berücksichtigung von definierten Schwellenwerten für die einbezogenen PAI-Indikatoren. Dadurch wurden negative Effekte in Bezug auf die nachhaltigen Anlageziele begrenzt. Eine Auflistung der PAI-Indikatoren findet sich im darauffolgenden Abschnitt „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Darüber hinaus berücksichtigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum grundsätzlich bei allen Anlageentscheidungen in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Zielfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Informationen hierzu finden sich im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei den nachhaltigen Investitionen wurden für ausgewählte Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) Schwellenwerte festgelegt. Investitionen des Finanzprodukts wurden nur als nachhaltig bewertet, wenn die nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren der Unternehmen, Staaten und/ oder Zielfonds bei diesen Indikatoren definierte Schwellenwerte nicht überschritten.

Folgende PAI-Indikatoren werden bei den nachhaltigen Investitionen in Unternehmen berücksichtigt:

- Treibhausgasemissionsintensität (PAI 3 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (PAI 5 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

- Anzahl der Fälle von schwerwiegenden Menschenrechtsverletzungen und sonstigen Vorfällen (PAI 14, aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 3)

Folgende PAI-Indikatoren werden bei den nachhaltigen Investitionen in Staaten berücksichtigt:

- Treibhausgasemissionsintensität (PAI 15 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI 16 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

Folgende PAI-Indikatoren werden bei den nachhaltigen Investitionen in Zielfonds berücksichtigt:

- CO₂-Fußabdruck der Unternehmen (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Treibhausgasemissionsintensität der Staaten (PAI 15 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts in Unternehmen, hielten die Unternehmen einen definierten Schwellenwert bei der CO₂-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und Energieverbrauchsintensität ein und waren nicht an der Herstellung oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen beteiligt. Zudem wurden keinem der Unternehmen bei den nachhaltigen Investitionen Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren und/ oder UN Global Compact Verstöße vorgeworfen.

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts in Staaten, hielten die Staaten einen definierten Schwellenwert bei der CO₂-Intensität ein. Zudem verstießen die Staaten bei den nachhaltigen Investitionen nicht gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen und waren deshalb von der EU sanktioniert.

Bei allen nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, überstieg der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck der Unternehmen bzw. die CO₂-Intensität der Staaten im Zielfonds einen festgelegten Schwellenwert nicht. Zudem überstieg der Anteil des Sondervermögens im Zielfonds, das in Unternehmen investiert wurde, die gegen den UN Global Compact verstießen, einen definierten Schwellenwert nicht. Die nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, enthielten zudem keine Unternehmen, die an der Herstellung oder dem Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren.

Die Bewertung erfolgte hauptsächlich auf Basis von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Lagen bei einem Unternehmen, Staat oder Zielfonds keine Daten für mindestens einen der oben genannten PAI-Indikatoren vor, wurde die Investition nicht als nachhaltig eingestuft.

Verschlechterte sich die Bewertung für einen Emittenten oder Zielfonds im Laufe des Berichtszeitraums, sodass die definierten Schwellenwerte bzw. Ausprägungen bei mindestens einem der oben genannten Indikatoren nicht mehr eingehalten wurden, wurde die Investition nicht mehr als nachhaltig eingestuft und nicht mehr dem Anteil nachhaltiger Investitionen angerechnet.

Weitere PAI-Indikatoren wurden bei der allgemeinen PAI-Berücksichtigung bei allen Anlageentscheidungen des Finanzprodukts in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Zielfonds berücksichtigt. Informationen hierzu finden sich im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte definieren Leitlinien für die Anwendung guter Unternehmensführung in Bezug auf die Bekämpfung von Bestechung und Korruption, den Umgang mit Beschäftigten, Umweltschutz sowie die Achtung der Menschenrechte.

Die nachhaltigen Investitionen in Unternehmen standen insofern im Einklang mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, als dass mit den nachhaltigen Investitionen nicht in Wertpapiere von Unternehmen investiert wurde, denen Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren oder schwere UN Global Compact Verstöße vorgeworfen wurden. Investitionen in Zielfonds wurden nur als nachhaltige Investitionen bewertet, wenn höchstens 3% des Zielfonds in Unternehmen mit Verstößen gegen den UN Global Compact investiert wurden.

Der UN Global Compact umfasst 10 Prinzipien, die den Bereichen Menschenrechte, Arbeitnehmerrechte, Umwelt und Korruption zuzuordnen sind. Ist ein Unternehmen in eine oder mehrere ESG-Kontroversen verwickelt, bei denen glaubhafte Anschuldigungen bestehen, dass das Unternehmen oder dessen Geschäftsführung gegen diese Prinzipien verstoßen hat, so wird dies als „schwerer Verstoß“ gegen globale Normen wie die ILO („International Labour Organization“) Kernarbeitsnormen oder die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte gewertet. Dazu gehören z.B. Unternehmen, die Kinder- bzw. Zwangsarbeit anwenden.

Die Bewertung erfolgte hauptsächlich auf Basis von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Lagen bei einem Unternehmen, Staat oder Zielfonds keine Daten zur Überprüfung der Einhaltung der Prinzipien des UN Global Compact vor, wurde die Investition nicht als nachhaltig eingestuft.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Finanzprodukt berücksichtigte im Berichtszeitraum bei Anlageentscheidungen in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Zielfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts oder PAI). 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. Im Rahmen der PAI-Berücksichtigung wurden im Berichtsjahr systematische Verfahrensweisen zur Messung und Bewertung, sowie Maßnahmen zum Umgang mit den PAI im Investitionsprozess angewendet.

Die Messung und Bewertung der PAI der Unternehmen, Staaten und Zielfonds im Anlageuniversum erfolgte unter Verwendung von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Die PAI-Informationen für Unternehmen und Staaten wurden dem Portfoliomanagement des Finanzprodukts zur Berücksichtigung im Investitionsprozess zur Verfügung gestellt.

Durch die Anwendung verbindlicher, nachhaltigkeitsbezogener Ausschlusskriterien im Rahmen der ESG-Strategie wurde das Anlageuniversum des Fonds im Berichtsjahr eingeschränkt und die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen, die mit den Investitionen des Finanzprodukts im Berichtszeitraum verbunden waren, grundsätzlich begrenzt. Es wurde nicht in Unternehmen investiert, die Verfahrensweisen guter Unternehmensführung nicht achteten indem sie gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstießen und/ oder Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern wie der Herstellung von geächteten Waffen erwirtschafteten bzw. bei ihren Umsätzen bestimmte Schwellenwerte in kontroversen Geschäftsfeldern wie der Rüstungsgüterindustrie überschritten. Zudem wurde nicht in Zielfonds investiert, die eine Mindest-ESG-Bewertung nicht einhielten. Eine ausführliche Beschreibung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen, Staaten und Zielfonds geführt haben, findet sich im Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“. Die Einhaltung der Ausschlusskriterien wurde durch interne Kontrollsysteme dauerhaft geprüft.

Zudem wurden Unternehmen, die in umweltbezogene und/oder soziale Kontroversen verwickelt waren, anlassbezogen identifiziert und auch aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Um darüber hinaus spezifische, als besonders relevant erachtete PAI gezielt zu begrenzen, wurden je nach Höhe bzw. Ausprägung der PAI weitere Emittenten und Zielfonds aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Hierfür hat die Gesellschaft für eine Auswahl an PAI-Indikatoren Schwellenwerte definiert.

Für Unternehmen waren im Berichtszeitraum für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

- Treibhausgasemissionsintensität (PAI 3 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (PAI 6 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anzahl der Fälle von schwerwiegenden Menschenrechtsverletzungen und sonstigen Vorfällen (PAI 14, aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 3)

Für Staaten waren im Berichtszeitraum für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

- Treibhausgasemissionsintensität der Länder (PAI 15, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI 16, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen und Staaten, die die festgelegten Schwellenwerte überschritten bzw. Ausprägungen nicht einhielten, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger veräußert.

Der Fonds investierte nicht in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen, deren CO₂-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und/ oder Energieverbrauchsintensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt. Zudem wurde nicht in Unternehmen investiert, die gegen den UN Global Compact verstießen, denen in den letzten drei Jahren Menschenrechtsverletzungen vorgeworfen wurden und/oder die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren. Darüber hinaus wurde nicht in Staaten investiert, deren CO₂-Intensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt und/ oder die gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen verstießen und deshalb von der EU sanktioniert waren.

Verschlechterte sich die Bewertung für ein Unternehmen oder Staat seit Einführung der jeweiligen Schwellenwerte, sodass der Schwellenwert bzw. die Ausprägung für einen oder mehrerer der zuvor genannten PAI-Indikatoren nicht mehr eingehalten wurde, wurden die Portfoliomanager auf die Änderung aufmerksam gemacht und es galten interne Verkaufsfristen für die Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der betroffenen Unternehmen und Staaten.

Für weitere PAI-Indikatoren erfolgte die Bewertung der Unternehmen und Staaten im Anlageuniversum auf kontinuierlicher Basis durch Nachhaltigkeitsanalysten. Auf Basis dieser Bewertung wurden gegebenenfalls weitere Unternehmen und Staaten aus dem Anlageuniversum des Finanzprodukts ausgeschlossen. Folgende PAI-Indikatoren für Unternehmen wurden im Rahmen dieser Maßnahme betrachtet:

- Treibhausgasemissionen (PAI 1 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- CO₂-Fußabdruck (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (PAI 4 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (PAI 5 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Emissionen in Wasser (PAI 8 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (PAI 9 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (PAI 12 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress (PAI 8 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 2)

Für Zielfonds waren für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

- CO₂-Fußabdruck (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Treibhausgasemissionsintensität der Länder (PAI 15, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

Zudem wurden seit dem 01.10.2023 für folgende weitere PAI-Indikatoren für Zielfondsinvestments Schwellenwerte festgelegt:

- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Emissionen in Wasser (PAI 8 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (PAI 9 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

Darüber hinaus wurde im Rahmen der Mitwirkungspolitik der Verwaltungsgesellschaft Maßnahmen ergriffen, um auf eine Reduzierung der PAI der Unternehmen im Anlageuniversum hinzuwirken. Dazu nutzte die Verwaltungsgesellschaft zum einen ihr Stimmrecht auf Hauptversammlungen. Zum anderen trat die Verwaltungsgesellschaft mit Unternehmen, die bestimmte Schwellenwerte bei PAI-Indikatoren oder anderen ESG-Kennzahlen überschritten und/ oder in ESG-Kontroversen verwickelt waren, in Dialog. In den Gesprächen wurden die Unternehmen auf Missstände aufmerksam gemacht und auf Lösungswege hingewiesen. Die Schwerpunkte sowie die Ergebnisse der Engagementaktivitäten sind im Engagement-Bericht der Verwaltungsgesellschaft des Fonds zu finden. Der aktuelle Engagement-Bericht sowie die Abstimmungsergebnisse auf Hauptversammlungen sind unter folgendem Link abrufbar: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.01.2023 - 31.12.2023

In der Tabelle werden die fünfzehn Investitionen aufgeführt, auf die im Berichtszeitraum der größte Anteil aller getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel, mit Angabe der Sektoren und Länder, in die investiert wurde.

Die Angaben zu den Hauptinvestitionen beziehen sich auf den Durchschnitt der Anteile am Sondervermögen zu den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Abweichungen zu der Vermögensaufstellung im Hauptteil des Jahresberichts, die stichtagsbezogen zum Ende des Berichtszeitraums erfolgt, sind daher möglich.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AIS-Amun.Idx US Corp. SRI A.N.UCIT.ETF USD A.N (LU1806495575)	Zielfonds	11,44%	Luxemburg
iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares (IE00BYVJRP78)	Zielfonds	5,04%	Irland
iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares (IE00BYZTVT56)	Zielfonds	3,31%	Irland
L&G ESG Em.Mkts Corp.Bd ETF Reg.Shs Dis. (IE00BLRPRF81)	Zielfonds	2,93%	Irland
DekaLux-Geldmarkt: EURO Inhaber-Anteile (LU0052863874)	Zielfonds	2,09%	Luxemburg
Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 21/23 (DE0001104867)	Staatsanleihen	1,98%	Deutschland
xtrackers MSCI China Inhaber-Anteile 1C (LU0514695690)	Zielfonds	1,78%	Luxemburg
SPDR BI.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist) (IE00B4613386)	Zielfonds	1,39%	Irland
iShs II-§ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis. (IE00BKF09C98)	Zielfonds	1,18%	Irland
Koenigreich Spanien Bonos 22/32 (ES0000012K20)	Staatsanleihen	1,02%	Spanien
iShsIV-MSCI USA SRI UCITS ETF Reg.Shares (IE00BYVJRR92)	Zielfonds	1,01%	Irland
Microsoft Corp. Reg.Shares (US5949181045)	Software & Dienste	0,97%	Vereinigte Staaten
Tesla Inc. Reg.Shares (US88160R1014)	Automobile & Komponenten	0,90%	Vereinigte Staaten
Tschechien Bonds S.97 15/23 (CZ0001004600)	Staatsanleihen	0,77%	Tschechien
The Home Depot Inc. Reg.Shares (US4370761029)	Vertrieb u. Einzelhandel für Nicht-Basiskonsumgüter	0,77%	Vereinigte Staaten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale beitrugen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale) betrug im Berichtszeitraum 97%. Darunter fallen alle Investitionen, die die im Rahmen der verbindlichen Elemente der ESG-Anlagestrategie definierten Ausschlusskriterien des Fonds einhielten.

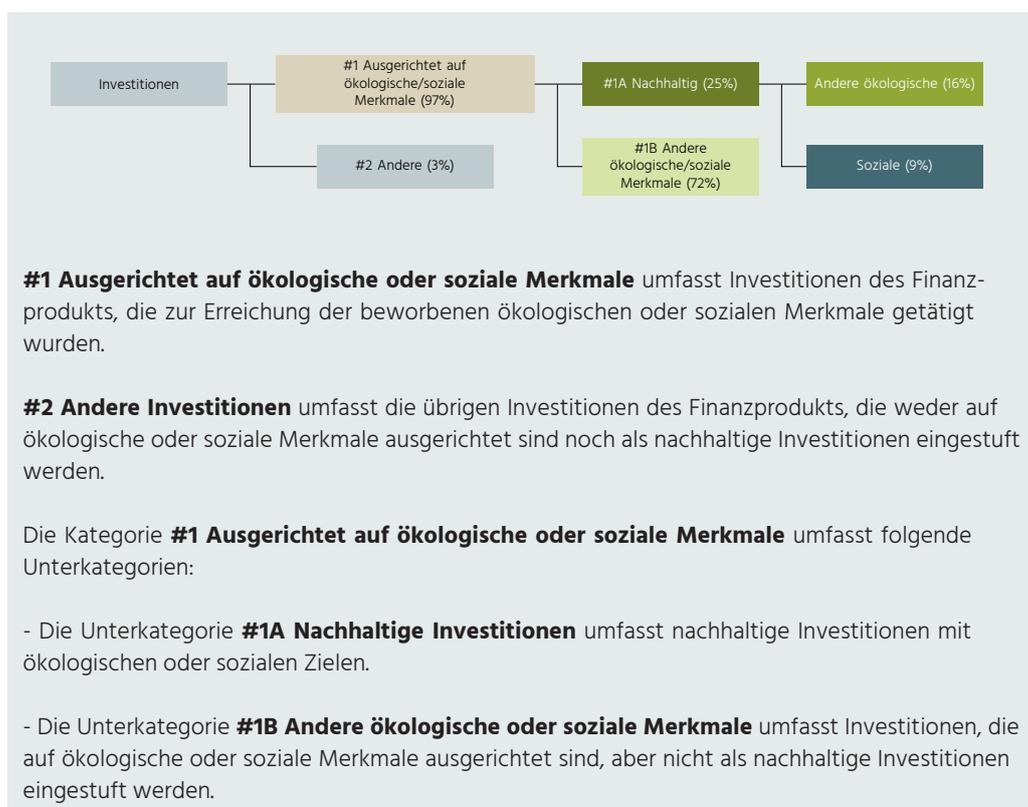
Nachhaltige Investitionen (#1A Nachhaltig) im Sinne des Artikel 2 Nr.17 der Offenlegungsverordnung ((EU) 2019/2088) sind alle Investitionen des Finanzprodukts in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beitragen, vorausgesetzt, dass diese Investitionen keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Der Anteil nachhaltiger Investitionen betrug im Berichtszeitraum 25%. Dabei wurden sowohl nachhaltige Investitionen mit Umweltziel als auch nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel getätigt.

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen wurde bei Unternehmen auf Basis deren Umsatzes, der zu den SDGs beiträgt, angerechnet. Bei Staaten fand eine Anrechnung zum Anteil der nachhaltigen Investitionen auf Basis deren Nachhaltigkeitsbewertung, die den Fortschritt bei der Erreichung der SDGs misst, (zwischen 0 und 100%) statt. Bei Wertpapieren, deren Mittelverwendung an die Finanzierung von nachhaltigen Wirtschaftsaktivitäten gebunden war (z.B. Green Bonds, Social Bonds oder Sustainability Bonds), wurde die komplette Investition in das Wertpapier als nachhaltig angerechnet.

Eine Beschreibung der Investitionen, die nicht auf die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds ausgerichtet waren, findet sich im Abschnitt „Welche Investitionen fielen unter „Andere

Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“.

Die Angaben in der Grafik stellen den Durchschnitt der Vermögensallokation aus den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums dar und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Geringfügige Abweichungen in der prozentualen Gewichtung der Investitionen resultieren aus rundungsbedingten Differenzen.



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In welchen Wirtschaftssektoren und Teilssektoren das Finanzprodukt während des Berichtszeitraums investierte, ist in der nachfolgenden Tabelle dargestellt.

Die Zuteilung der Investitionen zu den Sektoren und Teilssektoren erfolgte auf Basis von Daten von externen Researchanbietern sowie internem Research. Staaten und staatsnahe Emittenten wurden unter „Staatsanleihen“ sowie „Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen“ zusammengefasst. Für Investitionen in Zielfonds erfolgte keine Durchschau auf die im Zielfonds enthaltenen Emittenten, sondern ein separater Ausweis aller im Sondervermögen enthaltenen Zielfonds unter „Zielfonds“. Unter „Sonstige“ fielen Bankguthaben, Derivate, Forderungen und Emittenten, für die keine Branchenzuteilung vorlag.

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 5,32% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilssektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC zurückgegriffen. Der Anteil beinhaltet Unternehmen, die Umsätze im Bereich der fossilen

Brennstoffe, einschließlich der Förderung, Verarbeitung, Lagerung und dem Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie thermischer und metallurgischer Kohle erwirtschaften.

Die Berechnung der Anteile basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen.

Sektor	Anteil
Basiskonsumgüter	5,42%
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	1,79%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	2,79%
Vertrieb und Einzelhandel von Basiskonsumgütern	0,84%
Energie	0,27%
Energie	0,27%
Finanzwesen	11,90%
Banken	6,29%
Finanzdienstleistungen	2,51%
Versicherungen	3,10%
Gesundheitswesen	6,12%
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	2,57%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	3,55%
Immobilien	1,10%
Gebäudemanagement & Immobilienentwicklung	0,43%
Immobilienvermögensgesellschaften	0,67%
Industrie	8,36%
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	1,43%
Investitionsgüter	4,78%
Transportwesen	2,15%
Informationstechnologie	5,81%
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	2,05%
Hardware & Ausrüstung	0,78%
Software & Dienste	2,98%
Kommunikationsdienste	4,33%
Medien & Unterhaltung	0,97%
Telekommunikationsdienste	3,36%
Nicht-Basiskonsumgüter	6,69%
Automobile & Komponenten	2,32%
Dienstleistungsunternehmen	1,19%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	1,31%
Vertrieb u. Einzelhandel für Nicht-Basiskonsumgüter	1,87%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,87%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,87%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	3,03%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	3,03%
Sonstige	3,34%
Sonstige	3,34%
Staatsanleihen	7,59%
Staatsanleihen	7,59%
Versorgungsbetriebe	4,05%
Versorgungsbetriebe	4,05%
Zielfonds	31,11%
Zielfonds	31,11%



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht nachweisbar in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu keinem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug demnach 0% (gemessen an den drei Leistungsindikatoren OpEx, CapEx und Umsatz).

Ein gewisser Anteil des Fondsvermögens war in Staatsanleihen investiert. Für Staatsanleihen existiert bislang allerdings keine anerkannte geeignete Methode, um den Anteil der Taxonomiekonformen Aktivitäten zu ermitteln. Der Anteil taxonomiekonformer Investitionen beträgt demnach mit und ohne Staatsanleihen 0%.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

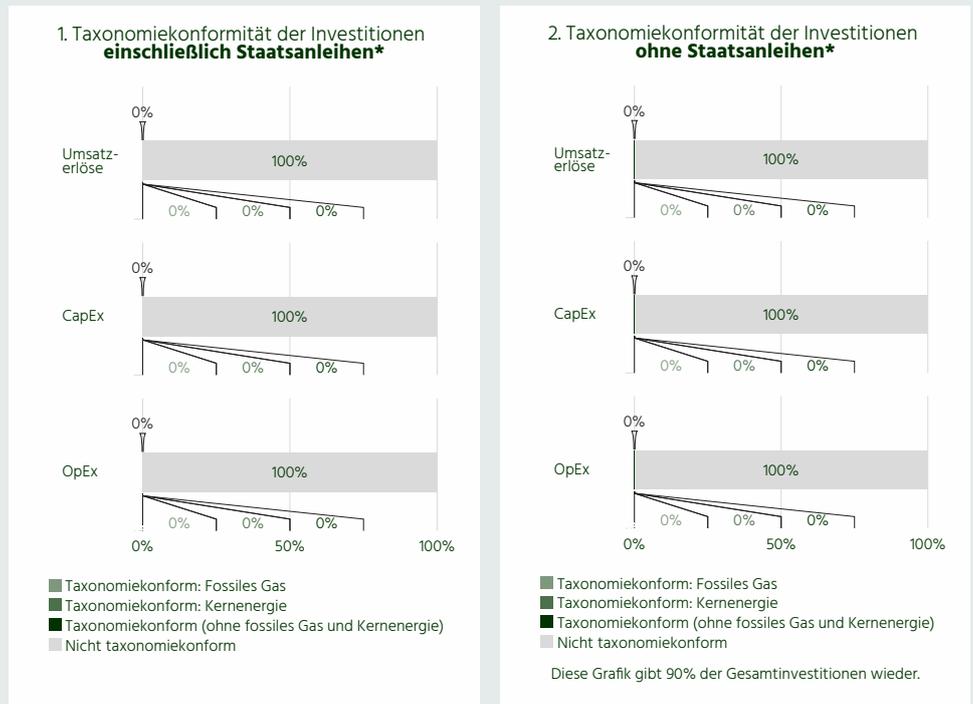
Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Art der Wirtschaftstätigkeit	Anteil
Ermöglichende Tätigkeiten	0,00%
Übergangstätigkeiten	0,00%

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Es war nicht Teil der Anlagestrategie des Finanzprodukts in Wirtschaftsaktivitäten zu investieren, die taxonomiekonform sind. Vielmehr wurde mit den nachhaltigen Investitionen ein allgemeiner Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs angestrebt. Demnach investierte das Finanzprodukt in Wirtschaftstätigkeiten mit Umweltzielen, die nicht taxonomiekonform sind.

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel betrug 16,06%.

Die Berechnung des Anteils basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 8,84%.

Die Berechnung des Anteils basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Unter „Andere Investitionen“ fielen alle Investitionen, die nicht nach den verbindlichen Elementen der ESG-Anlagestrategie ausgewählt wurden und damit nicht ausgerichtet auf die ökologischen und sozialen Merkmale des Finanzprodukts waren. Im Berichtszeitraum gehörten hierzu Investitionen in

- Derivate und andere derivative Instrumente wie zum Beispiel Optionen, Futures und Swaps. Die Investitionen dienten zur Risikoabsicherung z.B. gegen Kursschwankungen oder zu Investitionszwecken, aber nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale.
- Bankguthaben sowie flüssige Mittel (z.B. Sichteinlagen oder Festgelder). Diese wurden aus Liquiditätszwecken gehalten.

Bei diesen Investitionen wurde ein ökologischer und sozialer Mindestschutz angewendet, in der Form, dass auch mit diesen Investitionen nicht in Hersteller geächteter und kontroverser Waffen

investiert wurde. Zudem wurde im Rahmen dieser Investitionen nicht in Produkte investiert, die die Preisentwicklung von Grundnahrungsmitteln abbilden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Überwachung der Konformität der Investitionsentscheidungen mit den ökologischen und sozialen Merkmalen erfolgte im Rahmen von standardisierten Prozessen. Es wurden nur Investitionsentscheidungen getroffen und entsprechende Kauf- oder Verkaufstransaktionen durchgeführt, welche im Rahmen der Vorabprüfung den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie entsprachen. Eine Transaktion konnte nicht ausgeführt werden, wenn sie gegen die im Rahmen der Anlagestrategie festgelegten Ausschlusskriterien verstieß. Lagen für einen Emittenten keine Daten oder ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen vor und waren betriebseigene Recherchen nicht möglich, wurde in die Wertpapiere dieser Unternehmen oder Staaten nicht investiert.

Bei der Identifikation von schweren Kontroversen (z.B. schwere Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact) galten interne Fristen für den Verkauf der betroffenen Titel. Das Portfoliomanagement erhielt zudem regelmäßig für die Investitionsentscheidung relevante Informationen bezüglich Veränderungen im investierbaren Anlageuniversum.

Um den Investitionsentscheidungsprozess zu unterstützen, wurde die hauseigene Research-Plattform um Informationen und Daten zu Nachhaltigkeitsaspekten erweitert. Zudem wurden den Entscheidungsträgern über die Handelssysteme relevante Datenpunkte für Investitionsentscheidungen zur Verfügung gestellt. Die Plattform kombiniert externe Daten und ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen mit internen Recherchen sowie Analysen und wird um relevante Erkenntnisse aus Gesprächen mit Unternehmensvertretern ergänzt. Das Portfoliomanagement wurde im Rahmen regelmäßiger Schulungen über Neuerungen und Wissenswertes durch das ESG-Team der Verwaltungsgesellschaft informiert.

Im Rahmen der Mitwirkungspolitik, nahm die Verwaltungsgesellschaft zudem ihre Rolle als aktiver Investor wahr. Bei Unternehmen mit kritischen Geschäftsaktivitäten versuchte sie ihren Einfluss als aktiver Aktionär zu nutzen, um diese Unternehmen zu einem nachhaltigeren und verantwortlicheren Wirtschaften zu bewegen. Hierzu trat die Gesellschaft in den aktiven und zielgerichteten Dialog mit ausgewählten Unternehmen zu Themen wie Umweltschutz und Klimawandel. Wurden ESG-Kontroversen bei Unternehmen identifiziert, wurden diese darauf angesprochen und zur Aufklärung bzw. Beseitigung des Missstandes aufgefordert. Die angesprochenen Themen wurden dokumentiert und die Entwicklung nachverfolgt. Zudem übte die Gesellschaft ihre Aktionärsrechte auf Hauptversammlungen aus und stimmte regelmäßig auf Hauptversammlungen ab. Details zu den Abstimmungsergebnissen und zu den Schwerpunkten sowie den Ergebnissen der Mitwirkungspolitik sind unter folgendem Link abrufbar: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Frankfurt am Main, den 26. März 2024
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

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

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 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 Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset 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 28. März 2024

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)
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

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. Dezember 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

