Jahresbericht zum 31. Dezember 2022.

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.





# Bericht der Geschäftsführung.

31. Dezember 2022

### Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-ESG Sigma Plus Konservativ für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022.

An den internationalen Finanzmärkten bildete bis in das erste Quartal 2022 hinein die Corona-Pandemie und ihre Auswirkungen den primären Einflussfaktor. Die von Impffortschritten und hoher Liquidität am Markt getriebene Erholung der globalen Wirtschaft sowie die starke Nachfrage an den Aktienmärkten fand im Februar mit dem Einmarsch Russlands in die Ukraine eine abrupte Zäsur. Die als Reaktion hierauf initiierten Sanktionsmaßnahmen des Westens gegen den russischen Aggressor setzten eine Vergeltungsspirale in Gang, in deren Folge Russland u.a. einen Lieferstopp bzw. reduzierte Liefermengen von Gas an verschiedene europäische Länder veranlasste. Exorbitante Preissteigerungen sowie wachsende Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im Winter sorgten für große Verunsicherung, insbesondere in Europa.

In der Geld- und Fiskalpolitik rückte im Laufe des Berichtszeitraums die sprunghafte Inflationsentwicklung in den Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu einer scharfen Zinswende zwang. Während die Fed zum Stichtag mittlerweile bei einem Leitzinsintervall von 4,25 bis 4,50 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen seit Juli 2022 bislang erst auf 2,50 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in den kommenden Monaten in Aussicht gestellt, wobei die Zinsschritte zuletzt gemäßigter ausfielen. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo merklich an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,6 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,9 Prozent.

Angesichts zahlreicher Belastungsfaktoren und Unsicherheiten wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode starke Schwankungen auf. Zwischen Februar und September kam es zu einer ausgeprägten Korrekturphase, ehe in den letzten Monaten eine Gegenbewegung einsetzte. Stark unter Druck geriet der Euro, der zeitweise unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, ehe zum Ende des Berichtszeitraums eine deutliche Erholung festzustellen war. Explodierte der Ölpreis im ersten und zweiten Quartal noch regelrecht, so befand er sich im letzten Halbjahr 2022 hingegen auf Talfahrt und lag zuletzt deutlich unter 100 US-Dollar pro Barrel (Brent).

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)

Thomas Ketter Thomas Schneider

# Inhalt.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022	7
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022	8
Anhang	21
Ökologische und/oder soziale Merkmale	26
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	43
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	45

# Jahresbericht 01.01.2022 bis 31.12.2022 Deka-ESG Sigma Plus Konservativ Tätigkeitsbericht.

Das Anlageziel des Fonds Deka-ESG Sigma Plus Konservativ ist ein mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und die positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Der Investmentfonds darf mehr als 35 Prozent des Wertes des Fondsvermögens in Schuldverschreibungen, Schuldscheindarlehen und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland, der deutschen Bundesländer, der Europäischen Union, der Mitgliedstaaten der Europäischen Union, der Vereinigten Staaten von Amerika und der Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) anlegen. Der quantitativ und aktiv gemanagte Fonds kann weltweit in unterschiedliche Anlageklassen investieren. Im Rahmen des Wertpapierauswahlprozesses 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 35 Prozent. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen der quantitativen Anlagestrategie "Sigma Plus". Bei dieser werden auf monatlicher Basis die erwarteten Erträge aller relevanten Anlageklassen und Märkte prognostiziert sowie die aktuelle Prognosegüte bewertet. Beides fließt anschließend in ein robustes Optimierungsverfahren ein, worüber die optimale Zusammensetzung des Portfolios auf Ebene der verschiedenen Kategorien von Vermögensgegenständen bestimmt wird. Für die Kategorien Aktien und Unternehmensanleihen folgt danach üblicherweise eine auf einer großen Anzahl von Faktoren basierende Einzeltitelauswahl sowie im Rentenportfolio eine aktive Durationssteuerung. Das Konzept strebt dabei die Erzielung einer stabilen Wertentwicklung mit kontrolliertem Risiko bei gleichzeitigem Fokus auf absoluten Ertrag an. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Details zu den ökologischen und/oder sozialen Merkmalen gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 finden Sie im Anhang dieses Jahresberichts.

## **Negative Wertentwicklung**

Die Direktanlagen in Anleihen lagen zum Stichtag bei 52,1 Prozent des Fondsvolumens. Im Fokus standen Unternehmensanleihen, wovon ein Teil mit besonderen Ausstattungen versehen war. Dahinter folgten Bestände in Staatsanleihen und Papiere halbstaatlicher Emittenten. Auf unterschiedliche Rentenfonds entfielen Ende Dezember 5,8 Prozent. Durch Derivate (Futures und Swaps) reduzierte sich der Investitionsgrad in Renten signifikant um über 40 Prozentpunkte. Besicherte Papiere sowie Geldmarktfonds befanden sich zuletzt nicht mehr im Bestand.

## Wichtige Kennzahlen Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	seit Auflegung
			p.a.
	-10,5%	-	-3,0%
ISIN	DE000DK0V6C5		
* Berechnung nac	h BVI-Methode, die bisher	ige Wertentwicklun	g ist kein

## Veräußerungsergebnisse im Berichtszeitraum Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung

Realisierte Gewinne aus	in Euro
Renten und Zertifikate	633,31
Aktien	1.751.304,46
Zielfonds und Investmentvermögen	14.047,26
Optionen	433.395,39
Futures	5.874.716,38
Swaps	0,00
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	3.599.643,94
Devisenkassageschäften	585.072,60
sonstigen Wertpapieren	565,44
Summe	12.259.378,78

Realisierte Verluste aus	in Euro
Renten und Zertifikate	-895.907,39
Aktien	-1.174.604,49
Zielfonds und Investmentvermögen	-157.848,80
Optionen	-1.438.142,49
Futures	-3.811.861,95
Swaps	0,00
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	-6.396.811,74
Devisenkassageschäften	-44.382,80
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	-13.919.559,66

Der Aktienanteil betrug zum Stichtag 35,2 Prozent, was in etwa dem Vorjahresniveau entspricht. US-amerikanische und europäische Aktien führten dabei die Länderaufstellung an. Hinzu kamen unter anderem Engagements in Japan, Australien und Israel. Durch Derivate (Futures und Optionen) wurde der Investitionsgrad in Aktien um 15,5 Prozentpunkte verringert. Die Branchengewichtungen ergaben sich implizit aus der Länderallokation und Einzelaktienüberlegungen.

Daneben waren ein gemischter Fonds mit Volatilitätskonzept im Portfolio enthalten. Mehr als die Hälfte der Anlagen notierten in Fremdwährungen. Mittels Devisentermingeschäften wurden partiell Währungsabsicherungen vorgenommen.

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.

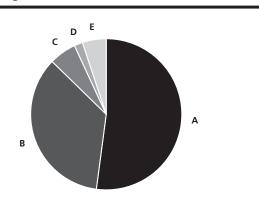
Die Risiken von Investmentanteilen, die für einen Fonds erworben werden (so genannte "Zielfonds"), stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Zielfonds enthaltene Vermögensgegenständen. Da die Manager der einzelnen Zielfonds voneinander unabhängig handeln, kann es vorkommen, dass mehrere Zielfonds gleiche Engagements tätigen.

Dieses Sondervermögen enthält Anteile an anderen Fonds, die in Aktien und Renten investieren. Insofern unterliegt der Fonds mittelbar spezifischen 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.

Die Wertentwicklung des Deka-ESG Sigma Plus Konservativ lag im Berichtszeitraum bei minus 10,5 Prozent. Zum Stichtag betrug das Fondsvolumen 92,9 Mio. Euro.

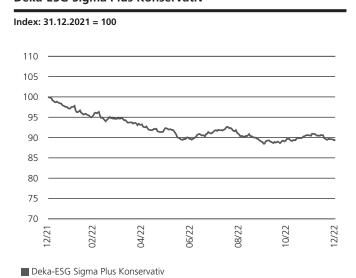
## Fondsstruktur Deka-ESG Sigma Plus Konservativ



Α	Renten	52,1%
В	Aktien	35,2%
C	Rentenfonds	5,8%
D	Gemischte Fonds	1,8%
Е	Barreserve, Sonstiges	5,1%

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-ESG Sigma Plus Konservativ



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

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land  I. Vermögensgegenstände	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
1. Aktien	32.536.775,97	35,00
Australien	253.329,45	0,28
Belgien	26.022,40	0,03
Dänemark	538.719,39	0,58
Deutschland	982.486,46	1,05
Finnland	374.349,49	0,40
Frankreich	1.228.012,76	1,31
Großbritannien	668.837,62	0,72
Irland	464.124,27	0,50
Israel	162.580,09	0,18
Italien	265.216,15	0,28
Japan .	1.829.450,66	1,97
Kanada	1.687.977,49	1,83
Neuseeland Niederlande	41.583,61	0,04
Niederlande Österreich	1.166.849,84	1,24
Schweden	281.974,80	0,31 0,46
Schweiz	426.959,46 821.891,66	0,46
Spanien	100.471,84	0,11
USA	21.215.938,53	22,82
2. Anleihen	47.883.255,15	51,58
Belgien	900.657,50	0,97
Dänemark	1.100.356,01	1,19
Deutschland	8.117.424,00	8,76
Finnland	467.312,50	0,50
Frankreich	3.570.849,76	3,83
Großbritannien	6.020.726,33	6,49
Italien	1.695.692,00	1,82
Luxemburg	377.910,52	0,41
Niederlande	4.071.568,99	4,39
Österreich	420.625,00	0,45
Schweden	399.850,00	0,43
Spanien	837.396,00	0,90
USA	19.902.886,54	21,44
3. Investmentanteile	7.125.999,83	7,68
Deutschland	1.709.307,00	1,84
Irland	548.342,04	0,59
Luxemburg  4. Constitute Westpaniers	4.868.350,79	5,25
4. Sonstige Wertpapiere Schweiz	<b>155.873,17</b> 155.873,17	<b>0,17</b> 0,17
5. Derivate	2.042.271,29	2,19
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	3.412.367,54	3,67
7. Sonstige Vermögensgegenstände	539.100,31	0,57
II. Verbindlichkeiten	-798.337,95	-0,86
III. Fondsvermögen	92.897.305,31	100,00
Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	32.536.775,97	35,00
AUD	253.329,45	0,28
CAD	1.687.977,49	1,83
CHF	722.853,90	0,78
DKK	538.719,39	0,58
EUR	4.207.469,27	4,50
GBP	767.875,38 1.830.450.66	0,83
JPY NZD	1.829.450,66	1,97 0,04
SEK	41.583,61 502.104,94	0,54
USD	21.985.411,88	23,65
2. Anleihen	47.883.255,15	51,58
EUR	19.938.829,20	21,46
GBP	5.563.451,09	6,00
USD	22.380.974,86	24,12
3. Investmentanteile	7.125.999,83	7,68
EUR	6.260.228,64	6,75
USD	865.771,19	0,93
4. Sonstige Wertpapiere	155.873,17	0,17
CHF	155.873,17	0,17
5. Derivate	2.042.271,29	2,19
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	3.412.367,54	3,67
7. Sonstige Vermögensgegenstände	539.100,31	0,57
II. Verbindlichkeiten	-798.337,95	-0,86
III. Fondsvermögen	92.897.305,31	100,00
*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.		

<sup>\*)</sup> Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung Mar	kt Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Bericht	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Börsengehandelt Aktien EUR	te Wertpapiere	wing.		iii bendic	32eiti auiii			62.383.835,62 32.536.775,97 4.207.469,27	67,15 35,00 4,50
IT0001233417 NL0011794037	A2A S.p.A. Azioni nom. Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aa	STK n STK	61.431 6.900	0 0	0	EUR EUR	1,267 27,130	77.802,36 187.197,00	0,08 0,20
DE0008404005 AT0000730007	toonder Allianz SE vink.Namens-Aktien Andritz AG Inhaber-Aktien	STK STK	976 2.688	0 2.688	0	EUR EUR	201,900 54,000	197.054,40	0,21 0,16
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK	2.000	123	65	EUR	511,200	145.152,00 146.203,20	0,16
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK	7.155	0	0	EUR	26,300	188.176,50	0,20
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien	STK	2.161	604	0	EUR	79,500	171.799,50	0,18
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK STK	3.363 667	0	0	EUR EUR	53,670 156,650	180.492,21 104.485,55	0,19 0,11
FR0000125338 NL0010545661	Capgemini SE Actions Port. CNH Industrial N.V. Aandelen op naam	STK	6.283	6.283	0	EUR	15,090	94.810,47	0,11
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Action au Porteur		1.635	1.635	0	EUR	46,085	75.348,98	0,08
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK	1.086	0	2.237	EUR	35,405	38.449,83	0,04
FR0000130452 DE0006231004	Eiffage S.A. Actions Port. Infineon Technologies AG Namens-Aktie	STK n STK	1.379 5.329	0 5.329	0	EUR EUR	92,180 28,635	127.116,22 152.595,92	0,14 0,16
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam	STK	9.029	9.029	0	EUR	11,454	103.418,17	0,10
FR0010259150	Ipsen S.A. Actions au Porteur	STK	787	0	0	EUR	101,300	79.723,10	0,09
IT0005211237	Italgas S.P.A. Azioni nom.	STK	12.653	0	0	EUR	5,270	66.681,31	0,07
FI0009000202 IT0000062957	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni	STK STK	5.169 13.320	0	0	EUR EUR	20,870 9,064	107.877,03 120.732,48	0,12 0,13
DE0007100000	nom. Mercedes-Benz Group AG	STK	2.686	0	0	EUR	61,560	165.350,16	0,18
DE0006599905	Namens-Aktien Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK	1.413	481	0	EUR	182,050	257.236,65	0,28
FI0009000681	Nokia Oyj Reg.Shares	STK	17.373	17.373	0	EUR	4,352	75.607,30	0,08
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien	STK	2.824	2.824	0	EUR	48,450	136.822,80	0,15
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK	2.839	2.839	0	EUR	59,800	169.772,20	0,18
NL0000379121 ES0173093024	Randstad N.V. Aandelen aan toonder Red Electrica Corporacion S.A. Acciones	STK STK	3.093 6.104	761 0	0	EUR EUR	57,420 16,460	177.600,06 100.471,84	0,19 0,11
FR0000120578	Port. Sanofi S.A. Actions Port.	STK	2.390	0	0	EUR	90,720	216.820,80	0,23
NL00150001Q9	Stellantis N.V Aandelen op naam	STK	10.063	5.370	6.540	EUR	13,342	134.260,55	0,14
FI0009005961	Stora Enso Oyj Reg.Shares Cl.R	STK	8.704	8.704	0	EUR	13,295	115.719,68	0,12
BE0003826436	Telenet Group Holding N.V. Actions Non	n. STK STK	1.712	0	0	EUR	15,200	26.022,40	0,03
FR0000127771 FR0000121204	Vivendi SE Actions Porteur Wendel SE Actions Port.	STK	5.970 368	5.970 368	0	EUR EUR	9,000 87,900	53.730,00 32.347,20	0,06 0,03
NL0000395903 <b>AUD</b>	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK	1.826	0	0	EUR	98,900	180.591,40 <b>253.329,45</b>	0,19 <b>0,28</b>
AU0000261372	ANZ Group Holdings Ltd. Reg.Shares De		2.420	2.420	0	AUD	23,660	36.465,03	0,04
AU000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK	10.892	5.305 0	0	AUD	16,840	116.814,33	0,13
AU000000MGR9	Mirvac Group Reg.Stapled Units	STK	73.755	0	0	AUD	2,130	100.050,09 <b>1.687.977,49</b>	0,11 <b>1,83</b>
CA11284V1058	Brookfield Renewable Corp. Reg.Shs Cl., Sub.Vot.	A STK	1.900	1.900	0	CAD	37,690	49.577,86	0,05
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK	2.200	0	0	CAD	116,920	178.081,78	0,19
CA21037X1006 CA3759161035	Constellation Software Inc. Reg.Shares Gildan Activewear Inc. Reg.Shares	STK STK	100 3.500	0 3.500	0	CAD	2.134,790 36,830	147.796,17 89.243,74	0,16 0,10
CA5394811015	(Sub.Vtg) Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares	STK	1.900	0	800	CAD	120,220	158.138,76	0,17
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK	7.600	0	0	CAD	24,310	127.910,61	0,14
CA6665111002 CA67077M1086	Northland Power Inc. Reg. Shares	STK STK	3.900	3.900	0	CAD CAD	37,610	101.549,07 116.906,15	0,11 0,13
CA6837151068	Nutrien Ltd Reg.Shares Open Text Corp. Reg.Shares	STK	1.700 2.200	1.700 2.200	0	CAD	99,330 40,560	61.777,26	0,13
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)		5.700	0	2.400	CAD	28,930	114.164,56	0,12
CA7751092007	Rogers Communications Inc. Reg.Shares Cl.B		2.400	0	0	CAD	60,980	101.322,68	0,11
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK	2.100	0	0	CAD	63,360	92.117,57	0,10
CA0641491075 CA8911605092	The Bank of Nova Scotia Reg.Shares The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK STK	2.400 1.200	0 1.200	0	CAD CAD	66,630 88,540	110.710,56 73.557,81	0,12 0,08
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK	900	900	0	CAD	97,590	60.807,32	0,03
CA9528451052 <b>CHF</b>	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK	1.500	1.500	0	CAD	100,450	104.315,59 <b>722.853,90</b>	0,11 <b>0,78</b>
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK	1.093	0	0	CHF	107,820	119.481,16	0,13
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK	3.267	3.267	0	CHF	84,500	279.888,98	0,30
CH0244767585 CH0011075394	UBS Group AG Namens-Aktien Zurich Insurance Group AG NamAktier	STK STK	10.777 299	0	0 0	CHF CHF	17,265 444,800	188.644,63 134.839,13	0,20 0,15
DKK	A DMarllor Magrels A/C Nover - Alating	CTI	7.4	12	2	חאא	16 020 000	538.719,39	0,58
DK0010244508 DK0010181759	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B Carlsberg AS Navne-Aktier B	STK STK	71 1.013	12 0	0	DKK DKK	16.020,000 922,800	152.947,90 125.701,28	0,16 0,14
DK0060534915 GBP	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK	2.049	2.049	0	DKK	943,900	260.070,21 <b>767.875,38</b>	0,14 0,28 <b>0,83</b>
GB0031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares	STK	3.664	0	0	GBP	20,300	84.028,15	0,09
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG NamAktien	STK	4.475	4.475	0	GBP	19,590	99.037,76	
GB00BY9D0Y18 GB00BN7SWP63	Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Share GSK PLC Reg.Shares	s STK STK	41.126 10.080	0 10.080	0	GBP GBP	2,213 14,458	102.818,49 164.642,54	0,11 0,18
GP000H1/344E03	GSICTEC Registrates	211/	10.060	10.000	U	l <sub>ODE</sub>	14,430	104.042,34	1 0,10

ISIN	Gattungsbezeichnung Mark	t Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Bericht	Verkäufe/ Abgänge szeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC Reg.Shares	STK	15.201	15.201	0	GBP	5,690	97.714,21	0,11
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg.Shares	STK	18.451	0	0	GBP	2,372	49.443,35	0,05
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK	3.586	3.586	0	GBP	42,010	170.190,88	0,18
JPY					_			1.829.450,66	
JP3112000009	AGC Inc. Reg.Shares	STK	1.900	1.900	0	JPY	4.395,000	59.381,33	0,06
JP3942400007 JP3486800000	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares Daito Trust Constr. Co. Ltd. Reg.Shares	STK STK	7.200 1.000	7.200 0	0	JPY JPY	2.006,500	102.732,80	0,11
JP3219000001	Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares	STK	9.000	0	0	JPY	13.540,000 2.687,000	96.284,44 171.968,00	0,10
JP3918000005	Meiji Holdings Co.Ltd. Reg.Shares	STK	1.100	0	0	JPY	6.740,000	52.721,78	0,06
JP3695200000	NGK Insulators Ltd. Reg.Shares	STK	11.200	11.200	0	JPY	1.678,000	133.643,38	0,14
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares	STK	5.400	0	2.700	JPY	3.762,000	144.460,80	0,16
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Reg.Shares		2.800	2.800	0	JPY	3.110,000	61.923,56	0,07
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	4.000	4.000	0	JPY	3.083,000	87.694,22	0,09
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares	STK	11.000	0	1.400	JPY	2.118,500	165.713,78	0,18
JP3326000001 JP3165000005	Sankyu Inc. Reg.Shares	STK STK	3.300 2.600	0	0	JPY JPY	4.830,000	113.344,00	0,12
JP3402600005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares Sumitomo Metal Mining Co. Ltd.	STK	4.600	4.600	0	JPY	5.860,000 4.671,000	108.344,89 152.793,60	0,12 0,16
31 3402000003	Reg.Shares	3110	4.000	4.000	Ü	'''	4.071,000	132.733,00	0,10
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares	STK	6.000	4.000	1.600	JPY	2.827,500	120.640,00	0,13
JP3595200001	Tosoh Corp. Reg.Shares	STK	9.100	9.100	0	JPY	1.570,000	101.596,44	0,11
JP3939000000	Yamada Holdings Co. Ltd. Ltd.	STK	16.100	0	16.000	JPY	467,000	53.466,31	0,06
JP3942800008 <b>NZD</b>	Reg.Shares Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	4.800	4.800	0	JPY	3.010,000	102.741,33 <b>41.583.61</b>	0,11 <b>0,04</b>
NZTELE0001S4 SEK	Spark New Zealand Ltd. Reg.Shares	STK	12.966	12.966	0	NZD	5,400	41.583,61 502.104,94	0,04 0,04 <b>0,54</b>
SE0017486897	Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria)	STK	16.184	16.184	0	SEK	112,140	163.021,89	0,18
SE0000190126	Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria)	STK	172	0	0	SEK	256,300	3.959,83	0,00
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK	7.423	7.423	0	SEK	112,700	75.145,48	0,08
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	5.250	0	0	SEK	121,050	57.085,21	0,06
SE0000108656	Namn-Aktier A (fria) Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Akt. B (fria)	STK	9.332	0	0	SEK	61,570	51.611,13	0,06
SE0000114837 <b>USD</b>	Trelleborg AB Namn-Aktier B (fria)	STK	6.908	0	0	SEK	243,800	151.281,40 <b>21.985.411,88</b>	0,16 <b>23,65</b>
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares	STK	2.365	0	0	USD	110,310	244.444,27	0,26
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares	STK	1.476	694	0	USD	162,560	224.819,45	0,24
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A	STK	649	0	0	USD	268,380	163.203,20	0,18
US00507V1098	Activision Blizzard Inc. Reg.Shares	STK	1.801	0	0	USD	76,760	129.533,62	0,14
US00724F1012 US0079031078	Adobe Inc. Reg.Shares	STK STK	410 970	0 296	115 414	USD USD	337,580 64,820	129.686,39	0,14 0,06
US0010551028	Advanced Micro Devices Inc. Reg.Shares AFLAC Inc. Reg.Shares	STK	2.194	296	809	USD	72,080	58.913,47 148.178,51	0,06
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK	1.046	1.046	0	USD	151,090	148.081,65	0,16
US00971T1016	Akamai Technologies Inc. Reg.Shares	STK	1.761	0	0	USD	84,700	139.757,98	0,15
IE00BFRT3W74	Allegion PLC Reg.Shares	STK	1.219	0	0	USD	106,740	121.917,13	0,13
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C	STK	5.240	5.049	0	USD	88,950	436.728,04	0,47
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	3.940	3.756	0	USD	88,450	326.533,61	0,35
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares	STK	4.880	4.636	0	USD	84,180	384.913,00	0,41
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK	1.195 869	0	0	USD USD	263,160	294.660,30	0,32
US0326541051 US0378331005	Analog Devices Inc. Reg.Shares Apple Inc. Reg.Shares	STK STK	12.419	869 534	581	USD	163,980 129,610	133.519,44 1.508.200,13	0,14 1,62
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares	STK	10.809	0	0	USD	18,450	186.859,73	0,20
US0530151036	Automatic Data Processing Inc.	STK	900	900	0	USD	240,620	202.912,16	0,22
	Reg.Shares							,	,
US0533321024	AutoZone Inc. Reg.Shares	STK	83	11	19	USD	2.464,380	191.654,76	
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares	STK	4.969	0	0	USD	33,140	154.296,24	0,17
US0758871091 US0865161014	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares Best Buy Co. Inc. Reg.Shares	STK STK	927 2.423	320 1.152	223 0	USD USD	256,900 81,240	223.140,13 184.440,87	0,24 0,20
US0936711052	Block H. & R. Inc. Reg.Shares	STK	2.423	0	0	USD	36,720	69.190,84	0,20
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares	STK	3.951	0	684	USD	72,100	266.916,94	0,29
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares	STK	323	323	0	USD	557,810	168.819,52	0,18
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)	STK	997	997	0	USD	92,250	86.177,79	0,09
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares	STK	1.050	0	303	USD	161,930	159.312,72	0,17
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares	STK	779	779	0	USD	240,200	175.325,18	0,19
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares	STK	728	1.035	0	USD	126,870	86.541,45	0,09
US12504L1098 IL0010824113	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares	STK STK	1.935 1.376	1.935 885	0 818	USD USD	77,550 126,100	140.603,65 162.580,09	0,15 0,18
US1255231003	Cigna Corp. Reg.Shares	STK	607	0	647	USD	330,720	188.097,48	0,20
US1720621010	Cincinnati Financial Corp. Reg.Shares	STK	839	839	0	USD	104,160	81.883,57	0,09
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares	STK	5.202	1.541	2.074	USD	47,500	231.524,95	0,25
US1924461023	Cognizant Technology Sol.Corp. Reg.Shs Cl.A	STK	2.555	2.555	0	USD	57,130	136.769,41	0,15
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares	STK	421	0	2.182	USD	79,370	31.309,22	0,03
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	6.957	2.940	0	USD	35,050	228.477,72	0,25
US1266501006 US2358511028	CVS Health Corp. Reg.Shares Danaher Corp. Reg.Shares	STK STK	1.028 326	1.028 0	0	USD USD	93,450 266,850	90.013,21 81.511,45	0,10 0,09
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares	STK	571	0	568	USD	140,080	74.945,59	
US23918K1088	DaVita Inc. Reg.Shares	STK	1.207	0	629	USD	75,210	85.058,30	
	- -	'	. '					•	

ISIN	Gattungsbezeichnung Ma	rkt Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Bericht	Verkäufe/ Abgänge szeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
US2441991054	Deere & Co. Reg.Shares	STK	614	131	83	USD	428,640	246.601,04	0,27
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares	STK	1.601	1.601	0	USD	97,450	146.186,41	0,16
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares	STK	3.584	3.584	0	USD	50,650	170.090,98	0,18
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	7.995	3.706	1.399	USD	22,340	167.353,76	0,18
US23355L1061	DXC Technology Co. Reg.Shares	STK	2.988	0	2.075	USD	26,740	74.864,48	0,08
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares	STK	550	0	75	USD	512,880	264.309,21	0,28
US29082K1051	Embecta Corp. Reg.Shares	STK	230	230	0	USD	25,960	5.594,57	0,01
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares		1.009	1.009	0	USD	105,210	99.467,69	0,11
US3032501047	Fair Isaac Corp. Reg.Shares	STK	218	0	0	USD	600,900	122.741,81	0,13
US3666511072 US6687711084	Gartner Inc. Reg.Shares Gen Digital Inc. Reg.Shares	STK STK	492 5.515	0	0	USD	340,220 21,250	156.840,70 109.809,09	0,17 0,12
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares	STK	3.470	727	0	USD	85,260	277.209,84	0,12
US37940X1028	Global Payments Inc. Reg.Shares	STK	646	0	0	USD	99,200	60.045,16	0,06
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	728	0	0	USD	240,380	163.969,68	0,18
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares	STK	1.991	0	0	USD	80,610	150.381,36	0,16
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co.	STK	11.231	11.231	0	USD	15,920	167.531,06	0,18
	Reg.Shares								
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares	STK	2.726	0	0	USD	76,100	194.376,76	0,21
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares	STK	6.116	0	0	USD	27,040	154.955,86	0,17
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares	STK	7.835	7.835	2.951	USD	26,210	192.415,41	0,21
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc.	STK	2.772	2.772	0	USD	33,580	87.218,33	0,09
UC4C2CCC10E2	Reg.Shares	CTIV	224	224	0	LICE	207.010	CE 034 04	0.07
US46266C1053 US4262811015	IQVIA Holdings Inc. Reg.Shares Jack Henry & Associates Inc. Reg.Shares	STK STK	334 843	334 0	0 156	USD	207,810 177,490	65.034,94 140.195,90	0,07 0,15
US4781601046	Johnson & Johnson Reg. Shares	STK	2.800	1.005	0	USD	177,490	465.840,24	0,13
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares	STK	2.101	0	0	USD	133,220	262.258,35	0,30
US4878361082	Kellogg Co. Reg.Shares	STK	2.457	0	0	USD	71,470	164.536,70	0,18
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares	STK	900	0	0	USD	172,200	145.214,34	0,16
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares	STK	752	0	0	USD	235,490	165.929,71	0,18
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares	STK	525	0	0	USD	242,070	119.078,71	0,13
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares	STK	1.107	0	0	USD	202,260	209.793,23	0,23
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares		1.838	1.838	0	USD	82,900	142.768,99	0,15
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Share		1.301	1.301	0	USD	166,780	203.308,30	0,22
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares	STK	2.901	0	0	USD	47,230	128.380,63	0,14
US57636Q1040 US5801351017	Mastercard Inc. Reg.Shares A McDonald's Corp. Reg.Shares	STK STK	608 502	300 0	0	USD	348,210	198.371,22	0,21 0,13
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg. Shares	STK	55	0	443	USD	265,930 375,120	125.084,90 19.331,55	0,13
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK	3.796	0	249	USD	110,820	394.165,12	0,02
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK	115	0	0	USD	1.467,110	158.086,34	0,17
US5950171042	Microchip Technology Inc. Reg.Shares	STK	1.833	1.833	0	USD	70,450	120.997,75	0,13
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK	5.757	161	0	USD	241,010	1.300.065,19	1,40
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	592	592	0	USD	333,270	184.863,75	0,20
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares	STK	894	148	0	USD	146,030	122.324,50	0,13
US6819191064	Omnicom Group Inc. Reg.Shares	STK	1.865	0	0	USD	81,590	142.577,04	0,15
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares	STK	1.938	0	0	USD	87,000	157.981,73	0,17
US6951561090	Packaging Corp. of America Reg.Shares		296	296	0	USD	128,630	35.675,32	0,04
US7010941042	Parker-Hannifin Corp. Reg.Shares	STK	666	89	0	USD	292,000	182.217,85	0,20
US7043261079	Paychex Inc. Reg. Shares	STK STK	634 5.174	634 5.174	0	USD	116,460	69.183,08	0,07 0,27
US7170811035 US7458671010	Pfizer Inc. Reg.Shares Pulte Group Inc. Reg.Shares	STK	1.939	0	0	USD	51,330 45,820	248.846,49 83.246,64	0,27
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares	STK	1.249	0	603	USD	109,840	128.545,48	0,03
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares	STK	1.386	0	167	USD	156,790	203.617,65	0,14
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	STK	142	252	110	USD	721,290	95.969,25	0,10
US7703231032	Reg.Shares Robert Half International Inc. Reg.Share		1.820	1.820	0	USD	73,870	125.971,80	0,14
US81211K1007	Sealed Air Corp. Reg.Shares	STK	1.634	0	932	USD	50,100	76.704,99	0,08
US82968B1035	Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares	STK	25.712	25.712	0	USD	5,820	140.214,42	0,15
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares	STK	626	0	0	USD	230,210	135.030,65	0,15
US78467J1007	SS&C Technologies Holdings Reg.Share		1.536	849	1.058	USD	52,440	75.472,33	0,08
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares	STK	1.076	1.076	0	USD	32,840	33.109,24	0,04
US8716071076	Synopsys Inc. Reg.Shares	STK	592	73	0	USD	321,980	178.601,23	0,19
US8760301072	Tapestry Inc. Reg.Shares	STK	4.282	4.282	0	USD	37,720	151.339,46	0,16
US88160R1014 US8825081040	Tesla Inc. Reg.Shares Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK STK	267 1.522	178 1.522	0 753	USD	121,820 165,020	30.476,40 235.334,21	0,03 0,25
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK	1.214	0	566	USD	136,420	155.178,15	0,23
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares	STK	2.023	2.023	0	USD	63,950	121.218,88	0,17
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK	470	0	0	USD	320,410	141.103,49	0,15
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares	STK	2.754	0	2.552	USD	44,620	115.140,30	0,13
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK	1.255	0	1.056	USD	152,590	179.433,54	0,19
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares	STK	573	0	0	USD	557,010	299.055,26	0,32
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	606	606	0	USD	61,790	35.085,26	0,04
US9029733048	U.S. Bancorp Reg.Shares	STK	3.988	535	0	USD	43,570	162.808,30	0,18
US9026811052	UGI Corp. Reg.Shares	STK	1.813	0	1.984	USD	37,640	63.941,27	0,07
US90384S3031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares	STK	501	501	0	USD	464,830	218.205,51	0,23
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl		1.217	0	0	USD	175,750	200.410,17	0,22
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares	STK	408	408	0	USD	529,880	202.568,32	0,22
US92343V1044	Vertex Pharmacouticals Inc. Reg. Shares		5.739	0	0	USD	39,260	211.115,61	0,23
US92532F1003 US92826C8394	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK STK	786 979	0 484	287 228	USD USD	289,080 208,060	212.899,40 190.855,69	0,23 0,21
033202000334	VIDA IIIC. NEGIDIIAIES CI.A	211	3/9	404	220	l OSD	200,000	1 130.033,09	J 0,21

U.S.	ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Rericht	Verkäufe/ Abgänge tszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
US99100L1098	US9344231041			2.614			USD	9,415	23.060,02	_
USSPERIOR   Western Uniter Co. Meg. Shares   STK   9.612   9.612   0 USD   13.80   125.007,79   0.315   0.305   0.32		Waste Management Inc. Reg.Share					1	,	'	
LISSERSERION   Turn Running, the Reg Sturms   STK   1709										
Very	IE00BDB6Q211	Willis Towers Watson PLC Reg.Shar	res STK	779	779		USD	245,240	179.003,94	
FURP   1,7700 % A PMoler March AS MTN   FUR   700,000	US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares	STK	1.709	0	0	USD	129,990	208.154,52	0,22
X3 173899807   7,7500 fs. Aphtoler Aberskin A.S. MIN   EUR   500,000   500,000   0   %   87,871   49,935,000   0,71	Verzinsliche Wert	tpapiere							29.691.186,48	31,98
1872    1872	EUR								17.711.235,50	19,06
FRODISSIDERING   1,0000 B Amergeres de Paris A. OLO,   CHR   500,000   500,000   0   5   87,231   439350,00   0.47	XS1789699607		ITN EUR	700.000	0	0	%	93,891	657.233,50	0,71
BERSTORESTERN   1,7000   5 Ambrouse Buch Hilling   FUR   500,000   0   0   %   97,334   451,667,50   0,00   0,00   0,00   0   0   %   84,125   460,050   0,00   0	FR0013302197	1,0000 % Aéroports de Paris S.A.	Obl. EUR	500.000	500.000	0	%	87,871	439.355,00	0,47
XS2049984884   0.7790 fs BAWAG FS K, Non-Preferred   EUR   500.000   0   %   84.125   420.625.00   0.43   MS2010257015   0.8750 fs BaWAG FRONT   EUR   500.000   0   %   97.361   396.805.00   0.43   MS2010257015   0.8750 fs Baudkeep Deutschland And.   EUR   500.000   500.000   0   %   97.361   396.805.00   0.43   MS2010257014   0.7707   0.	BE6320936287	3,7000 % Anheuser-Busch InBev	EUR	500.000	0	0	%	92,334	461.667,50	0,50
\$2510257105   0.750   8.8MV France II V MTN	XS2049584084	0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Pref	erred EUR	500.000	0	0	%	84,125	420.625,00	0,45
DECODIO 1/24   15,000 9 St Bundessp Deutschland And,   EUR   100,000   0   0   9   8   81,913   91,381   0   0.0	XS2102357105	0,8750 % BMW Finance N.V. MTN	EUR	500.000	0	0	%	79,361	396.805,00	0,43
X5178795763   1,5509 & Chubel MA Holdings inc.   LUR   500.000   500.000   0   6   88,404   442.02,00   0,48     MIDD(2599997   1,770 % Edered S.A. Nokes 1725   EUR   500.0000   500.000   0   6   87,789   432.900.00   0,31     MIDD(2599997   1,770 % Edered S.A. Nokes 1725   EUR   500.0000   500.000   0   6   87,789   432.900.00   0,31     MIDD(2599997   1,770 % Edered S.A. Nokes 1725   EUR   500.0000   0   0   6   87,789   432.900.00   0,04     MIDD(2599997   1,770 % EIG S.A. MIN 2027   EUR   500.0000   0   0   6   88,505   995.981.50   0,64     MIDD(25932024   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   500.000   0   0   6   70   70   70     MIDD(2592022   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   500.000   0   0   6   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(2592022   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   500.000   0   0   70   70   70   70     MIDD(2592022   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   500.000   0   0   0   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(2592022   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   700.000   0   0   0   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(2592022   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   700.000   0   0   0   96,493   366.156,00   0,32     MIDD(2592022   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   700.000   0   0   0   96,493   366.156,00   0,32     MIDD(2592032   1,775 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   700.000   0   0   0   96,493   366.156,00   0,32     MIDD(2592032   1,775 % Klapiere S.A. MIN 2025   EUR   700.000   0   0   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(259203   1,775 % Klapiere S.A. MIN 2025   EUR   700.000   0   0   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(259203   1,775 % Klapiere S.A. MIN 2025   EUR   700.000   0   0   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(259203   1,775 % Klapiere S.A. MIN 2025   EUR   700.000   0   0   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(259203   1,775 % Klapiere S.A. MIN 2025   EUR   700.000   0   0   96,493   366.156,00   0,33     MIDD(259203   1,775 % Klapiere S.A. MIN 2025   EUR   700.000   0   0   96,493   366.156	DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland	Anl. EUR	100.000	0	0	%	91,381	91.381,00	0,10
BR000299982   1,3750 % Edemed S.A. Notes 15/25   EUR   500,000   0   0   %   95,248   476,240,00   0,47   X5151086876   1,5000 % ENT S.D.A. MTN 17/27   EUR   500,000   0   0   %   91,960   439,800,00   0,49   X5271713005   1,1120 % Europe Information S.D.A. MTN 17/27   EUR   700,000   0   0   %   70,906   394,527,50   0,42   X5271713005   1,1120 % Europe Idmitsh MTN 20/32   EUR   500,000   0   0   %   70,906   394,527,50   0,42   X5271713005   1,1120 % Europe Idmitsh MTN 20/32   EUR   500,000   0   0   %   70,906   394,527,50   0,42   X5271713005   1,1120 % Europe Idmitsh MTN 20/32   EUR   500,000   0   0   %   91,539   366,156,00   0,39   20/6   X5271713005   1,320 % Ferroval Embinors S.A. Notes   EUR   500,000   0   0   %   91,539   366,156,00   0,39   20/6   X5271713005   1,320 % Ferroval Embinors S.A. Notes   EUR   500,000   0   0   %   91,539   366,156,00   0,39   20/6   X5271713005   1,320 % Europe Idmitsh MTN 20/32   EUR   700,000   0   %   91,539   366,156,00   0,39   20/6   X5271713005   X527171300	XS1785795763	1,5500 % Chubb INA Holdings Inc	. EUR	500.000	500.000	0	%	88,404	442.020,00	0,48
X31551068676   1,5000 % ENIS p.A MTN 1727   EUR   500.000   0   0   %   31,560   459.800,00   0,04   X321713006   1,1130 % Eurogirid Gmidh MTN 2072   EUR   500.000   0   0   %   78,906   394.527,50   0,64   X321713006   1,1130 % Eurogirid Gmidh MTN 2072   EUR   500.000   0   0   %   78,906   394.527,50   0,64   X321713006   1,1130 % Eurogirid Gmidh MTN 2072   EUR   500.000   0   0   %   91,539   366.156,00   0,39   X5161167866   1,000 % HELLA GmbH & Co. KGAA   EUR   500.000   0   0   %   96,433   482.465,00   0,32   X5161167866   1,000 % HELLA GmbH & Co. KGAA   EUR   500.000   0   0   %   96,433   482.465,00   0,52   X51931380   0,250 % Halgas S.P.A. MTN 2075   EUR   700.000   700.000   0   %   81,150   640.510,50   0,63   X5192431380   0,250 % Halgas S.P.A. MTN 2075   EUR   700.000   700.000   0   %   81,465   2,244.65,00   0,63   X5192431380   0,250 % Halgas S.P.A. MTN 2075   EUR   700.000   700.000   0   %   81,465   2,244.65,00   0,63   X5192431380   0,250 % Halgas S.P.A. MTN 2075   EUR   700.000   700.000   0   %   81,465   2,244.65,00   0,63   X5192431380   0,250 % Landwisch R.1343 15/27   0,63   X5192431380   0,250 % Landwisch R.1343 15/27   0,000 % Land Berlin Landwisch R. BUR   3,000.000   0   %   87,083   2,912.490,0   3,15   X5192431380   0,250 % Landwisch R.1343 15/27   0,000 % Landwis		1,3750 % Edenred S.A. Notes 15/2							,	
XS2229348SE2	BE0002596741	1,5000 % Elia Group FLR Bonds 18	3/28 EUR	500.000	500.000	0		87,798	438.990,00	0,47
XS2171713006	XS1551068676	1,5000 % ENI S.p.A. MTN 17/27	EUR	500.000	0	0	%	91,960	459.800,00	0,49
ESDOOSB32032   1,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   500,000   0   0   %   91,539   366,156,00   0,39   2026   3,3820 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   400,000   0   0   %   91,539   366,156,00   0,39   2026   3,3820 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   EUR   500,000   0   0   %   91,539   366,156,00   0,39   2026   3,3820 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes   72,000 %   700,000   0   %   91,539   482,465,00   0,69   3,000 % Kelpare S.A. MTN 2025   EUR   700,000   0   %   94,458   4173   589,211,00   0,63   0,600   0,600   0   %   84,473   589,211,00   0,63   0,600   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0   %   84,455,00   0,63   0,600   0   %   0,600   0   %   0,600   0   0   %   0,600   0   0   0   0   0   0   0   0   0	XS2229434852	0,5000 % ERG S.p.A. MTN 20/27	EUR	700.000	0	0	%	85,055	595.381,50	0,64
ES0205932024   1,3750 % Ferroval Emisiones S.A. Notes   EUR   500.000   0   0   %   94,248   471,240,00   0,51   1725   1,3820 % Ferroval Emisiones S.A. Notes   EUR   400.000   0   0   %   91,539   36615,00   0,52   1,520   2026   1,520   2026   1,520 % Ferroval Emisiones S.A. Notes   EUR   500.000   0   0   %   91,539   36615,00   0,52   1,520   2026   1,520   2026   1,520   2026   1,520   1,	XS2171713006		)/32 EUR	500.000	0	0	%	78,906		
S2005820322   1,3820 % Ferrovial Emissiones S.A. Notes   DIR   400.000   0   0   9   91,339   366.156,00   0,39   2026		1,3750 % Ferrovial Emisiones S.A.		1	0		1			
SST61167856   1,000 %   HEILA GmbH & Co. KGaA   EUR   500,000   0   0   %   96,493   482,465,00   0,52	ES0205032032	1,3820 % Ferrovial Emisiones S.A.	Notes EUR	400.000	0	0	%	91,539	366.156,00	0,39
XS2192431380	XS1611167856	1,0000 % HELLA GmbH & Co. KG	aA EUR	500.000	0	0	%	96,493	482.465,00	0,52
DEDOOQAYBBYV  20,1000 % Land Berlin Landessch.   EUR   3,000,000   0   0   %   81,485   2,444,550,00   2,63   Ausg, 514 19/30   Ausg, 51		0,2500 % Italgas S.P.A. MTN 20/25			-		1			
DECOONNEWGED   1,4630 % Land Nordrhein-Westf FLR								,		
DEDOONNWOGED   1,4630 % Land Nordrhein-West FLIR   EUR   200.000   0   0   %   100,275   200.549,00   0,22   Landescent, R.1343 15/27   200.000 % Land Nordrhein-Westfalen   EUR   3.000.000   0   0   %   97,083   2.912.490.00   3,15   200.000   2.000	DE000A2NB9V2		EUR	3.000.000	0	0	%	81,485	2.444.550,00	2,63
DEDOONNEWZ111   2,000 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch, R.1247 1375   Landessch, R.1325 14275	DE000NRW0GD7	1,4630 % Land Nordrhein-Westf. F	FLR EUR	200.000	0	0	%	100,275	200.549,00	0,22
DEDONNRWOFU3   1,2500 % Land Nordrhein-Westfalen   EUR   500,000   0   0   %   96,050   480,250,00   0,52   1,000	DE000NRW2111	2,0000 % Land Nordrhein-Westfal	en EUR	3.000.000	0	0	%	97,083	2.912.490,00	3,15
READ   1,8000 % Mercialys Bonds 18/26   EUR   700,000   0   0   %   85,482   598,370,50   0,68   1,3750 % Naturey Finance B.V. MTN   EUR   700,000   0   0   %   90,530   633,710,00   0,68   71777   71777   71777   71777   71787   71887	DE000NRW0FU3	1,2500 % Land Nordrhein-Westfal	en EUR	500.000	0	0	%	96,050	480.250,00	0,52
X51551446880   1,3750 % Naturgý Finance B.V. MTN   EUR   700,000   0   0   %   90,530   633,710,00   0,68   17/27	FR0013506508		itton EUR	500.000	0	0	%	95,296	476.480,00	0,51
XS2291340433   0,7500 % Sagax EURO MTN NL B.V. MTN					-					
XS2166755509   2,0000 % Schlumberger Finance B.V.   EUR   S00.000   0   0   %   85,633   428.165,00   0,46   Notes 20/32   XS2128499105   2,3750 % Signify N.V. Notes 20/27   EUR   S00.000   0   0   %   94,058   470.287,50   0,51   XS2078737215   0,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken   EUR   S00.000   0   0   %   79,970   399.850,00   0,43   XS21794354628   2,5000 % Stora Enso Oyj MTN 18/28   EUR   S00.000   500.000   0   %   93,463   467.312,50   6,00   GB00BHBFH458   2,7500 % Großbritannien Treasury Stock   GBP   S.000.000   0   %   98,492   S.563.451,09   6,00   GB00BHBFH458   2,7500 % Großbritannien Treasury Stock   GBP   S.000.000   G00.000   0   %   85,605   481.267,74   0,52   20/31   41/24	XS2291340433	0,7500 % Sagax EURO MTN NL B.	v. MTN EUR	500.000	500.000	0	%	75,123	375.612,50	0,40
XS2128499105	XS2166755509	2,0000 % Schlumberger Finance B	.V. EUR	500.000	0	0	%	85,633	428.165,00	0,46
Non-Pref. MTNs 19/29	XS2128499105		' EUR	500.000	0	0	%	94,058	470.287,50	0,51
GBP   2,7500 % Großbritannien Treasury Stock   GBP   5.000.000   0   0   0   98,492   5.563.451,09   6,00	XS2078737215		Banken EUR	500.000	0	0	%	79,970	399.850,00	0,43
14/24     14/25     14/26     14/26     14/26     14/26     14/26     15/2		2,5000 % Stora Enso Oyj MTN 18/	28 EUR	500.000	500.000	0	%	93,463		
US169905AG19 3,7000 % Choice Hotels Intl Inc. Notes 20/31  US26884LAF67 3,9000 % EQT Corp. Notes 17/27 USD 500.000 500.000 0 % 93,600 438.510,19 0,47 US361448AZ62 3,8500 % GATX Corp. Notes 17/27 USD 500.000 500.000 0 % 93,366 437.412,51 0,47 US500472AC95 6,8750 % Koninklijke Philips N.V. Notes USD 500.000 0 % 106,644 499.619,58 0,54 08/38  US617446HD43 7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32 <sup>1)</sup> USD 500.000 0 0 % 112,435 526.751,00 0,57 US617482V925 6,3750 % Morgan Stanley Notes 12/42 USD 500.000 0 0 % 109,587 513.410,63 0,55 US681936BH22 5,2500 % Omega Healthcare Invest. Inc. USD Notes 15/26  US35177PAL13 9,0000 % Orange S.A. Notes 01/31 USD 500.000 0 0 % 122,604 574.393,07 0,62 US89153VAT61 2,8290 % TotalEnergies Capital Intl SA USD 500.000 0 0 % 88,966 416.800,19 0,45 Notes 19/30  US912810FP85 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31 USD 2.000.000 0 0 % 110,359 2.068.107,29 2,23 Sonstige Beteiligungswertpapiere  CH6  CH6  CH0012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17	GB00BHBFH458		Stock GBP	5.000.000	0	0	%	98,492	5.563.451,09	6,00
US26884LAF67 3,9000 % EQT Corp. Notes 17/27 USD 500.000 500.000 0 % 93,600 438.510,19 0,47 US361448AZ62 3,8500 % GATX Corp. Notes 17/27 USD 500.000 500.000 0 % 93,366 437.412,51 0,47 USD 500.000 0 % 106,644 499.619,58 0,54 08/38 US617446HD43 7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/321) USD 500.000 0 0 % 112,435 526.751,00 0,57 US617482V925 6,3750 % Morgan Stanley Notes 12/42 USD 500.000 0 0 % 109,587 513.410,63 0,55 US681936BH22 5,2500 % Omega Healthcare Invest. Inc. USD 500.000 0 0 % 98,236 460.227,69 0,50 Notes 15/26 US89153VAT61 2,8290 % TotalEnergies Capital Intl SA USD 500.000 0 0 % 88,966 416.800,19 0,45 Notes 19/30 US912810FP85 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31 USD 2.000.000 1.000.000 0 % 110,359 2.068.107,29 2,23 Sonstige Beteiligungswertpapiere CHF UR012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17			otes USD	600.000	600.000	0	%	85,605		
US361448AZ62 3,8500 % GATX Corp. Notes 17/27 USD 500.000 500.000 0 % 93,366 437.412,51 0,47 US500472AC95 6,8750 % Koninklijke Philips N.V. Notes USD 500.000 0 % 106,644 499.619,58 0,54 08/38 08/38  US617446HD43 7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32 <sup>1)</sup> USD 500.000 0 0 % 112,435 526,751,00 0,57 US617482V925 6,3750 % Morgan Stanley Notes 12/42 USD 500.000 0 0 % 109,587 513.410,63 0,55 US681936BH22 5,2500 % Omega Healthcare Invest. Inc. USD 500.000 0 0 % 98,236 460.227,69 0,50 Notes 15/26 US89153VAT61 2,8290 % TotalEnergies Capital Intl SA USD 500.000 0 0 % 122,604 574.393,07 0,62 US89153VAT61 2,8290 % TotalEnergies Capital Intl SA USD 500.000 0 0 % 88,966 416.800,19 0,45 Notes 19/30 US912810FP85 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31 USD 2.000.000 1.000.000 0 % 110,359 2.068.107,29 2,23 Sonstige Beteiligurgswertpapiere CHF 155.873,17 0,17 CH0012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17	US26884I AF67		USD	500.000	500.000	0	%	93.600	438.510.19	0.47
US500472AC95 6,8750 % Koninklijke Philips N.V. Notes USD 500.000 0 0 % 106,644 499.619,58 0,54 08/38 US617446HD43 7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32¹) USD 500.000 0 0 % 112,435 526.751,00 0,57 US617482V925 6,3750 % Morgan Stanley Notes 12/42 USD 500.000 0 0 % 109,587 513.410,63 0,55 US681936BH22 5,2500 % Omega Healthcare Invest. Inc. USD 500.000 0 0 % 98,236 460.227,69 0,50 Notes 15/26 US35177PAL13 9,0000 % Orange S.A. Notes 01/31 USD 500.000 0 0 % 122,604 574.393,07 0,62 US89153VAT61 2,8290 % TotalEnergies Capital Intl SA USD 500.000 0 0 % 88,966 416.800,19 0,45 Notes 19/30 US912810FP85 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31 USD 2.000.000 1.000.000 0 % 110,359 2.068.107,29 2,23 Sonstige Beteiligungswertpapiere US012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17							1			
US617482V925 6,3750 % Morgan Stanley Notes 12/42 USD 500.000 0 0 % 109,587 513.410,63 0,55 U5681936BH22 5,2500 % Omega Healthcare Invest. Inc. USD 500.000 0 0 % 98,236 460.227,69 0,50 Notes 15/26 0 0 0 % 98,236 460.227,69 0,50 Notes 15/26 0 0 0 % 122,604 574.393,07 0,62 U589153VAT61 2,8290 % TotalEnergies Capital Intl SA USD 500.000 0 0 % 88,966 416.800,19 0,45 Notes 19/30 0 0 % 19/30 0 0 % 110,359 2.068.107,29 2.23 Sonstige Beteiligungswertpapiere CHF 155.873,17 0,17 CH0012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17		6,8750 % Koninklijke Philips N.V. N					1			
US581936BH22 5,2500 % Omega Healthcare Invest. Inc. USD 500.000 0 0 % 98,236 460.227,69 0,50 Notes 15/26		7,2500 % Morgan Stanley MTN 02					1			
US35177PAL13 9,000 % Orange S.A. Notes 01/31 USD 500.000 0 0 % 122,604 574.393,07 0,62 US89153VAT61 2,8290 % TotalEnergies Capital Intl SA USD 500.000 0 0 % 88,966 416.800,19 0,45 Notes 19/30 US912810FP85 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31 USD 2.000.000 1.000.000 0 % 110,359 2.068.107,29 2,23 Sonstige Beteiligungswertpapiere		5,2500 % Omega Healthcare Inves								
Notes 19/30 US912810FP85 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31 USD 2.000.000 1.000.000 0 % 110,359 2.068.107,29 2.23 Sonstige Beteiligurgswertpapiere CHF CH0012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17		9,0000 % Orange S.A. Notes 01/3								
US912810FP85 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31 USD 2.000.000 1.000.000 0 % 110,359 2.068.107,29 2,23 Sonstige Beteiligungswertpapiere 155.873,17 0,17 CHF 15012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17	US89153VAT61		I SA USD	500.000	0	0	%	88,966	416.800,19	0,45
CH0012032048 Roche Holding AG STK 524 0 0 CHF 293,400 155.873,17 0,17	Sonstige Beteilig	5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/3	31 USD	2.000.000	1.000.000	0	%	110,359	155.873,17	0,17
		Roche Holding AG	STK	524	0	0	CHF	293,400		
								,		

ISIN	Gattungsbezeichnung Mar	kt Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichts	Verkäufe/ Abgänge zeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
An organisierten einbezogene We	Märkten zugelassene oder in diese			20110110				17.764.577,45	19,14
Verzinsliche Wer								17.764.577,45	19,14
<b>EUR</b> XS2083147343	1,6250 % Albemarle New Holding	EUR	500.000	0	0	%	88,375	<b>2.227.593,70</b> 441.875,00	<b>2,40</b> 0,48
XS1627602201	GmbH Bonds 19/28 Reg.S 1,8750 % American International Grp In	c EUR	600.000	600.000	0	%	90,270	541.617,00	0,58
XS1395182683	Notes 17/27 4,2500 % Huntsman International LLC Notes 16/25	EUR	600.000	600.000	0	%	95,794	574.765,20	0,62
DE000A3H3J14	0,0000 % Vantage Towers AG KpAnl. 21/25	EUR	700.000	0	0	%	95,620	669.336,50	0,72
USD US00203QAE70	4,5000 % A.P.Moeller-Maersk A/S Notes 19/29 144A	USD	500.000	0	0	%	94,584	<b>15.536.983,75</b> 443.122,51	<b>16,74</b> 0,48
US00287YCY32	4,5500 % AbbVie Inc. Notes 20/35	USD	500.000	500.000	0	%	94,079	440.755,68	0,47
US001055BJ00 US03040WAU99	3,6000 % AFLAC Inc. Notes 20/30 3,4500 % American Water Capital Corp	USD . USD	500.000 500.000	500.000 0	0	% %	91,332 90,777	427.882,41 425.282,27	0,46 0,46
	Notes 19/29						/	,	
US00185AAK07	3,8750 % Aon Global Ltd. Notes 16/25	USD	500.000	500.000	0	%	97,605	457.275,24	0,49
US037833AT77 US045054AJ25	4,4500 % Apple Inc. Notes 14/44 4,0000 % Ashtead Capital Inc. Notes	USD USD	500.000 500.000	0	0	% %	96,050 92,176	449.985,95 431.836,50	0,48 0,46
	19/28 144A			_					
US05723KAE01	3,3370 % Bak.Hug.Hldgs LLC/Co-Obli.Inc. Notes 18/27	USD	500.000	500.000	0	%	92,710	434.338,72	0,47
US093662AJ37	2,5000 % Block Financial LLC Notes 21/28	USD	500.000	500.000	0	%	85,222	399.259,31	0,43
US11120VAJ26	4,0500 % Brixmor Operating Partners. L Notes 20/30		600.000	600.000	0	%	88,654	498.406,18	0,54
US133131AZ59	2,8000 % Camden Property Trust Notes 20/30		600.000	600.000	0	%	86,555	486.605,76	0,52
US134429BJ73	2,3750 % Campbell Soup Co. Notes 20/30	USD	500.000	500.000	0	%	83,368	390.573,90	0,42
US16412XAJ46	3,7000 % Cheniere Corpus Chr. Hldgs LLC Notes 19/29	USD	600.000	600.000	0	%	90,509	508.834,86	0,55
US19416QEJ58	4,0000 % Colgate-Palmolive Co. MTN 15/45	USD	500.000	0	0	%	90,150	422.347,15	0,45
US22822VAU52 US23291KAJ43	3,2500 % Crown Castle Inc. Notes 20/5 3,2500 % DH Europe Finance II S.à r.L.	1 USD USD	500.000 500.000	0	0	% %	66,450 80,665	311.314,13 377.910,52	0,34 0,41
US281020AN70	Notes 19/39 5,7500 % Edison International Notes 19/27	USD	500.000	500.000	0	%	100,458	470.639,49	0,51
US29248HAC79	3,0750 % Empower Finance 2020 L.P. Notes 20/51 144A	USD	500.000	0	0	%	63,268	296.406,18	0,32
US33834DAA28	2,8500 % Five Corners Funding Trust II Notes 20/30 144A 3C7	USD	600.000	600.000	0	%	84,220	473.475,76	0,51
US412822AE80	4,6250 % Harley-Davidson Inc. Notes 15/45	USD	500.000	0	0	%	78,997	370.096,04	0,40
US404119BY43 US423012AF03	5,1250 % HCA Inc. Notes 19/39 3,5000 % Heineken N.V. Notes 17/28	USD USD	500.000 500.000	0	0	% %	89,960 94,681	421.457,02 443.574,61	0,45 0,48
US448579AJ19	144A 5,7500 % Hyatt Hotels Corp. Notes	USD	500.000	500.000	0	%	98,051	459.364,25	0,49
US49271VAP58	20/30 3,9500 % Keurig Dr Pepper Inc. Notes	USD	500.000	500.000	0	%	93,420	437.666,90	0,47
US482480AJ99	22/29 3,3000 % KLA Corp. Notes 20/50	USD	500.000	0	0	%	73,486	344.275,01	0,37
US50247VAC37	4,8750 % LYB International Finance B.V. Notes 14/44		500.000	0	0	%	84,591	396.303,58	0,43
US56585ABD37	3,8000 % Marathon Petroleum Corp. Notes 18/28	USD	500.000	500.000	0	%	92,524	433.471,07	0,47
US571903AY99	4,0000 % Marriott International Inc. Notes S.X 18/28	USD	500.000	500.000	0	%	93,418	437.655,19	0,47
US55336VAR15 US785592AS57	4,0000 % MPLX L.P. Notes 18/28 5,0000 % Sabine Pass Liquefaction LLC	USD USD	1.000.000 500.000	1.000.000 0	0	% %	93,346 98,495	874.640,43 461.442,96	0,94 0,50
US860630AG72	Notes 17/27 4,0000 % Stifel Financial Corp. Notes 20/30	USD	500.000	0	0	%	86,738	406.360,27	0,44
US87612EBF25 US501044DC24	3,6250 % Target Corp. Notes 16/46 3,5000 % The Kroger Co. Notes 16/26 <sup>1)</sup>	USD USD	500.000 500.000	0 500.000	0	%	80,706 95,650	378.100,26 448.114,31	0,41 0,48
US87264AAX37	4,3750 % T-Mobile USA Inc. Notes 20/4		500.000	0	0	%	86,285	404.239,87	0,44
US912828U246 US920253AF89	2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26 5,0000 % Valmont Industries Inc. Notes	USD USD	300.000 500.000	0	1.000.000	%	92,668	260.486,21 413.483,25	0,28 0,45
03320233AF69	14/44	บวบ	300.000	U	U	70	88,258	413.403,25	0,43
Nichtnotierte We Verzinsliche Wer USD	tpapiere							427.491,22 427.491,22 427.491,22	0,46 0,46 0,46
US25156PBC68	4,7500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. Notes 18/38 144A	USD	500.000	0	0	%	91,248	427.491,22	0,46
			'					1	1

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichts	Verkäufe/ Abgänge szeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Wertpapier-Inve	stmentanteile rtpapier-Investmentanteile								7.125.999,83 1.709.307,00	7,68 1,84
EUR					_				1.709.307,00	1,84
DE0005424568 Gruppeneigene	Deka-Vega Plus I (A) Wertpapier-Investmentanteile		ANT	25.700	0	0	EUR	66,510	1.709.307,00 <b>4.274.066.04</b>	1,84 <b>4,61</b>
EUR	• •								4.274.066,04	4,61
LU1685588219 LU1685587591	Deka-MultiFactor Global Corpora Deka-MultiFactor Global Corpora		ANT ANT	7.403 46.500	0	0	EUR EUR	79,680 79,230	589.871,04 3.684.195,00	0,63 3,98
	Wertpapier-Investmentanteile	atc3 III I	AIVI	40.500	0	O .	LOIN	75,250	1.142.626,79	1,23
EUR IE00BKLC5874	icha II F II Vd Ca Bd FCC II FTF		ANT	64.400	158.400	256.000	EUR	4 200	276.855,60	<b>0,30</b> 0,30
IEUUBNIC56/4	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANI	64.400	156.400	250.000	EUK	4,299	276.855,60	0,30
USD									865.771,19	0,93
IE00BKF09C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	66.900	189.800	368.900	USD	4,331	271.486,44	0,29
LU1974695790	UBS(L)FS-JPM DL EM IG ESG D.B	. Act.	ANT	53.200	53.200	0	USD	11,922	594.284,75	0,64
Summe Wertpap	Nom. A Acc.						EUR		87.701.904,12	94,43
Junine Wertpap	nervermogen						LON		07.701.304,12	34,43
Derivate	s gekennzeichneten Beständen									
	n <b>verkaufte</b> Positionen.)									
Aktienindex-Der										
Forderungen/ Verb Aktienindex-Terr									461.209,68	0,49
DJ Euro Stoxx 50 F	Future (STXE) März 23	XEUR	EUR	Anzahl -84					115.080,00	0,12
	100 Index Future (NQ) März 23 10 Index Future (RTY) März 23	XIOM XCME	USD USD	Anzahl 6 Anzahl 10					-89.946,73 -26.844,69	-0,10 -0,03
	dex Future (ES) März 23	XCME	USD	Anzahl -57					409.607,86	0,44
	uture (FMCE) März 23	XEUR	EUR	Anzahl 17					-5.270,00	-0,01
FTSE 100 Index Fu MDAX Mini Future	. ,	IFEU XEUR	GBP EUR	Anzahl 1 Anzahl 16					186,40 -14.882,81	0,00 -0,02
OMX Index Future	e (O30) Jan. 23	XNDX	SEK	Anzahl -21					7.366,14	0,01
	uture (OMW) Jan. 23 Idex Future (SXF) März 23	XNDX XMOD	DKK CAD	Anzahl -18 Anzahl -7					-1.891,56 33.846,23	0,00 0,04
SPI 200 Index Futu	ure (YAP) März 23	XSFE	AUD	Anzahl 1					-2.913,65	0,00
	ex Future (S30) März 23 Price Index Future (JTI) März 23	XEUR XOSE	CHF JPY	Anzahl -4 Anzahl -6					12.125,82 24.746,67	0,01 0,03
TOPIX-TORYO STOCK	Trice index ratare (71) Marz 25	XOJL	31 1	Alizaili -0					24.740,07	0,03
Optionsrechte Optionsrechte au	uf Aktionindicos								97.653,15	0,10 0,10
	ndex (SX5E) Call Jan. 23 3900	XEUR		Anzahl 99			EUR	30,000	<b>97.653,15</b> 29.700,00	0,10
	5500) Put Jan. 23 3750	XCBO		Anzahl 19			USD <b>EUR</b>	38,170	67.953,15	0,07 <b>0,59</b>
Summe Aktienin	idex-Derivate						EUR		558.862,83	0,59
Zins-Derivate	S. 18 1 L S									
Forderungen/ Verb Zinsterminkontra									461.523,75	0,50
	ono Futures (FBON) März 23	XEUR	EUR	500.000					-44.490,50	-0,05
EURO Bobl Future EURO Bund Future		XEUR XEUR	EUR EUR	-5.900.000 -2.000.000					225.970,00 164.800,00	0,24 0,18
	re (FGBS) März 23	XEUR	EUR	-9.200.000					117.300,00	0,13
EURO-BTP Future	(FBTP) März 23 ury Note Future (FV) März 23	XEUR XCBT	EUR USD	500.000 -5.200.000					-41.040,00 2.664,59	-0,04 0,00
Long Gilt Future (F		IFEU	GBP	100.000					-6.936,52	-0,01
	OAT Future (FOAT) März 23 ury Note Future (TY) März 23	XEUR XCBT	EUR USD	1.000.000 -8.700.000					-88.010,00 48.613,60	-0,09 0,05
	Sury Note Future (TU) März 23	XCBT	USD	-400.000					-761,30	0,00
	Bond Future (US) März 23	XCBT	USD	-5.300.000					83.413,88	0,09
Summe Zins-Der	ivate						EUR		461.523,75	0,50
Devisen-Derivate										
Forderungen/ Verb  Devisenterminke	ondlichkeiten ontrakte (Verkauf)								620.116,31	0,67
Offene Positione	en								•	
CAD/EUR 1.850.00 CHF/EUR 450.000		OTC OTC							7.271,92 510,34	0,01 0,00
DKK/EUR 3.350.00	00,00	OTC							-42,06	0,00
GBP/EUR 5.200.00		OTC OTC							138.572,46	0,15
JPY/EUR 129.000. SEK/EUR 4.900.00		OTC							-21.847,92 8.659,82	-0,02 0,01
USD/EUR 32.100.0	000,00	OTC					F		486.991,75	0,52
Summe Devisen-	-perivate						EUR		620.116,31	0,67
Swaps										
Forderungen/ Verb Inflation Swaps										
Protection Seller	ŕ								401.768,40	0,43
IFS Euro HICP Ex-T BNP_PAR 03.08.20	Tobacco EUR / 1,6125% EUR /	OTC	STK	2.700.000					401.768,40	0,43
5.41 _17.11 05.00.21				ı			I	١		I

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Verkäufe/ Zugänge Abgänge Im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Summe Swap	s	·····g.		iii berendzeradiii	EUR		401.768,40	0,43
Bankguthabe	n, Geldmarktpapiere und Geldmarl n n bei der Verwahrstelle	ctfonds						
	tsche Girozentrale	EUR	2.144.570,02		%	100,000	2.144.570,02	2,31
EUR-Guthabe	<b>n bei</b> den-Württemberg	EUR	15.170,97		%	100,000	15.170,97	0,02
	onstigen EU/EWR-Währungen	2011	13.170,37		,,,	.00,000	13.170,37	0,02
DekaBank Deu DekaBank Deu	tsche Girozentrale tsche Girozentrale tsche Girozentrale Nicht-EU/EWR-Währungen	DKK NOK SEK	152.848,37 73.391,31 528.255,61		% % %	100,000 100,000 100,000	20.553,39 6.974,57 47.450,81	0,02 0,01 0,05
DekaBank Deu DekaBank Deu DekaBank Deu	ische Girozentrale ische Girozentrale ische Girozentrale ische Girozentrale	AUD CAD CHF GBP	119.503,11 254.286,64 37.562,11 110.627,16		% % %	100,000 100,000 100,000 100,000	76.107,18 176.048,19 38.082,89 124.978,43	0,08 0,19 0,04 0,13
DekaBank Deu DekaBank Deu	tsche Girozentrale tsche Girozentrale tsche Girozentrale tsche Girozentrale	HKD JPY NZD USD	28.658,10 16.678.922,00 3.295,97 681.358,63		% % %	100,000 100,000 100,000 100,000	3.443,32 118.605,67 1.957,52 638.424,58	0,00 0,13 0,00 0,69
Summe Bankg Summe der Ba Geldmarktfon	ankguthaben, Geldmarktpapiere u	nd			EUR EUR		3.412.367,54 3.412.367,54	3,67 3,67
Zinsansprüche Dividendenans Forderungen au Forderungen au Forderungen au	nögensgegenstände orüche us Wertpapier-Darlehen us Anteilscheingeschäften us Quellensteuerrückerstattung ige Vermögensgegenstände	EUR EUR EUR EUR EUR	485.800,63 22.485,13 329,62 93,33 30.391,60		EUR		485.800,63 22.485,13 329,62 93,33 30.391,60 <b>539.100,31</b>	0,52 0,02 0,00 0,00 0,03 0,57
Allgemeine For Verbindlichkeit Summe Sonst	en aus Wertpapier-Darlehen idsverwaltungsverbindlichkeiten en aus Cash Collateral ige Verbindlichkeiten	EUR EUR EUR	-108,78 -68.229,17 -730.000,00		EUR		-108,78 -68.229,17 -730.000,00 <b>-798.337,95</b>	0,00 -0,07 -0,79 <b>-0,86</b>
Fondsvermög Umlaufende A Anteilwert					EUR STK EUR		92.897.305,31 993.482,000 93,51	100,00

<sup>\*)</sup> Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

<sup>1)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

Gattungsbezeichnung		Stück bzw. Nominal		er-Darlehen EUR	
		in Währung	befristet	unbefristet	gesamt
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)					
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:					
1,0000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 17/27	EUR	500.000		439.355,00	
0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27	EUR	500.000		420.625,00	
0,8750 % BMW Finance N.V. MTN 20/32	EUR	500.000		396.805,00	
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	62.413		57.033,62	
1,2500 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1325 14/25	EUR	200.000		192.100,00	
7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32	USD	300.000		316.050,60	
0,7500 % Sagax EURO MTN NL B.V. MTN 21/28	EUR	500.000		375.612,51	
3,5000 % The Kroger Co. Notes 16/26	USD	300.000		268.868,59	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR			2.466.450,32	2.466.450,32

Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 2.912.490,00

#### Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.12.2022

Deviserikurs(e) bzw. Koriversior	israktor(em) (iii ivie	ngennouz) per	30.12.2022
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88517	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43665	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,52270	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,13270	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,98633	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06725	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,44442	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	140,62500	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,32280	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,57020	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,68375	= 1 Euro (EUR)

#### Marktschlüssel Terminbörsen

IFEU XSFE XEUR London - ICE Futures Europe Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24 Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich) XOSE

Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options

XIOM Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Option Market (IOM)

XCBO Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE) XCME Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT) Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options Stockholm - Nasdaq Stockholm - Derivatives XCBT

XMOD

XNDX

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 Aktien	e Wertpapiere	Nominal in Wilg.		
AUD				
AU000000AZJ1	Aurizon Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	28.793
AU000000FMG4	Fortescue Metals Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	8.623
AU0000224040	Woodside Energy Group Ltd Reg.Shares	STK	2.352	2.352
CAD	Trouside Energy Group Eta Negishares	3110	2.552	2.552
CA11777Q2099	B2Gold Corp. Reg.Shares	STK	0	24.400
CA39138C1068	Great-West Lifeco Inc. Reg.Shares	STK	0	4.600
CA8672241079	Suncor Energy Inc. Reg.Shares	STK	1.000	1.000
CHF				
CH0030170408	Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.)	STK	0	216
CH0012214059	Holcim Ltd. Namens-Aktien	STK	0	2.730
CH0025751329	Logitech International S.A. Namens-Aktien	STK	0	1.325
DKK				
DK0060634707	Royal Unibrew AS Navne-Aktier	STK	0	1.444
EUR				
NL0000334118	ASM International N.V. Reg.Shares	STK	0	353
DE000A1DAHH0	Brenntag SE Namens-Aktien	STK	0	1.874
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG Namens-Aktien	STK	0	1.343
ES0130670112	Endesa S.A. Acciones Port.	STK	0	3.975
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom.	STK	9.520	9.520
FR0014008VX5	EuroAPI SAS Actions Nom.	STK	104	104
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien	STK	0	3.509
DE0006047004	HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien	STK	0	1.173
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE Namens-Aktien	STK	0	1.207
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK	443	2.409
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC Reg.Shares	STK	0	1.904
DE0008303504	TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien	STK	958	5.797
FR0000120271 <b>GBP</b>	TotalEnergies SE Actions au Porteur	STK	2.198	2.198
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares	STK	0	589
GB0000811801	Barratt Developments PLC Reg.Shares	STK	8.872	17.900
IE0002424939	DCC PLC Reg.Shares	STK	0	992
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC Reg.Shares	STK	0	1.141
GB00BMX86B70	Haleon PLC Reg.Shares	STK	7.149	7.149
GB0032089863	NEXT PLC Reg.Shares	STK	0	1.892
JPY				
JP3830000000	Brother Industries Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.800
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd. Reg. Shares	STK	0	2.300
JP3360800001	Hulic Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	9.600
JP3138400001	Izumi Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.400
JP3210200006	Kajima Corp. Reg.Shares	STK	0	15.200
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	300
JP3762600009	Nomura Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	43.400
JP3500610005	Resona Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	23.500
JP3449020001	Taiheiyo Cement Corp. Reg.Shares	STK	0	3.800
JP3443600006	Taisei Corp. Reg.Shares	STK	0	2.900
JP3613000003	Toyo Suisan Kaisha Ltd. Reg.Shares	STK	2.400	2.400
JP3940000007	Yamato Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	6.700
NOK	E : AGAN AL:	CTIV	4 405	4 405
NO0010096985	Equinor ASA Navne-Aksjer	STK	1.405	1.405
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer	STK	0	5.339
NO0010208051	Yara International ASA Navne-Aksjer	STK	0	3.472
SEK	Flortrolov, AD Nama Altior D	CTV		E 747
SE0016589188	Electrolux, AB Namn-Aktier B	STK STK	2 406	5.747
SE0001662230 SE0000667891	Husqvarna AB Namn-Aktier B Sandvik AB Namn-Aktier	STK	3.496 0	11.097 5.678
SE000067891 SE0000113250	Skanska AB Namn-Aktier B (fria)	STK	0	6.643
SE0000113230 SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A	STK	0	11.241
323007100333	Svenska Handelsbanken Ab Hamm Aktiel A	1 211	0	11.241

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
USD	24.C. P. C.	CTIV		777
US88579Y1010 US02005N1000	3M Co. Reg.Shares Ally Financial Inc. Reg.Shares	STK STK	0 2.241	777   2.241
US0234361089	Amedisys Inc. Reg.Shares	STK	0	476
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares	STK	328	1.849
US0427351004	Arrow Electronics Inc. Reg.Shares	STK	0	1.638
US09247X1019	Blackrock Inc. Reg.Shares	STK	0	118
US1344291091 US14149Y1082	Campbell Soup Co. Reg.Shares Cardinal Health Inc. Reg.Shares	STK STK	0 0	2.197 3.497
US2058871029	ConAgra Brands Inc. Reg.Shares	STK	0	5.994
US20825C1045	ConocoPhillips Reg.Shares	STK	560	560
US2283681060	Crown Holdings Inc. Reg.Shares	STK	794	794
US25179M1036	Devon Energy Corp. Reg.Shares	STK	874	874
US25278X1090	Diamondback Energy Inc. Reg.Shares	STK	416	416
US2567461080	Dollar Tree Inc. Reg.Shares	STK STK	327 0	1.672 417
US25754A2015 US2786421030	Dominos Pizza Inc. Reg.Shares eBay Inc. Reg.Shares	STK	0	2.318
US28176E1082	Edwards Lifesciences Corp. Reg.Shares	STK	0	1.674
US26875P1012	EOG Resources Inc. Reg.Shares	STK	494	494
US34959E1091	Fortinet Inc. Reg.Shares	STK	0	474
US3687361044	Generac Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	308
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares	STK	0	451
US8326964058 US4943681035	J.M. Smucker Co. Reg.Shares Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares	STK STK	0 0	1.145 852
US5260571048	Lennar Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	0	1.742
US5658491064	Marathon Oil Corp. Reg.Shares	STK	2.219	2.219
US5779331041	Maximus Inc. Reg.Shares	STK	0	821
US30303M1027	Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	1.003
US5951121038	Micron Technology Inc. Reg.Shares	STK	0	2.752
US6174464486	Morgan Stanley Reg.Shares	STK	0	1.373
US62944T1051	NVR Inc. Reg.Shares	STK STK	23 842	23
US68389X1054 US67103H1077	Oracle Corp. Reg.Shares O'Reilly Automotive Inc.[New] Reg.Shares	STK	042	2.656 194
US7237871071	Pioneer Natural Resources Co. Reg. Shares	STK	233	233
US74736K1016	Qorvo Inc. Reg.Shares	STK	0	1.078
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares	STK	0	272
IE00BKVD2N49	Seagate Technolog.Holdings PLC Reg.Shares	STK	0	2.173
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares	STK	0	753
US8740541094 US38141G1040	Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares	STK STK	0 0	913 434
US9892071054	The Goldman Sachs Group Inc. Reg.Shares Zebra Technologies Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	0	295
Verzinsliche Wer		SIK	١	255
EUR				
XS1533918584	2,0000 % Azimut Holding S.p.A. Bonds 17/22	EUR	0	500.000
XS2125426796	0,3750 % DSV A/S MTN 20/27	EUR	0	700.000
XS1576819079	1,8750 % Fastighets AB Balder Notes 17/25	EUR	0	500.000
XS2303070911 XS1626574708	0,2500 % H&M Finance B.V. MTN 21/29 1,1250 % Metso Outotec Oyj MTN 17/24	EUR EUR	0	700.000 500.000
XS2114871945	1,000 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB MTN 20/27	EUR	0	500.000
XS2233121792	1,3750 % SATO Oyj MTN 20/28	EUR	0	500.000
USD				
US377372AN70	3,8750 % GlaxoSmithkline Capital Inc. Notes 18/28	USD	500.000	500.000
US71429MAC91	4,4000 % Perrigo Finance Unlimited Co. Notes 20/30	USD	0	500.000
US74365PAA66	3,6800 % Prosus N.V. Notes 20/30 144A	USD	0	1.000.000
An organisierten Aktien	Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
AUD				
AU000000ANZ3	Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.060
Verzinsliche Wer	tpapiere			
USD	4 0000 0/ 81 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	1165		500.000
US09247XAR26	1,9000 % Blackrock Inc. Notes 20/31	USD	0	500.000
US36264FAB76 US29266MAF68	3,3750 % GSK Consumer Health.Cap.US LLC Notes 22/27 144A 6,7500 % Iberdrola International B.V. Notes 06/36	USD USD	500.000	500.000 500.000
US512807AV02	1,9000 % Lam Research Corp. Notes 20/30	USD	0	500.000
US526057CT92	5,2500 % Lennar Corp. Notes 17/26	USD	0	500.000
US62947QAY44	5,5500 % NXP B.V./NXP Funding LLC Notes 18/28 144A	USD	0	1.000.000
US70450YAH62	2,3000 % PayPal Holdings Inc. Notes 20/30	USD	0	500.000
US82620KAF03	4,4000 % Siemens Finan.maatschappij NV Notes 15/45 144A	USD	0	500.000
US963320AW61  Nichtnotierte We	4,7500 % Whirlpool Corp. Notes 19/29	USD	0	500.000
Aktien CAD	пфариете			
CA01626P3043 GBP	Alimentation Couche-Tard Inc. Reg.Shs (Mul. Vtg)	STK	0	3.300
GB0009252882	GSK PLC Reg.Shares	STK	7.149	7.149
GB0002405495	Schroders PLC Reg.Shares	STK	887	3.025
<b>SEK</b> SE0017486871	Atlas Copco AB Namn-Aktier B Red.	STK	4.046	4.046

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
SE0011166628 <b>Verzinsliche Wer</b>	Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria) t <b>papiere</b>	Nominal in Whg. STK	0	4.046
EUR DE000BLB7YK5 Andere Wertpap	0,2030 % Bayerische Landesbank FLR HypPfe. 19/22 iere	EUR	0	100.000
<b>AUD</b> AU0000232860	Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Anrechte	STK	270	270
EUR DE000A31C3C0	TAG Immobilien AG Inhaber-Bezugsrechte	STK	4.839	4.839
Wertpapier-Inves	stmentanteile Wertpapier-Investmentanteile			
USD LU1686830909	L. I. Fd - L. I. DL Li. EM S. Act. Nom. Dis.	ANT	13.500	22.700
201000030303	E. I. To E. I. DE E. LW J. Act. Noll. Dis.	AWI	13.300	22.700
Gattungsbezeich	nung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.		Volumen in 1.000
	ning-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Angabe der Käufe und Verkäufe.)			
Aktienindex-Tern Gekaufte Kontra		EUR		14.334
(Basiswert(e): ESTX	Mid Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, MDAX Performance-Index, MSCI Emerging Markets Index, MSCI		dex (USD), Nasdaq-100	
Index, S&P/ASX 20 Verkaufte Kontra	kte:	EUR		65.179
, , ,	D STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), C (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))	OMX Stockholm 30 Inde	x, S&P 500 Index, S&P/A	ASX 200 Index,
Zinsterminkontra Gekaufte Kontra	·······	EUR		36.469
	ear Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz F Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Two-Year US Treasury Note Future (TU))	uture (FGBS), EURO-BTP	Future (FBTP), Five-Yea	US Treasury Note
Verkaufte Kontra		EUR	Future (FLG) Ten-Vear I	132.165
	ear US Treasury Note Future (TU), US Treasury Long Bond Future (US))	e ruture (i v), Long Giit	ruture (r.E.G.), Teri-Tear (	os neasury Note
Optionsrechte Optionsrechte au	rf Aktienindex-Derivate			
Optionsrechte au Gekaufte Kaufop		EUR		36.952
(Basiswert(e): EUR( Gekaufte Verkau	D STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index)	EUR		52.875
	D STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)			
Sonstige Options Gekaufte Verkau		EUR		4.226
	E Volatility Index (VIX))	LOK		4.220
	ntrakte (Verkauf)			
Verkauf von Dev AUD/EUR	isen auf Termin:	EUR		522
CAD/EUR CHF/EUR		EUR EUR		4.361 1.539
DKK/EUR		EUR		1.237
GBP/EUR JPY/EUR		EUR EUR		18.643 3.107
NOK/EUR		EUR		742
SEK/EUR		EUR		2.220
USD/EUR  Devisenterminko	ntrakte (Kauf)	EUR		99.941
Kauf von Deviser				
AUD/EUR CAD/EUR		EUR EUR		528 5.195
CHF/EUR		EUR		1.895
DKK/EUR		EUR		1.546
GBP/EUR JPY/EUR		EUR EUR		24.905 3.720
NOK/EUR		EUR		1.083
SEK/EUR USD/EUR		EUR EUR		3.277 133.478
Wertpapierdarlel vereinbarten We	nen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes			
befristet	•	EUR		392
unbefristet	30 % Eurogrid GmbH MTN 20/32)	EUR	A   17/27   0.2500	46.339

19/29, 0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 20/25, 0,7500 % Sagax EURO MTN NL B.V. MTN 21/28, 0,8750 % BMW Finance N.V. MTN 20/32, 1,0000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 17/27, 1,0000 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB MTN 20/27, 1,1130 % Eurogrid GmbH MTN 20/32, 1,2500 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1325 14/25, 1,3750 % Edenred S.A. Notes 15/25, 1,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 1725, 1,3750 % Naturgy Finance B.V. MTN 17/27, 1,3820 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 20/26, 1,5000 % ENI S.p.A. MTN 17/27, 2,0000 % Klépierre S.A. MTN 20/29, 2,0000 % Schlumberger Finance B.V. Notes 20/32, 2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26, 2,3750 % Signify N.V. Notes 20/27, 2,7500 % Großbritannien Treasury Stock 14/24, 3,2500 % Crown Castle Inc. Notes 20/51, 3,7000 % Anheuser-Busch Inßev S.A./N.V. MTN 20/40, 7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32, Allianz SE vink.Namens-Aktien, Ally Financial Inc. Reg.Shares, Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A, Andritz AG Inhaber-Aktien, ASML Holding N.V. Aandelen op naam, Barratt Developments PLC Reg.Shares, Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien, Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares, Husqvarna AB Namn-Aktier B, Mastercard Inc. Reg.Shares A, Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien, Merck KGaA Inhaber-Aktien, Nokia Oyj Reg.Shares, Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B, OMV AG Inhaber-Aktien, Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port., Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares, Skanska AB Namn-Aktier B (fria), Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A, TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien, TAG Immobilien AG Inhaber-Bezugsrechte, Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares, Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Akt. B (fria), Telenet Group Holding N.V. Actions Nom., Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam, Zebra Technologies Corp. Reg.Shares Cl.A)

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0 Euro.

En	wicklung des Sondervermögens			
<b>I.</b> 1	Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr			EUR 105.420.815,31 -521.547,50
2	Zwischenausschüttung(en)			
3	Mittelzufluss (netto)			-685.741,53
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	6.206.539,66	
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	6.206.539,66	
	davon aus Verschmelzung	EUR	0,00	
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-6.892.281,19	
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			-58.523,61
5	Ergebnis des Geschäftsjahres			-11.257.697,36
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne			-2.532.242,41
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste			-8.527.607,48
II.	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres			92.897.305,31

## Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

31.12.2020     113.360.330,41     10       31.12.2021     105.420.815,31     10		vvert des sondervermogens din Ende des desendrejames	7 11110111110111
31.12.2020     113.360.330,41     10       31.12.2021     105.420.815,31     10		EUR	EUR
31.12.2021 105.420.815,31 10	1.12.2019	0,00	0,00
	1.12.2020	113.360.330,41	100,19
31.12.2022 92.897.305,31 9.	1.12.2021	105.420.815,31	105,03
	1.12.2022	92.897.305,31	93,51

# Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2022 - 31.12.2022

(einschließlich Ertragsausgleich)

(CII	ischillebilich Ertragsausgielich	EUR	EUR
I.	Erträge	insgesamt	je Anteil *)
1.	Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	54.072,28	0,05
2.	Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	741.941,94	0,75
3.	Zinsen aus inländischen Wertpapieren	82.030,95	0,08
4.	Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	1.223.526,30	1,23
	Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	22.068,38	0,02
٥.	davon Negative Einlagezinsen	-11.105,91	-0,01
	davon Positive Einlagezinsen	33.174,29	0,03
6.	Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7.	Erträge aus Investmentanteilen	225.853,75	0,23
	Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	8.476,60	0,01
	davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	8.476.60	0.01
9a.	Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-8.110,94	-0,01
	davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge	-8.110,94	-0,01
9b.	Abzug ausländischer Quellensteuer	-143.861,90	-0,14
	davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-143.861,90	-0,14
10.	Sonstige Erträge	128.852,78	0,13
	davon Kick-Back-Zahlungen	4.517,30	0.00
	davon Kompensationszahlungen	121.040,86	0,12
	davon Quellensteuerrückvergütung Dividenden	3.294,62	0,00
	Summe der Erträge	2.334.850,14	2,35
		•	•
II.	Aufwendungen		
1.	Zinsen aus Kreditaufnahmen	-3.002,10	-0,00
2.	Verwaltungsvergütung	-671.523,63	-0,68
3.	Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4.	Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5.	Sonstige Aufwendungen	-197.991,00	-0,20
	davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-2.796,83	-0,00
	davon EMIR-Kosten	-4.231,96	-0,00
	davon Erfolgsbeteiligungen Rechtsansprüche durch Dritte	-378,52	-0,00
	davon Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	-108,66	0,00
	davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-3.687,91	-0,00
	davon Kostenpauschale	-172.677,62	-0,17
	davon Ratinggebühren	-14.109,50	-0,01
	Summe der Aufwendungen	-872.516,73	-0,88
III.	Ordentlicher Nettoertrag	1.462.333,41	1,47
IV.			
1.	Realisierte Gewinne	12.259.378,78	12,34
2.		-13.919.559,66	-14,01
	Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-1.660.180,88	-1,67
V.	Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-197.847,47	-0,20
1	Nettoveränderung der nicht realizierten Gewinne	2 522 242 44	י דר
1. 2.	Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-2.532.242,41 -8.527.607,48	-2,55 -8,58
۷.	Nettoveranderung der nicht realisierten verluste	-0.327.007,48	-0,58
VI.	Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-11.059.849,89	-11,13
VII	. Ergebnis des Geschäftsjahres	-11.257.697,36	-11,33
	and the same of th		

<sup>\*)</sup> Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung

ı.	Für die Ausschüttung verfügbar	EUR insgesamt	EUR je Anteil <sup>*)</sup>
1	Vortrag aus dem Vorjahr	5.473.825,16	5,51
2	Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-197.847,47	-0,20
3	Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,00
II.	Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1	Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2	Vortrag auf neue Rechnung	3.616.862,75	3,64
III.	Gesamtausschüttung <sup>1)</sup>	1.659.114,94	1,67
1	Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2	Endausschüttung <sup>2)</sup>	1.659.114,94	1,67

Umlaufende Anteile: Stück 993.482

<sup>\*)</sup> Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

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.

Ausschüttung am 24. Februar 2023 mit Beschlussfassung vom 21. Februar 2023.

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ Anhang.

Zu	sätzliche	Angaben	zu	den	Derivaten

Zusatzliche Angaben zu den Derivaten		
Instrumentenart	Kontrahent	Exposure in EUR
		(Angabe nach Marktwerten)
Aktienindex-Terminkontrakte	ASX Trade24	-2.913,65
Aktienindex-Terminkontrakte	Chicago Mercantile Exchange Inc. (CME)	-89.946,73
Aktienindex-Terminkontrakte	CME Globex	382.763,17
Aktienindex-Terminkontrakte	Eurex Deutschland	107.053,01
Aktienindex-Terminkontrakte	ICE Futures Europe	186,40
Aktienindex-Terminkontrakte	Montreal Exchange (ME) - Futures and Options	33.846,23
Aktienindex-Terminkontrakte	NASDAQ Stockholm - Derivatives (NASDAQ	5.474,58
	Derivatives Markets)	
Aktienindex-Terminkontrakte	Osaka Exchange - Futures and Options	24.746,67
Devisenterminkontrakte	BofA Securities Europe S.A.	138.572,46
Devisenterminkontrakte	DekaBank Deutsche Girozentrale	-5.447,90
Devisenterminkontrakte	J.P. Morgan SE	486.991,75
Inflation Swaps	BNP Paribas S.A.	401.768,40
Optionsrechte auf Aktienindices	CBOE Options Exchange (CBOE Options)	67.953,15
Optionsrechte auf Aktienindices	Eurex Deutschland	29.700,00
Zinsterminkontrakte	Chicago Board of Trade (CBOT)	133.930,77
Zinsterminkontrakte	Eurex Deutschland	334.529,50
Zinsterminkontrakte	ICE Futures Europe	-6.936,52
Gesamtbetrag der bei Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten:	EUR	730.000,00
davon:		
Bankguthaben	EUR	730.000,00

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)

50% ICE BofA Global Corporate Index in EUR, 15% ICE BofA World Sovereign Bond Index in EUR, 35% MSCI World NR in EUR

Dem Sondervermögen wird ein derivatefreies 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 derivatefreier Vergleichsmaßstab wird möglichst genau nachgebildet. In Ausnahmefällen kann von der Forderung des derivatefreien 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)

01.01.2022 - 18.09.2022 kleinster potenzieller Risikobetrag 1,11% größter potenzieller Risikobetrag 1.96% durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 1.53%

19.09.2022 - 31.12.2022 kleinster potenzieller Risikobetrag 1,70% größter potenzieller Risikobetrag 2,44% durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 1,98%

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% aufwiese, 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 derivatefreien Vergleichsvermögens nicht übersteigen. Hierdurch wird das Marktrisiko des Sondervermögens klar limitiert.

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

01.01.2022 - 18.09.2022: Varianz-Kovarianz Ansatz 19.09.2022 - 31.12.2022: 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)

#### 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	d Pensionsgeschäften (besichert)

Instrumentenart	Kontrahent		kposure in EUR n Marktwerten)
Wertpapier-Darlehen	DekaBank Deutsche Girozentrale	(Allyabe liaci	2.466.450,32
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten: davon: Schuldverschreibungen		EUR EUR	2.792.514,90 2.792.514,90
Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR EUR	8.476,60 2.796,83

Umlaufende AnteileSTK993.482AnteilwertEUR93,51

#### Angaben zu Bewertungsverfahren

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

#### Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

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

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

#### Investmentanteile

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

#### Derivate

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Futures und Optionen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht 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.

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt

#### 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) 0,91%

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

Für das Sondervermögen ist gemäß den Anlagebedingungen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Kostenpauschale von insgesamt 0,18% 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 Aufwandserstattungen 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:		
Deka-MultiFactor Global Corporates HY I	0,30	
Deka-MultiFactor Global Corporates I	0,25	
Deka-Vega Plus I (A)	0,60	
iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	0,50	
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	n.v.	
L. I. Fd - L. I. DL Li. EM S. Act. Nom. Dis.	0,30	
UBS(L)FS-JPM DL EM IG ESG D.B. Act. Nom. A Acc.	0,45	
W. Orleans and Table		
Wesentliche sonstige Erträge	FLID	4 517 20
Kick-Back-Zahlungen	EUR	4.517,30
Kompensationszahlungen	EUR	121.040,86
Quellensteuerrückvergütung Dividenden	EUR	3.294,62
Wesentliche sonstige Aufwendungen		
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	2.796,83
EMIR-Kosten	EUR	4.231,96
Erfolgsbeteiligungen Rechtsansprüche durch Dritte	EUR	378,52
Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	EUR	108,66
Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	EUR	3.687,91
Kostenpauschale	EUR	172.677,62
Ratinggebühren	EUR	14.109,50

109.142.07

FUR

#### 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.

#### Vergütungskomponenter

Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter 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 Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, 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 Mitarbeiters 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 Mitarbeiter erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

#### Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

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

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters 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 Mitarbeitern 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 Mitarbeiters, 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 Mitarbeiter, 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

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2021 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 2021 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	52.919.423,38
davon feste Vergütung	EUR	43.285.414,31
davon variable Vergütung	EUR	9.634.009,07
Zahl der Mitarbeiter der KVG	455	
Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der		
Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**	EUR	7.381.436,36
Geschäftsführer	EUR	2.103.677,90
weitere Risk Taker	EUR	1.913.005,27
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR	488.811,00
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risk Taker	EUR	2.875.942,19

<sup>\*</sup> Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt.

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) Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR in % des Fondsvermögens 2.466.450,32 2,66

10 größte Gegenparteien Wertpapier-Darlehen (besichert) DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

**Sitzstaat** Deutschland

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

#### 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)

absolute Beträge in EUR

2.466.450.32

#### 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

USD

unbefristet

#### Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

absolute Beträge in EUR

2.792.514.90

#### **Ertrags- und Kostenanteile**

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	8.681,69	100,00
Kostenanteil des Fonds	2.864,96	33,00
Ertragsanteil der KVG	2.864,96	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.

#### Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

2,81% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

wei chapiei-barierieri	absolutes volumen dei	
	empfangenen Sicherheiten in EUR	
The Bank of Nova Scotia	1.746.229,50	
NRW.BANK	465.553,01	
Kreditanstalt für Wiederaufbau	216.701,55	
Hessen, Land	200.064,16	
Medtronic Global Holdings SCA	163.966,67	

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht von

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

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer 2

J.P.Morgan AG Frankfurt 2.126.897,72 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

Clearstream Banking Frankfurt 665.617,18 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.

#### Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Sw	aps
gesonderte Konten/Depots	0,00%
Sammelkonten/Depots	0,00%
andere Konten/Depots	0,00%
Verwahrart 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.

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 Absätz 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, Verfahrensweisen 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. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

#### Name des Produkts:

Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

### **Unternehmenskennung (LEI-Code):**

529900GWO76XXDPZYJ72

# Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige i	Nein
Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _%	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 15,85% an nachhaltigen Investitionen
in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	mit einem sozialen Ziel
Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _%	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine</b> <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



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 mindestens 51% des Fondsvermögens

• 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 Auswir-

kungen 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 Förderung von Kohle generierten
- hre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung oder dem Vertrieb im Geschäftsfeld Rüstungsgüter generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung im Geschäftsfeld Tabak generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% im Geschäftsfeld Glücksspiel generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus der Verstromung von Kohle 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
- 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 konnte durch direkte Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente oder indirekte Investitionen über Zielfonds in Unternehmen und Staaten erfolgen, die mit ihren (Geschäfts-) Tätigkeiten zur Erreichung eines oder mehrer 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?".

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 49,61 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 45,07 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 6,83.

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.

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.

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?".

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.

# 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 Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien 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 seit dem 01.06.2022 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 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 Unternehment (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 seit dem 01.06.2022 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 bis 31.08.2022 veräußert.

Seit dem 01.09.2022 wurde dann nicht mehr in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen investiert, deren CO2-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und/ oder Energieverbrauchsintensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt. Zudem wurde seit dem 01.09.2022 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 seit dem 01.09.2022 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 seit dem 01.09.2022 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, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- CO2-Fußabdruck (PAI 2, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (PAI 4, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (PAI 5, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Emissionen in Wasser (PAI 8, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (PAI 9, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-

Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (PAI 12, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress (PAI 8, Tabelle 2, (EU) 2022/1288)

Für Zielfonds waren seit dem 01.12.2022 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 Unternehment (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)

Zielfonds, bei denen die festgelegten Schwellenwerte überstritten wurden, vorausgesetzt einer ausreichenden Datenverfügbarkeit bei den PAI-Indikatoren, konnten seit dem 01.12.2022 nicht mehr für das Sondervermögen erworben werden. Bereits vor dem 01.12.2022 gehaltene Zielfonds, bei denen die festgelegten Schwellenwerte überschritten wurden, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger bis zum Berichtsstichtag 31.12.2022 veräußert.

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/corporategovernance.



## 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: 01.01.2022 -31.12.2022 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	Land
Großbritannien Treasury Stock 14/24 (GB00BHBFH458)	Staatsanleihen	Vermögenswerte 6,03%	Vereinigtes Königreich
Deka-MultiFactor Gl.Cor.HY FCP Inhaber-Anteile I (LU1685587591)	Zielfonds	3,98%	Luxemburg
Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1247 13/25 (DE000NRW2111)	Quasi- & Fremdwährungs- Staatsanleihen	3,17%	Deutschland
Land Berlin Landessch. Ausg.514 19/30 (DE000A2NB9V2)	Quasi- & Fremdwährungs- Staatsanleihen	2,68%	Deutschland
U.S. Treasury Bonds 01/31 (US912810FP85)	Staatsanleihen	2,04%	Vereinigte Staaten
Apple Inc. Reg.Shares (US0378331005)	Hardware & Ausrüstung	1,79%	Vereinigte Staaten
Deka-Vega Plus Inhaber-Anteile I (A) (DE0005424568)	Zielfonds	1,77%	Deutschland
Microsoft Corp. Reg.Shares (US5949181045)	Software & Dienste	1,48%	Vereinigte Staaten
U.S. Treasury Notes 16/26 (US912828U246)	Staatsanleihen	0,99%	Vereinigte Staaten
MPLX L.P. Notes 18/28 (US55336VAR15)	Energie	0,95%	Vereinigte Staaten
A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 18/26 (XS1789699607)	Transportwesen	0,71%	Dänemark
Naturgy Finance B.V. MTN 17/27 (XS1551446880)	Versorgungsbetriebe	0,69%	Niederlande
Vantage Towers AG KpAnl. 21/25 (DE000A3H3J14)	Investitionsgüter	0,68%	Deutschland
Italgas S.P.A. MTN 20/25 (XS2192431380)	Versorgungsbetriebe	0,68%	Italien
Mercialys Bonds 18/26 (FR0013320249)	Immobilien	0,66%	Frankreich



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensalloka- tion** 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 95%. Darunter fallen alle Investitionen, die die im Rahmen der verbindlichen Elemente der ESG-Anlagestrategie definierten Ausschlusskriterien des Fonds einhielten.

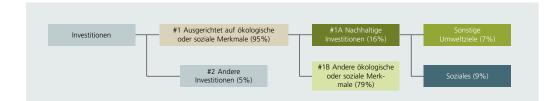
Nachhaltige Investitionen (#2 nachhaltige Investitionen) im Sinne des Artikel 2 Nr.17 der Offenlegungsverordnung ((EU) 2019/2088) sind alle Investitionen des Finanzprodukts in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beitragen, vorausgesetzt, dass diese 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 16%. 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 letzten drei Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums dar und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Geringfügige Abweichungen in der prozentualen Gewichtung der Investitionen resultieren aus rundungsbedingten Differenzen. Aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit, konnte der erste Quartalsstichtag des Berichtszeitraums bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden.



- **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst die Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
- **#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

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

Die Zuteilung der Investitionen zu den Sektoren und Teilsektoren 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 enthalteten Zielfonds unter "Zielfonds". Unter "Sonstige" fielen Bankguthaben, Derivate, Forderungen und Emittenten, für die keine Branchenzuteilung vorlag.

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 8,41% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilsektoren 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	4,18%
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	0,89%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	2,26%
Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	1,03%
Energie	4,74%
Energie	4,74%
Finanzwesen	9,60%
Banken	2,23%
Diversifizierte Finanzdienste	2,59%
Versicherungen	4,78%
Gesundheitswesen	9,09%
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	3,96%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	5,13%
Immobilien	4,33%
Immobilien	4,33%
Industrie	8,64%
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	0,57%
Investitionsgüter	5,59%
Transportwesen	2,48%
Informationstechnologie	11,22%
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	1,81%
Hardware & Ausrüstung	3,33%
Software & Dienste	6,08%
Kommunikationsdienste	4,64%
Medien & Unterhaltung	2,32%
Telekommunikationsdienste	2,32%
Nicht-Basiskonsumgüter	6,83%
Automobile & Komponenten	1,85%
Dienstleistungsunternehmen	1,78%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	1,05%
Groß- und Einzelhandel	2,15%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	6,57%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	6,57%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2,96%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2,96%
Sonstige	7,29%
Sonstige	7,29%
Staatsanleihen	9,16%
Staatsanleihen	9,16%
Versorgungsbetriebe	4,02%
Versorgungsbetriebe	4,02%
Zielfonds	6,71%
Zielfonds	6,71%

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die die gegenwärtige "Umweltfreundlichkeit" der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- investiert wird, aufzeigen **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

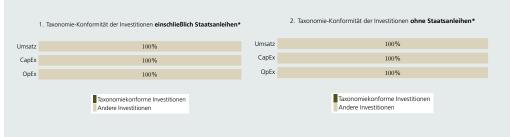
Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht nachweisbar in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu keinem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug demnach 0% (gemessen an den drei Leistungsindikatoren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

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

Nein, es erfolgten keine nachweisbaren taxonomiekonformen Investitionen im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie.

In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\*Für die Zwecke dieser Diagramme 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 CO<sub>2</sub>-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 6,93%.

Die Berechnung des Anteils basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den letzten drei Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit, konnte der erste Quartalsstichtag des Berichtszeitraums bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 8,92%.

Die Berechnung des Anteils basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den letzten drei Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit, konnte der erste Quartalsstichtag des Berichtszeitraums bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden.



# 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 Researchbzw. 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-investmentim-profil/corporate-governance.

Frankfurt am Main, den 11. April 2023 Deka Investment GmbH Die Geschäftsführung

# Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

# An die Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main

## Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka-ESG Sigma Plus Konservativ – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 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.

# 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 einzubeziehen. 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 13. April 2023

# KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Kühn Wirtschaftsprüfer Steinbrenner 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 2021

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

S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;

Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

## Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der

Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der

LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

## Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)

 $Mitglied\ des\ Aufsichtsrates\ der\ S-Pensions Management\ GmbH,$ 

Köln

und der

Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln;

Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter

Mitglied der Geschäftsführung der

Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;

Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der

IQAM Invest GmbH, Salzburg

Thomas Schneider

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,

Luxemburg;

Mitglied der Geschäftsführung der

Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;

Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

# Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

The Squaire

Am Flughafen

60549 Frankfurt am Main

### Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale Mainzer Landstraße 16 60325 Frankfurt am Main

Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

## Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

## Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Dezember 2022

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

