

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2022.

# **Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2022

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 30. Juni 2022.

Bis in den Februar 2022 hinein beherrschte die Corona-Pandemie die Schlagzeilen an den Börsen, wobei die Inflationsentwicklung zunehmend an Bedeutung gewann. Die Erholung der globalen Wirtschaft setzte sich zunächst fort, wobei sich das Wachstumstempo in Euroland verlangsamte. Der Überfall-Angriff Russlands auf die Ukraine Ende Februar markierte als exogenes Schockereignis den Wendepunkt und versetzte das Geschehen an den internationalen Kapitalmärkten in den Krisenmodus. Umfangreiche Sanktionsmaßnahmen des Westens wurden gegen den russischen Aggressor auf den Weg gebracht. Russland seinerseits verhängte Gegenmaßnahmen und stoppte die Lieferung von Gas in mehrere europäische Länder oder reduzierte wahlweise die Liefermengen. Signifikante Preissteigerungen für Energie und Rohstoffe, Lieferkettenprobleme sowie Corona-Lockdowns in China belasteten das Marktumfeld.

Die Geld- und Fiskalpolitik wurde in den vergangenen sechs Monaten von der rasanten Inflationsentwicklung dominiert. Sowohl die EZB als auch die Federal Reserve haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet. Darüber hinaus vollzog die US-Notenbank die Leitzinswende und erhöhte diesen im März um 25, Anfang Mai um 50 Basispunkte und Mitte Juni um weitere 75 Basispunkte. Dank einer stark expansiven Finanzpolitik haben sich die USA rascher als Europa von der Pandemie erholt. Zudem trifft der Krieg gegen die Ukraine die europäische Wirtschaft um ein Vielfaches stärker. Für die EZB ist daher eine Zinserhöhung problematischer. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo kräftig an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 1,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,0 Prozent.

Nahezu sämtliche bedeutenderen Aktienmärkte weltweit rangierten per saldo auf negativem Terrain. Die Inflationsentwicklung, hohe Rohstoffpreise, Lieferkettenprobleme sowie der Krieg in der Ukraine setzten die Kurse wiederholt unter Druck. Insbesondere Wachstumstitel – etwa aus dem Technologiebereich – waren hiervon überdurchschnittlich stark betroffen.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

|   |    |
|---|----|
| Anlagepolitik                               | 5  |
| Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022        | 6  |
| Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022      | 7  |
| Anhang                                      | 16 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 18 |

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

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Fonds ist ein mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und die positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Der Fonds legt mindestens 25% des Aktivvermögens (Wert der Vermögensgegenstände ohne Berücksichtigung von Verbindlichkeiten) in Kapitalbeteiligungen i.S.d. § 2 Abs. 8 InvStG an. Der Investmentfonds darf mehr als 35% 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 65%. 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.

Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Die Erträge eines Geschäftsjahres werden bei dieser Anteilklasse grundsätzlich ausgeschüttet.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| Performance*  | 6 Monate     |
|---|--------------|
|   | -10,8%       |
| ISIN  | DE000DK0V6D3 |
| * Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. |              |

Die Anleger können börsentäglich die Rücknahme der Anteile verlangen. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Rücknahme aussetzen oder einschränken, wenn außergewöhnliche Umstände dies zur Wahrnehmung der Anlegerinteressen erforderlich erscheinen lassen. Setzt die Verwaltungsgesellschaft die Rücknahme von Anteilen ganz oder teilweise aus und lehnt daher die Rücknahme der Anteile ganz (Rücknahmeaussetzung) oder teilweise (Rücknahmebeschränkung) ab, kann dies dazu führen, dass der Auftrag ganz zu einem späteren Zeitpunkt ausgeführt wird oder dass ein Auftrag in Höhe seines nicht ausgeführten Anteils erlischt.

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022.

| Gliederung nach Anlageart - Land                            | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Aktien</b>  | <b>26.068.005,87</b> | <b>55,01</b>                 |
| Australien  | 319.327,63           | 0,68                         |
| Belgien   | 27.156,08            | 0,06                         |
| Dänemark  | 298.503,63           | 0,62                         |
| Deutschland   | 811.480,58           | 1,70                         |
| Finnland  | 192.616,15           | 0,41                         |
| Frankreich  | 870.521,51           | 1,83                         |
| Großbritannien  | 647.788,52           | 1,37                         |
| Irland  | 443.367,08           | 0,93                         |
| Israel  | 131.615,01           | 0,28                         |
| Italien   | 223.461,47           | 0,48                         |
| Japan   | 1.363.075,98         | 2,90                         |
| Kanada  | 1.390.010,46         | 2,93                         |
| Niederlande   | 689.405,20           | 1,46                         |
| Norwegen  | 87.633,68            | 0,18                         |
| Österreich  | 84.852,32            | 0,18                         |
| Schweden  | 468.210,70           | 0,99                         |
| Schweiz   | 568.146,10           | 1,20                         |
| Spanien   | 88.657,12            | 0,19                         |
| USA   | 17.362.176,65        | 36,62                        |
| <b>2. Anleihen</b>  | <b>11.738.875,21</b> | <b>24,76</b>                 |
| Belgien   | 535.338,00           | 1,13                         |
| Bermuda   | 154.971,03           | 0,33                         |
| Dänemark  | 752.222,91           | 1,58                         |
| Deutschland   | 2.222.812,50         | 4,67                         |
| Finnland  | 200.017,00           | 0,42                         |
| Frankreich  | 746.377,00           | 1,58                         |
| Luxemburg   | 366.330,00           | 0,77                         |
| Niederlande   | 620.159,80           | 1,31                         |
| Österreich  | 170.723,00           | 0,36                         |
| Spanien   | 487.356,00           | 1,03                         |
| USA   | 5.482.567,97         | 11,58                        |
| <b>3. Investmentanteile</b>                                 | <b>1.675.800,75</b>  | <b>3,52</b>                  |
| Deutschland   | 757.374,40           | 1,59                         |
| Irland  | 4.563,85             | 0,01                         |
| Luxemburg   | 913.862,50           | 1,92                         |
| <b>4. Sonstige Wertpapiere</b>                              | <b>144.709,17</b>    | <b>0,31</b>                  |
| Schweiz   | 144.709,17           | 0,31                         |
| <b>5. Derivate</b>  | <b>444.742,48</b>    | <b>0,92</b>                  |
| <b>6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>8.538.531,16</b>  | <b>17,99</b>                 |
| <b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>148.747,84</b>    | <b>0,32</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-1.345.505,16</b> | <b>-2,83</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>47.413.907,32</b> | <b>100,00</b>                |

| Gliederung nach Anlageart - Währung                         | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens *) |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                              |                      |                              |
| <b>1. Aktien</b>  | <b>26.068.005,87</b> | <b>55,01</b>                 |
| AUD   | 319.327,63           | 0,68                         |
| CAD   | 1.390.010,46         | 2,93                         |
| CHF   | 568.146,10           | 1,20                         |
| DKK   | 298.503,63           | 0,62                         |
| EUR   | 2.936.335,36         | 6,20                         |
| GBP   | 647.788,52           | 1,37                         |
| JPY   | 1.363.075,98         | 2,90                         |
| NOK   | 87.633,68            | 0,18                         |
| SEK   | 520.025,77           | 1,10                         |
| USD   | 17.937.158,74        | 37,83                        |
| <b>2. Anleihen</b>  | <b>11.738.875,21</b> | <b>24,76</b>                 |
| EUR   | 6.388.095,00         | 13,46                        |
| USD   | 5.350.780,21         | 11,30                        |
| <b>3. Investmentanteile</b>                                 | <b>1.675.800,75</b>  | <b>3,52</b>                  |
| EUR   | 1.675.386,40         | 3,52                         |
| USD   | 414,35               | 0,00                         |
| <b>4. Sonstige Wertpapiere</b>                              | <b>144.709,17</b>    | <b>0,31</b>                  |
| CHF   | 144.709,17           | 0,31                         |
| <b>5. Derivate</b>  | <b>444.742,48</b>    | <b>0,92</b>                  |
| <b>6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> | <b>8.538.531,16</b>  | <b>17,99</b>                 |
| <b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>                     | <b>148.747,84</b>    | <b>0,32</b>                  |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                | <b>-1.345.505,16</b> | <b>-2,83</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                   | <b>47.413.907,32</b> | <b>100,00</b>                |

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

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022.

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung                               | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs           | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|-------------------------------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|----------------|----------------------|-------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>32.364.256,51</b> | <b>68,30</b>            |
| <b>Aktien</b>                       |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>26.068.005,87</b> | <b>55,01</b>            |
| <b>EUR</b>                          |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>2.936.335,36</b>  | <b>6,20</b>             |
| IT0001233417                        | AZA S.p.A. Azioni nom.                            | STK   |                              | 48.806             | 0                                  | 0                 | EUR 1,234      | 60.226,60            | 0,13                    |
| NL0011794037                        | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder  | STK   |                              | 4.959              | 0                                  | 1.478             | EUR 24,650     | 122.239,35           | 0,26                    |
| DE0008404005                        | Allianz SE vink.Namens-Aktien                     | STK   |                              | 819                | 0                                  | 0                 | EUR 182,100    | 149.139,90           | 0,31                    |
| AT0000730007                        | Andritz AG Inhaber-Aktien                         | STK   |                              | 2.212              | 2.212                              | 0                 | EUR 38,360     | 84.852,32            | 0,18                    |
| NL0000334118                        | ASM International N.V. Reg.Shares                 | STK   |                              | 299                | 0                                  | 0                 | EUR 235,000    | 70.265,00            | 0,15                    |
| NL0010273215                        | ASML Holding N.V. Aandelen op naam                | STK   |                              | 286                | 89                                 | 0                 | EUR 451,350    | 129.086,10           | 0,27                    |
| FR0000120628                        | AXA S.A. Actions au Porteur                       | STK   |                              | 5.684              | 0                                  | 0                 | EUR 21,595     | 122.745,98           | 0,26                    |
| DE0005190037                        | Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien         | STK   |                              | 1.359              | 0                                  | 0                 | EUR 66,350     | 90.169,65            | 0,19                    |
| FR0000131104                        | BNP Paribas S.A. Actions Port.                    | STK   |                              | 2.564              | 0                                  | 537               | EUR 45,505     | 116.674,82           | 0,25                    |
| FR0000125338                        | Capgemini SE Actions Port.                        | STK   |                              | 571                | 0                                  | 0                 | EUR 166,150    | 94.871,65            | 0,20                    |
| NL0010545661                        | CNH Industrial N.V. Aandelen op naam              | STK   |                              | 5.203              | 5.203                              | 0                 | EUR 11,045     | 57.467,14            | 0,12                    |
| FR0000125007                        | Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur | STK   |                              | 1.351              | 1.351                              | 0                 | EUR 40,270     | 54.404,77            | 0,11                    |
| DE0005552004                        | Deutsche Post AG Namens-Aktien                    | STK   |                              | 2.846              | 0                                  | 0                 | EUR 35,430     | 100.833,78           | 0,21                    |
| FR0000130452                        | Eiffage S.A. Actions Port.                        | STK   |                              | 924                | 0                                  | 0                 | EUR 85,640     | 79.131,36            | 0,17                    |
| FR0014008VX5                        | EuroAPI SAS Actions Nom.                          | STK   |                              | 82                 | 83                                 | 1                 | EUR 15,428     | 1.265,10             | 0,00                    |
| DE0005785604                        | Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien       | STK   |                              | 3.011              | 0                                  | 0                 | EUR 28,710     | 86.445,81            | 0,18                    |
| DE0006231004                        | Infineon Technologies AG Namens-Aktien            | STK   |                              | 2.095              | 2.095                              | 0                 | EUR 23,085     | 48.363,08            | 0,10                    |
| FR0010259150                        | Ipsen S.A. Actions au Porteur                     | STK   |                              | 680                | 0                                  | 0                 | EUR 89,350     | 60.758,00            | 0,13                    |
| IT0005211237                        | Italgas S.P.A. Azioni nom.                        | STK   |                              | 10.896             | 0                                  | 0                 | EUR 5,605      | 61.072,08            | 0,13                    |
| FI0009000202                        | Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B                         | STK   |                              | 3.499              | 0                                  | 0                 | EUR 21,920     | 76.698,08            | 0,16                    |
| DE000LEG1110                        | LEG Immobilien SE Namens-Aktien                   | STK   |                              | 963                | 0                                  | 0                 | EUR 80,120     | 77.155,56            | 0,16                    |
| IT0000062957                        | Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.        | STK   |                              | 12.291             | 0                                  | 0                 | EUR 8,312      | 102.162,79           | 0,22                    |
| DE0007100000                        | Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien              | STK   |                              | 1.837              | 0                                  | 495               | EUR 55,230     | 101.457,51           | 0,21                    |
| DE0006599905                        | Merck KGaA Inhaber-Aktien                         | STK   |                              | 708                | 0                                  | 177               | EUR 158,500    | 112.218,00           | 0,24                    |
| FI0009000681                        | Nokia Oyj Reg.Shares <sup>1)</sup>                | STK   |                              | 14.389             | 14.389                             | 0                 | EUR 4,455      | 64.103,00            | 0,14                    |
| FR0000130577                        | Publicis Groupe S.A. Actions Port.                | STK   |                              | 2.305              | 2.305                              | 0                 | EUR 46,090     | 106.237,45           | 0,22                    |
| NL0000379121                        | Randstad N.V. Aandelen aan toonder                | STK   |                              | 2.773              | 0                                  | 0                 | EUR 45,670     | 126.642,91           | 0,27                    |
| ES0173093024                        | Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.     | STK   |                              | 4.882              | 0                                  | 0                 | EUR 18,160     | 88.657,12            | 0,19                    |
| FR0000120578                        | Sanofi S.A. Actions Port.                         | STK   |                              | 1.904              | 0                                  | 0                 | EUR 98,200     | 186.972,80           | 0,39                    |
| NL00150001Q9                        | Stellantis N.V Aandelen op naam                   | STK   |                              | 3.701              | 0                                  | 6.806             | EUR 11,802     | 43.679,20            | 0,09                    |
| DE0008303504                        | TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien                  | STK   |                              | 4.143              | 0                                  | 0                 | EUR 11,830     | 45.697,29            | 0,10                    |
| BE0003826436                        | Telenet Group Holding N.V. Actions Nom.           | STK   |                              | 1.366              | 0                                  | 0                 | EUR 19,080     | 27.156,08            | 0,06                    |
| FR0000127771                        | Vivendi SE Actions Porteur                        | STK   |                              | 4.913              | 4.913                              | 0                 | EUR 9,660      | 47.459,58            | 0,10                    |
| NL0000395903                        | Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam              | STK   |                              | 1.525              | 0                                  | 448               | EUR 91,820     | 140.025,50           | 0,30                    |
| <b>AUD</b>                          |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>319.327,63</b>    | <b>0,68</b>             |
| AU000000AZJ1                        | Aurizon Holdings Ltd. Reg.Shares                  | STK   |                              | 24.722             | 0                                  | 0                 | AUD 3,800      | 61.892,95            | 0,13                    |
| AU000000ANZ3                        | Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Reg.Shares         | STK   |                              | 3.503              | 0                                  | 0                 | AUD 22,030     | 50.842,70            | 0,11                    |
| AU000000BSL0                        | Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares                   | STK   |                              | 8.480              | 3.659                              | 0                 | AUD 15,900     | 88.831,50            | 0,19                    |
| AU000000FMG4                        | Fortescue Metals Group Ltd. Reg.Shares            | STK   |                              | 2.966              | 0                                  | 4.267             | AUD 17,530     | 34.255,24            | 0,07                    |
| AU000000MGR9                        | Mirvac Group Reg.Stapled Units                    | STK   |                              | 64.176             | 0                                  | 0                 | AUD 1,975      | 83.505,24            | 0,18                    |
| <b>CAD</b>                          |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>1.390.010,46</b>  | <b>2,93</b>             |
| CA12532H1047                        | CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)                   | STK   |                              | 2.100              | 0                                  | 0                 | CAD 102,410    | 159.504,12           | 0,34                    |
| CA21037X1006                        | Constellation Software Inc. Reg.Shares            | STK   |                              | 100                | 0                                  | 0                 | CAD 1.919,800  | 142.385,65           | 0,30                    |
| CA3759161035                        | Gildan Activewear Inc. Reg.Shares (Sub.Vtg)       | STK   |                              | 2.900              | 2.900                              | 0                 | CAD 36,990     | 79.559,60            | 0,17                    |
| CA39138C1068                        | Great-West Lifeco Inc. Reg.Shares                 | STK   |                              | 3.600              | 0                                  | 0                 | CAD 31,390     | 83.811,59            | 0,18                    |
| CA5394811015                        | Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares                  | STK   |                              | 1.600              | 0                                  | 600               | CAD 116,590    | 138.353,94           | 0,29                    |
| CA56501R1064                        | Manulife Financial Corp. Reg.Shares               | STK   |                              | 5.000              | 0                                  | 0                 | CAD 22,310     | 82.733,20            | 0,17                    |
| CA6837151068                        | Open Text Corp. Reg.Shares                        | STK   |                              | 1.800              | 1.800                              | 0                 | CAD 49,160     | 65.628,82            | 0,14                    |
| CA7481932084                        | Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)           | STK   |                              | 6.500              | 0                                  | 0                 | CAD 28,070     | 135.321,25           | 0,29                    |
| CA7751092007                        | Rogers Communications Inc. Reg.Shares Cl.B        | STK   |                              | 2.200              | 0                                  | 0                 | CAD 61,760     | 100.772,08           | 0,21                    |
| CA8667961053                        | Sun Life Financial Inc. Reg.Shares                | STK   |                              | 1.800              | 0                                  | 0                 | CAD 59,280     | 79.139,07            | 0,17                    |
| CA0641491075                        | The Bank of Nova Scotia Reg.Shares                | STK   |                              | 2.100              | 0                                  | 0                 | CAD 76,980     | 119.896,76           | 0,25                    |
| CA8911605092                        | The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares              | STK   |                              | 1.000              | 1.000                              | 0                 | CAD 84,890     | 62.960,30            | 0,13                    |
| CA8911021050                        | Toromont Industries Ltd. Reg.Shares               | STK   |                              | 700                | 700                                | 0                 | CAD 103,080    | 53.515,88            | 0,11                    |
| CA9528451052                        | West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares            | STK   |                              | 1.200              | 1.200                              | 0                 | CAD 97,110     | 86.428,20            | 0,18                    |
| <b>CHF</b>                          |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>568.146,10</b>    | <b>1,20</b>             |
| CH0030170408                        | Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.)               | STK   |                              | 194                | 0                                  | 0                 | CHF 453,700    | 88.223,36            | 0,19                    |
| CH0038863350                        | Nestlé S.A. Namens-Aktien                         | STK   |                              | 950                | 0                                  | 0                 | CHF 110,780    | 105.486,78           | 0,22                    |
| CH0012005267                        | Novartis AG Namens-Aktien                         | STK   |                              | 1.697              | 1.697                              | 0                 | CHF 80,990     | 137.761,01           | 0,29                    |
| CH0244767585                        | UBS Group AG Namens-Aktien                        | STK   |                              | 9.038              | 0                                  | 0                 | CHF 15,250     | 138.151,39           | 0,29                    |
| CH0011075394                        | Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien             | STK   |                              | 238                | 0                                  | 0                 | CHF 413,000    | 98.523,56            | 0,21                    |
| <b>DKK</b>                          |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>298.503,63</b>    | <b>0,62</b>             |
| DK0010244508                        | A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B               | STK   |                              | 41                 | 0                                  | 0                 | DKK 16.775,000 | 92.447,85            | 0,19                    |
| DK0010181759                        | Carlsberg AS Navne-Aktier B                       | STK   |                              | 807                | 0                                  | 0                 | DKK 893,800    | 96.953,68            | 0,20                    |
| DK0060534915                        | Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B                    | STK   |                              | 1.048              | 1.048                              | 0                 | DKK 774,500    | 109.102,10           | 0,23                    |
| <b>GBP</b>                          |   |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>647.788,52</b>    | <b>1,37</b>             |
| GB0000811801                        | Barratt Developments PLC Reg.Shares               | STK   |                              | 14.162             | 6.474                              | 0                 | GBP 4,536      | 74.625,16            | 0,16                    |
| GB0031743007                        | Burberry Group PLC Reg.Shares                     | STK   |                              | 3.184              | 0                                  | 0                 | GBP 16,170     | 59.809,58            | 0,13                    |

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| ISIN         | Gattungsbezeichnung                                | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs           | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|--------------|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|----------------|----------------------|-------------------------|
| GB00BY9D0Y18 | Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares           |       | STK                          | 32.570             | 0                                  | 0                 | GBP 2,520      | 95.346,76            | 0,20                    |
| JE00BJVNS543 | Ferguson PLC Reg.Shares                            |       | STK                          | 1.054              | 0                                  | 0                 | GBP 90,100     | 110.319,70           | 0,23                    |
| GB0009252882 | GSK PLC Reg.Shares                                 |       | STK                          | 5.874              | 5.874                              | 0                 | GBP 17,722     | 120.930,08           | 0,26                    |
| GB0005576813 | Howden Joinery Group PLC Reg.Shares                |       | STK                          | 12.498             | 12.498                             | 0                 | GBP 5,914      | 85.863,68            | 0,18                    |
| GB0033195214 | Kingfisher PLC Reg.Shares                          |       | STK                          | 15.873             | 0                                  | 0                 | GBP 2,361      | 43.535,41            | 0,09                    |
| GB0002405495 | Schroders PLC Reg.Shares                           |       | STK                          | 1.859              | 0                                  | 0                 | GBP 26,560     | 57.358,15            | 0,12                    |
| <b>JPY</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>1.363.075,98</b>  | <b>2,90</b>             |
| JP3112000009 | AGC Inc. Reg.Shares                                |       | STK                          | 1.500              | 1.500                              | 0                 | JPY 4.770,000  | 50.305,84            | 0,11                    |
| JP3942400007 | Astellas Pharma Inc. Reg.Shares                    |       | STK                          | 6.000              | 6.000                              | 0                 | JPY 2.115,000  | 89.221,68            | 0,19                    |
| JP3486800000 | Daito Trust Constr. Co. Ltd. Reg.Shares            |       | STK                          | 700                | 0                                  | 400               | JPY 11.710,000 | 57.632,00            | 0,12                    |
| JP3505000004 | Daiwa House Industry Co. Ltd. Reg.Shares           |       | STK                          | 1.900              | 0                                  | 0                 | JPY 3.162,000  | 42.240,03            | 0,09                    |
| JP3138400001 | Izumi Co. Ltd. Reg.Shares                          |       | STK                          | 1.900              | 0                                  | 0                 | JPY 3.055,000  | 40.810,66            | 0,09                    |
| JP3210200006 | Kajima Corp. Reg.Shares                            |       | STK                          | 8.200              | 0                                  | 3.900             | JPY 1.557,000  | 89.765,87            | 0,19                    |
| JP3219000001 | Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares                       |       | STK                          | 7.700              | 0                                  | 0                 | JPY 2.624,000  | 142.057,23           | 0,30                    |
| JP3918000005 | Meiji Holdings Co.Ltd. Reg.Shares                  |       | STK                          | 1.000              | 0                                  | 0                 | JPY 6.660,000  | 46.825,56            | 0,10                    |
| JP3735400008 | Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares              |       | STK                          | 5.800              | 0                                  | 1.600             | JPY 3.896,000  | 158.875,06           | 0,34                    |
| JP3200450009 | ORIX Corp. Reg.Shares                              |       | STK                          | 8.800              | 0                                  | 3.200             | JPY 2.276,000  | 140.819,80           | 0,30                    |
| JP3326000001 | Sankyu Inc. Reg.Shares                             |       | STK                          | 2.600              | 0                                  | 0                 | JPY 3.900,000  | 71.292,98            | 0,15                    |
| JP3165000005 | Sompo Holdings Inc. Reg.Shares                     |       | STK                          | 2.100              | 0                                  | 0                 | JPY 5.983,000  | 88.337,90            | 0,19                    |
| JP3910660004 | Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares              |       | STK                          | 1.600              | 0                                  | 1.300             | JPY 7.903,000  | 88.903,89            | 0,19                    |
| JP3595200001 | Tosoh Corp. Reg.Shares                             |       | STK                          | 7.500              | 7.500                              | 0                 | JPY 1.685,000  | 88.852,56            | 0,19                    |
| JP3613000003 | Toyo Suisan Kaisha Ltd. Reg.Shares                 |       | STK                          | 1.800              | 1.800                              | 0                 | JPY 5.290,000  | 66.947,90            | 0,14                    |
| JP3939000000 | Yamada Holdings Co. Ltd. Ltd. Reg.Shares           |       | STK                          | 29.200             | 0                                  | 0                 | JPY 488,000    | 100.187,02           | 0,21                    |
| <b>NOK</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>87.633,68</b>     | <b>0,18</b>             |
| NO0010582521 | Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer             |       | STK                          | 4.634              | 0                                  | 0                 | NOK 195,800    | 87.633,68            | 0,18                    |
| <b>SEK</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>520.025,77</b>    | <b>1,10</b>             |
| SE0017486897 | Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria)                 |       | STK                          | 12.860             | 12.860                             | 0                 | SEK 84,870     | 102.110,95           | 0,22                    |
| SE0001662230 | Husqvarna AB Namn-Aktier B <sup>1</sup> )          |       | STK                          | 9.556              | 0                                  | 0                 | SEK 75,340     | 67.356,41            | 0,14                    |
| SE0000190126 | Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria)             |       | STK                          | 150                | 0                                  | 0                 | SEK 231,900    | 3.254,39             | 0,01                    |
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp Reg.Shares                         |       | STK                          | 6.117              | 6.117                              | 0                 | SEK 90,540     | 51.815,07            | 0,11                    |
| SE0000148884 | Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) |       | STK                          | 4.544              | 0                                  | 0                 | SEK 101,250    | 43.043,79            | 0,09                    |
| SE0007100599 | Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A             |       | STK                          | 9.772              | 0                                  | 0                 | SEK 88,460     | 80.873,74            | 0,17                    |
| SE0000108656 | Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Akt. B (fria)  |       | STK                          | 8.404              | 0                                  | 0                 | SEK 77,310     | 60.785,34            | 0,13                    |
| SE0000114837 | Trelleborg AB Namn-Aktier B (fria)                 |       | STK                          | 5.782              | 0                                  | 0                 | SEK 204,800    | 110.786,08           | 0,23                    |
| <b>USD</b>   |  |       |                              |                    |                                    |                   |                | <b>17.937.158,74</b> | <b>37,83</b>            |
| US0028241000 | Abbott Laboratories Reg.Shares                     |       | STK                          | 1.942              | 0                                  | 331               | USD 109,100    | 202.874,71           | 0,43                    |
| US00287Y1091 | AbbVie Inc. Reg.Shares                             |       | STK                          | 1.316              | 660                                | 0                 | USD 154,140    | 194.233,96           | 0,41                    |
| IE00B4BNMY34 | Accenture PLC Reg.Shares Cl.A                      |       | STK                          | 598                | 0                                  | 0                 | USD 279,810    | 160.220,60           | 0,34                    |
| US00507V1098 | Activision Blizzard Inc. Reg.Shares                |       | STK                          | 1.522              | 0                                  | 0                 | USD 77,960     | 113.616,24           | 0,24                    |
| US00724F1012 | Adobe Inc. Reg.Shares                              |       | STK                          | 332                | 0                                  | 185               | USD 368,500    | 117.146,55           | 0,25                    |
| US0079031078 | Advanced Micro Devices Inc. Reg.Shares             |       | STK                          | 1.141              | 0                                  | 0                 | USD 77,990     | 85.207,63            | 0,18                    |
| US0010551028 | AFLAC Inc. Reg.Shares                              |       | STK                          | 2.200              | 0                                  | 0                 | USD 55,460     | 116.830,56           | 0,25                    |
| US00971T1016 | Akamai Technologies Inc. Reg.Shares                |       | STK                          | 1.597              | 0                                  | 0                 | USD 92,130     | 140.883,43           | 0,30                    |
| IE00BFR3W74  | Allegion PLC Reg.Shares                            |       | STK                          | 1.020              | 0                                  | 0                 | USD 98,390     | 96.095,94            | 0,20                    |
| US02005N1000 | Ally Financial Inc. Reg.Shares                     |       | STK                          | 1.844              | 1.844                              | 0                 | USD 34,080     | 60.174,77            | 0,13                    |
| US02079K1079 | Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C              |       | STK                          | 217                | 60                                 | 32                | USD 2.245,130  | 466.503,77           | 0,97                    |
| US02079K3059 | Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A                      |       | STK                          | 150                | 0                                  | 28                | USD 2.234,030  | 320.873,75           | 0,68                    |
| US0231351067 | Amazon.com Inc. Reg.Shares                         |       | STK                          | 3.920              | 3.724                              | 26                | USD 108,920    | 408.834,59           | 0,86                    |
| US0311621009 | Amgen Inc. Reg.Shares                              |       | STK                          | 858                | 0                                  | 213               | USD 245,430    | 201.636,37           | 0,43                    |
| US0378331005 | Apple Inc. Reg.Shares                              |       | STK                          | 7.861              | 496                                | 4.263             | USD 139,230    | 1.048.007,88         | 2,20                    |
| US0382221051 | Applied Materials Inc. Reg.Shares                  |       | STK                          | 1.025              | 0                                  | 577               | USD 91,940     | 90.236,51            | 0,19                    |
| US0427351004 | Arrow Electronics Inc. Reg.Shares                  |       | STK                          | 811                | 0                                  | 734               | USD 110,400    | 85.732,18            | 0,18                    |
| US00206R1023 | AT & T Inc. Reg.Shares                             |       | STK                          | 7.739              | 0                                  | 1.998             | USD 20,950     | 155.246,85           | 0,33                    |
| US0533321024 | AutoZone Inc. Reg.Shares                           |       | STK                          | 76                 | 0                                  | 16                | USD 2.140,000  | 155.733,23           | 0,33                    |
| US0605051046 | Bank of America Corp. Reg.Shares                   |       | STK                          | 3.456              | 0                                  | 1.070             | USD 31,860     | 105.432,24           | 0,22                    |
| US0758871091 | Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares                 |       | STK                          | 948                | 182                                | 0                 | USD 249,340    | 226.336,30           | 0,48                    |
| US0865161014 | Best Buy Co. Inc. Reg.Shares                       |       | STK                          | 1.964              | 855                                | 0                 | USD 67,150     | 126.281,99           | 0,27                    |
| US09247X1019 | Blackrock Inc. Reg.Shares                          |       | STK                          | 103                | 0                                  | 0                 | USD 617,960    | 60.946,89            | 0,13                    |
| US0936711052 | Block H. & R. Inc. Reg.Shares                      |       | STK                          | 1.733              | 0                                  | 0                 | USD 34,580     | 57.382,24            | 0,12                    |
| US1101221083 | Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares                |       | STK                          | 3.368              | 0                                  | 765               | USD 78,280     | 252.450,85           | 0,53                    |
| US11135F1012 | Broadcom Inc. Reg.Shares                           |       | STK                          | 266                | 266                                | 0                 | USD 490,410    | 124.909,33           | 0,26                    |
| US1273871087 | Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares             |       | STK                          | 819                | 0                                  | 630               | USD 150,920    | 118.354,46           | 0,25                    |
| US12503M1080 | Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares                |       | STK                          | 625                | 0                                  | 0                 | USD 113,840    | 68.128,50            | 0,14                    |
| US12504L1098 | CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A                    |       | STK                          | 869                | 869                                | 0                 | USD 73,680     | 61.308,87            | 0,13                    |
| IL0010824113 | Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares          |       | STK                          | 1.134              | 672                                | 644               | USD 121,210    | 131.615,01           | 0,28                    |
| US1255231003 | Cigna Corp. Reg.Shares                             |       | STK                          | 500                | 0                                  | 497               | USD 267,340    | 127.993,49           | 0,27                    |
| US17275R1023 | Cisco Systems Inc. Reg.Shares                      |       | STK                          | 4.297              | 1.377                              | 2.549             | USD 42,880     | 176.430,66           | 0,37                    |
| US1924461023 | Cognizant Technology Sol. Corp. Reg.Shs Cl.A       |       | STK                          | 2.104              | 2.104                              | 0                 | USD 68,480     | 137.963,25           | 0,29                    |
| US1941621039 | Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares                   |       | STK                          | 999                | 0                                  | 1.214             | USD 79,670     | 76.210,40            | 0,16                    |
| US20030N1019 | Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A                      |       | STK                          | 4.941              | 2.057                              | 1.094             | USD 39,330     | 186.077,01           | 0,39                    |
| US2058871029 | ConAgra Brands Inc. Reg.Shares                     |       | STK                          | 4.764              | 0                                  | 0                 | USD 34,330     | 156.602,79           | 0,33                    |
| US2283681060 | Crown Holdings Inc. Reg.Shares                     |       | STK                          | 656                | 656                                | 0                 | USD 93,240     | 58.567,95            | 0,12                    |
| US2358511028 | Danaher Corp. Reg.Shares                           |       | STK                          | 280                | 0                                  | 0                 | USD 252,860    | 67.794,13            | 0,14                    |



# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| ISIN         | Gattungsbezeichnung                                     | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs          | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|--------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------------|-----------------|-------------------------|
| US2371941053 | Darden Restaurants Inc. Reg.Shares                      | STK   |                              | 978                | 0                                  | 0                 | USD 113,870   | 106.635,57      | 0,22                    |
| US23918K1088 | DaVita Inc. Reg.Shares                                  | STK   |                              | 1.459              | 0                                  | 0                 | USD 81,460    | 113.802,98      | 0,24                    |
| US2441991054 | Deere & Co. Reg.Shares                                  | STK   |                              | 509                | 0                                  | 119               | USD 300,650   | 146.532,15      | 0,31                    |
| US2547091080 | Discover Financial Services Reg.Shares                  | STK   |                              | 723                | 723                                | 0                 | USD 95,590    | 66.176,64       | 0,14                    |
| US25754A2015 | Dominos Pizza Inc. Reg.Shares                           | STK   |                              | 414                | 0                                  | 0                 | USD 389,040   | 154.222,78      | 0,33                    |
| US2605571031 | Dow Inc. Reg.Shares                                     | STK   |                              | 1.323              | 1.323                              | 0                 | USD 51,980    | 65.849,13       | 0,14                    |
| US26210C1045 | Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A                            | STK   |                              | 7.761              | 3.240                              | 0                 | USD 21,320    | 158.437,80      | 0,33                    |
| US23355L1061 | DXC Technology Co. Reg.Shares                           | STK   |                              | 4.675              | 0                                  | 0                 | USD 30,530    | 136.666,59      | 0,29                    |
| US28176E1082 | Edwards Lifesciences Corp. Reg.Shares                   | STK   |                              | 1.454              | 0                                  | 0                 | USD 96,030    | 133.698,11      | 0,28                    |
| US0367521038 | Elevance Health Inc. Reg.Shares                         | STK   |                              | 503                | 0                                  | 103               | USD 485,570   | 233.869,59      | 0,49                    |
| US3032501047 | Fair Isaac Corp. Reg.Shares                             | STK   |                              | 157                | 0                                  | 87                | USD 401,060   | 60.292,45       | 0,13                    |
| US3666511072 | Gartner Inc. Reg.Shares                                 | STK   |                              | 424                | 0                                  | 0                 | USD 240,140   | 97.495,44       | 0,21                    |
| US3755581036 | Gilead Sciences Inc. Reg.Shares                         | STK   |                              | 2.387              | 0                                  | 0                 | USD 62,480    | 142.806,30      | 0,30                    |
| US37940X1028 | Global Payments Inc. Reg.Shares                         | STK   |                              | 581                | 0                                  | 0                 | USD 112,770   | 62.736,98       | 0,13                    |
| US40412C1018 | HCA Healthcare Inc. Reg.Shares                          | STK   |                              | 672                | 0                                  | 0                 | USD 175,670   | 113.037,05      | 0,24                    |
| US8064071025 | Henry Schein Inc. Reg.Shares                            | STK   |                              | 1.812              | 0                                  | 0                 | USD 77,650    | 134.726,67      | 0,28                    |
| US42824C1099 | Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares               | STK   |                              | 7.765              | 7.765                              | 0                 | USD 13,360    | 99.334,90       | 0,21                    |
| US4364401012 | Hologic Inc. Reg.Shares                                 | STK   |                              | 2.460              | 0                                  | 0                 | USD 70,350    | 165.711,69      | 0,35                    |
| US40434L1052 | HP Inc. Reg.Shares                                      | STK   |                              | 4.715              | 0                                  | 933               | USD 33,610    | 151.741,42      | 0,32                    |
| US4448591028 | Humana Inc. Reg.Shares                                  | STK   |                              | 391                | 0                                  | 0                 | USD 468,330   | 175.340,67      | 0,37                    |
| US4581401001 | Intel Corp. Reg.Shares                                  | STK   |                              | 2.533              | 0                                  | 0                 | USD 37,290    | 90.444,36       | 0,19                    |
| US4606901001 | Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares               | STK   |                              | 2.281              | 2.281                              | 0                 | USD 27,440    | 59.932,63       | 0,13                    |
| US46266C1053 | IQVIA Holdings Inc. Reg.Shares                          | STK   |                              | 275                | 275                                | 0                 | USD 214,110   | 56.379,81       | 0,12                    |
| US8326964058 | J.M. Smucker Co. Reg.Shares                             | STK   |                              | 1.042              | 0                                  | 0                 | USD 130,700   | 130.405,90      | 0,28                    |
| US4262811015 | Jack Henry & Associates Inc. Reg.Shares                 | STK   |                              | 858                | 0                                  | 0                 | USD 182,120   | 149.623,17      | 0,32                    |
| US4781601046 | Johnson & Johnson Reg.Shares                            | STK   |                              | 2.307              | 768                                | 0                 | USD 176,990   | 390.976,14      | 0,82                    |
| US46625H1005 | JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares                         | STK   |                              | 1.603              | 0                                  | 363               | USD 115,300   | 176.976,97      | 0,37                    |
| US4878361082 | Kellogg Co. Reg.Shares                                  | STK   |                              | 1.953              | 0                                  | 0                 | USD 71,620    | 133.933,89      | 0,28                    |
| US49338L1035 | Keysight Technologies Inc. Reg.Shares                   | STK   |                              | 911                | 0                                  | 0                 | USD 138,680   | 120.972,36      | 0,26                    |
| US50540R4092 | Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares               | STK   |                              | 598                | 0                                  | 0                 | USD 240,000   | 137.425,19      | 0,29                    |
| US5260571048 | Lennar Corp. Reg.Shares Cl.A                            | STK   |                              | 1.262              | 0                                  | 304               | USD 69,640    | 84.153,47       | 0,18                    |
| US5261071071 | Lennox International Inc. Reg.Shares                    | STK   |                              | 438                | 0                                  | 0                 | USD 202,590   | 84.966,17       | 0,18                    |
| US5486611073 | Lowe's Companies Inc. Reg.Shares                        | STK   |                              | 908                | 0                                  | 291               | USD 176,100   | 153.108,44      | 0,32                    |
| US5717481023 | Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares                   | STK   |                              | 1.054              | 1.054                              | 0                 | USD 155,030   | 156.462,51      | 0,33                    |
| US5745991068 | Masco Corp. Reg.Shares                                  | STK   |                              | 2.273              | 0                                  | 0                 | USD 50,450    | 109.803,08      | 0,23                    |
| US57636Q1040 | Mastercard Inc. Reg.Shares A                            | STK   |                              | 245                | 0                                  | 0                 | USD 322,590   | 75.678,22       | 0,16                    |
| US5801351017 | McDonald's Corp. Reg.Shares                             | STK   |                              | 399                | 0                                  | 0                 | USD 247,740   | 94.650,51       | 0,20                    |
| US58155Q1031 | McKesson Corp. Reg.Shares                               | STK   |                              | 46                 | 0                                  | 414               | USD 328,060   | 14.449,91       | 0,03                    |
| US58933Y1055 | Merck & Co. Inc. Reg.Shares                             | STK   |                              | 2.912              | 0                                  | 755               | USD 92,510    | 257.949,08      | 0,54                    |
| US30303M1027 | Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A                     | STK   |                              | 828                | 0                                  | 229               | USD 163,940   | 129.977,80      | 0,27                    |
| US5926881054 | Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares                     | STK   |                              | 101                | 0                                  | 0                 | USD 1.146,020 | 110.832,59      | 0,23                    |
| US5950171042 | Microchip Technology Inc. Reg.Shares                    | STK   |                              | 1.508              | 1.508                              | 0                 | USD 58,050    | 83.821,90       | 0,18                    |
| US5951121038 | Micron Technology Inc. Reg.Shares                       | STK   |                              | 2.347              | 0                                  | 821               | USD 56,020    | 125.895,48      | 0,27                    |
| US5949181045 | Microsoft Corp. Reg.Shares                              | STK   |                              | 4.723              | 216                                | 554               | USD 260,260   | 1.177.007,69    | 2,47                    |
| US6174464486 | Morgan Stanley Reg.Shares                               | STK   |                              | 1.267              | 0                                  | 0                 | USD 78,190    | 94.859,70       | 0,20                    |
| US6687711084 | NortonLifeLock Inc. Reg.Shares                          | STK   |                              | 4.599              | 0                                  | 0                 | USD 22,300    | 98.202,42       | 0,21                    |
| US67066G1040 | NVIDIA Corp. Reg.Shares                                 | STK   |                              | 708                | 0                                  | 118               | USD 155,420   | 105.364,45      | 0,22                    |
| US62944T1051 | NVR Inc. Reg.Shares                                     | STK   |                              | 19                 | 19                                 | 0                 | USD 3.965,980 | 72.153,61       | 0,15                    |
| US6819191064 | Omnicom Group Inc. Reg.Shares                           | STK   |                              | 1.698              | 0                                  | 0                 | USD 63,320    | 102.951,46      | 0,22                    |
| US68389X1054 | Oracle Corp. Reg.Shares                                 | STK   |                              | 2.189              | 676                                | 0                 | USD 69,210    | 145.066,97      | 0,31                    |
| US6907421019 | Owens Corning (New) Reg.Shares                          | STK   |                              | 1.616              | 0                                  | 0                 | USD 75,360    | 116.610,10      | 0,25                    |
| US7010941042 | Parker-Hannifin Corp. Reg.Shares                        | STK   |                              | 491                | 0                                  | 104               | USD 247,330   | 116.281,93      | 0,25                    |
| US7458671010 | Pulte Group Inc. Reg.Shares                             | STK   |                              | 1.685              | 0                                  | 0                 | USD 39,590    | 63.876,24       | 0,13                    |
| US7475251036 | QUALCOMM Inc. Reg.Shares                                | STK   |                              | 1.012              | 0                                  | 763               | USD 130,230   | 126.195,97      | 0,27                    |
| US74834L1008 | Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares                       | STK   |                              | 1.328              | 0                                  | 0                 | USD 137,610   | 174.985,47      | 0,37                    |
| US75886F1075 | Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares               | STK   |                              | 208                | 208                                | 0                 | USD 597,620   | 119.026,15      | 0,25                    |
| US7703231032 | Robert Half International Inc. Reg.Shares               | STK   |                              | 826                | 826                                | 0                 | USD 75,520    | 59.730,47       | 0,13                    |
| US78409V1044 | S&P Global Inc. Reg.Shares                              | STK   |                              | 233                | 0                                  | 0                 | USD 334,750   | 74.684,49       | 0,16                    |
| IE00BKVD2N49 | Seagate Technolog.Holdings PLC Reg.Shares               | STK   |                              | 1.332              | 0                                  | 900               | USD 71,480    | 91.168,06       | 0,19                    |
| US81211K1007 | Sealed Air Corp. Reg.Shares                             | STK   |                              | 2.579              | 0                                  | 0                 | USD 58,410    | 144.242,25      | 0,30                    |
| US82968B1035 | Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares                      | STK   |                              | 21.160             | 21.160                             | 0                 | USD 6,110     | 123.797,19      | 0,26                    |
| US8330341012 | Snap-on Inc. Reg.Shares                                 | STK   |                              | 537                | 0                                  | 0                 | USD 198,870   | 102.258,05      | 0,22                    |
| US78467J1007 | SS&C Technologies Holdings Reg.Shares                   | STK   |                              | 1.264              | 543                                | 771               | USD 58,650    | 70.985,40       | 0,15                    |
| US8716071076 | Synopsys Inc. Reg.Shares                                | STK   |                              | 515                | 0                                  | 0                 | USD 306,060   | 150.927,28      | 0,32                    |
| US74144T1088 | T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares                     | STK   |                              | 628                | 0                                  | 0                 | USD 115,500   | 69.453,73       | 0,15                    |
| US8740541094 | Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares <sup>1)</sup> | STK   |                              | 726                | 0                                  | 0                 | USD 125,530   | 87.264,60       | 0,18                    |
| US88160R1014 | Tesla Inc. Reg.Shares                                   | STK   |                              | 76                 | 0                                  | 0                 | USD 685,470   | 49.883,39       | 0,11                    |
| US8825081040 | Texas Instruments Inc. Reg.Shares                       | STK   |                              | 628                | 0                                  | 0                 | USD 152,780   | 91.871,35       | 0,19                    |
| US0200021014 | The Allstate Corp. Reg.Shares                           | STK   |                              | 1.270              | 0                                  | 428               | USD 125,420   | 152.519,17      | 0,32                    |
| US38141G1040 | The Goldman Sachs Group Inc. Reg.Shares                 | STK   |                              | 308                | 0                                  | 87                | USD 303,280   | 89.443,42       | 0,19                    |
| US4370761029 | The Home Depot Inc. Reg.Shares                          | STK   |                              | 408                | 0                                  | 0                 | USD 273,870   | 106.993,79      | 0,23                    |
| US5010441013 | The Kroger Co. Reg.Shares                               | STK   |                              | 2.275              | 0                                  | 1.942             | USD 48,110    | 104.802,27      | 0,22                    |
| US7427181091 | The Procter & Gamble Co. Reg.Shares                     | STK   |                              | 1.037              | 0                                  | 1.160             | USD 142,200   | 141.199,21      | 0,30                    |



# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| ISIN  | Gattungsbezeichnung   | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs        | Kurswert in EUR     | % des Fondsvermögens *) |
|---|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-------------|---------------------|-------------------------|
| US8835561023  | Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares                                |       | STK                          | 477                | 0                                  | 63                | USD 535,920 | 244.777,94          | 0,52                    |
| US9029733048  | U.S. Bancorp Reg.Shares   |       | STK                          | 2.370              | 0                                  | 767               | USD 46,120  | 104.662,61          | 0,22                    |
| US9026811052  | UGI Corp. Reg.Shares  |       | STK                          | 1.469              | 0                                  | 1.835             | USD 38,950  | 54.787,71           | 0,12                    |
| US9038453031  | Ulta Beauty Inc. Reg.Shares   |       | STK                          | 161                | 161                                | 0                 | USD 391,640 | 60.376,35           | 0,13                    |
| US9113121068  | United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B                              |       | STK                          | 860                | 0                                  | 286               | USD 181,130 | 149.156,70          | 0,31                    |
| US92343V1044  | Verizon Communications Inc. Reg.Shares                                  |       | STK                          | 4.087              | 0                                  | 1.304             | USD 50,940  | 199.350,58          | 0,42                    |
| US92532F1003  | Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares                                  |       | STK                          | 649                | 0                                  | 204               | USD 280,350 | 174.220,47          | 0,37                    |
| US92826C8394  | VISA Inc. Reg.Shares Cl.A   |       | STK                          | 793                | 382                                | 164               | USD 199,500 | 151.485,13          | 0,32                    |
| US9344231041  | Warner Bros. Discovery Inc. Reg.Shares S.A                              |       | STK                          | 1.872              | 1.872                              | 0                 | USD 13,170  | 23.607,26           | 0,05                    |
| US94106L1098  | Waste Management Inc. (Del.) Reg.Shares                                 |       | STK                          | 662                | 0                                  | 0                 | USD 151,250 | 95.875,42           | 0,20                    |
| US9418481035  | Waters Corp. Reg.Shares   |       | STK                          | 395                | 395                                | 0                 | USD 329,600 | 124.663,19          | 0,26                    |
| IE00BDB6Q211  | Willis Towers Watson PLC Reg.Shares                                     |       | STK                          | 501                | 501                                | 0                 | USD 199,870 | 95.882,48           | 0,20                    |
| US9884981013  | Yum! Brands, Inc. Reg.Shares  |       | STK                          | 1.578              | 0                                  | 0                 | USD 113,830 | 171.995,73          | 0,36                    |
| US9892071054  | Zebra Technologies Corp. Reg.Shares Cl.A                                |       | STK                          | 258                | 0                                  | 65                | USD 298,330 | 73.700,52           | 0,16                    |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>6.151.541,47</b> | <b>12,98</b>            |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>4.999.191,00</b> | <b>10,54</b>            |
| XS1346695437  | 2,1250 % alstria office REIT-AG Anl. 16/23 <sup>1)</sup>                | EUR   |                              | 300.000            | 0                                  | 0                 | % 99,448    | 298.342,50          | 0,63                    |
| XS2079713322  | 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26 <sup>1)</sup> | EUR   |                              | 300.000            | 0                                  | 0                 | % 90,078    | 270.234,00          | 0,57                    |
| XS2049584084  | 0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27 <sup>1)</sup>             | EUR   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 85,362    | 170.723,00          | 0,36                    |
| XS2196322155  | 0,1420 % Exxon Mobil Corp. Notes 20/24 Reg.S                            | EUR   |                              | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 97,017    | 194.034,00          | 0,41                    |
| DE000A135JM6  | 0,8750 % Freistaat Thüringen Landessch. S.2014/02 14/24                 | EUR   |                              | 1.000.000          | 0                                  | 0                 | % 99,020    | 990.200,00          | 2,08                    |
| XS2047479469  | 0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27 <sup>1)</sup>                 | EUR   |                              | 500.000            | 0                                  | 0                 | % 87,180    | 435.900,00          | 0,92                    |
| DE000NRW0FU3  | 1,2500 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1325 14/25               | EUR   |                              | 500.000            | 0                                  | 0                 | % 99,674    | 498.370,00          | 1,04                    |
| XS1963837197  | 1,9790 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Bonds 19/30                         | EUR   |                              | 400.000            | 400.000                            | 0                 | % 90,574    | 362.294,00          | 0,76                    |
| FR0013320249  | 1,8000 % Mercalys Bonds 18/26   | EUR   |                              | 300.000            | 0                                  | 0                 | % 89,645    | 268.935,00          | 0,57                    |
| XS2089229806  | 1,8750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. MTN 19/34                        | EUR   |                              | 300.000            | 300.000                            | 0                 | % 72,374    | 217.122,00          | 0,46                    |
| FR0013506532  | 1,7500 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 20/30 <sup>1)</sup>                   | EUR   |                              | 300.000            | 0                                  | 0                 | % 91,432    | 274.296,00          | 0,58                    |
| XS1520733301  | 1,0000 % Sampo OYJ MTN 16/23  | EUR   |                              | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 100,009   | 200.017,00          | 0,42                    |
| FR0011625433  | 2,5000 % Sanofi S.A. MTN 13/23  | EUR   |                              | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 101,573   | 203.146,00          | 0,43                    |
| XS2087643651  | 1,0000 % Stryker Corp. Notes 19/31                                      | EUR   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 79,655    | 159.310,00          | 0,34                    |
| XS1718480327  | 0,3750 % United Parcel Service Inc. Notes 17/23                         | EUR   |                              | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 98,515    | 197.030,00          | 0,42                    |
| XS2324836878  | 0,2500 % Wolters Kluwer N.V. Notes 21/28                                | EUR   |                              | 300.000            | 300.000                            | 0                 | % 86,413    | 259.237,50          | 0,55                    |
| <b>USD</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>1.152.350,47</b> | <b>2,44</b>             |
| US209111EU37  | 6,7500 % Cons. Edison Co. New York Inc. Debts S.2008B 08/38             | USD   |                              | 190.000            | 0                                  | 0                 | % 116,240   | 211.477,00          | 0,45                    |
| US406216AY74  | 7,4500 % Halliburton Co. Notes 09/39                                    | USD   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 116,551   | 223.202,95          | 0,47                    |
| US404119BU21  | 4,5000 % HCA Inc. Notes 16/27   | USD   |                              | 300.000            | 300.000                            | 0                 | % 96,665    | 277.679,90          | 0,59                    |
| US023551AJ38  | 7,3000 % Hess Corp. Notes 01/31   | USD   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 111,979   | 214.447,46          | 0,45                    |
| US617446HD43  | 7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32                                       | USD   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 117,773   | 225.543,16          | 0,48                    |
| <b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>144.709,17</b>   | <b>0,31</b>             |
| <b>CHF</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>144.709,17</b>   | <b>0,31</b>             |
| CH0012032048  | Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine                                   | STK   |                              | 454                | 0                                  | 0                 | CHF 318,000 | 144.709,17          | 0,31                    |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>5.422.109,44</b> | <b>11,43</b>            |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>5.422.109,44</b> | <b>11,43</b>            |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>1.388.904,00</b> | <b>2,92</b>             |
| BE6286963051  | 2,3750 % Barry Callebaut Services N.V. Notes 16/24                      | EUR   |                              | 400.000            | 400.000                            | 0                 | % 100,353   | 401.412,00          | 0,85                    |
| XS2369906644  | 0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33  | EUR   |                              | 400.000            | 400.000                            | 0                 | % 72,885    | 291.538,00          | 0,61                    |
| XS1789176846  | 1,7500 % Prologis Intl Funding II S.A. MTN 18/28                        | EUR   |                              | 400.000            | 400.000                            | 0                 | % 91,583    | 366.330,00          | 0,77                    |
| BE6327721237  | 1,5000 % VGP N.V. Bonds 21/29 <sup>1)</sup>                             | EUR   |                              | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 66,963    | 133.926,00          | 0,28                    |
| XS2054209320  | 0,4520 % Wintershall Dea Finance B.V. Notes 19/23 <sup>1)</sup>         | EUR   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 97,849    | 195.698,00          | 0,41                    |
| <b>USD</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>4.033.205,44</b> | <b>8,51</b>             |
| US00203QAE70  | 4,5000 % A.P.Moeller-Maersk A/S Notes 19/29 144A                        | USD   |                              | 800.000            | 0                                  | 0                 | % 98,198    | 752.222,91          | 1,58                    |
| US00287YAR09  | 4,5000 % AbbVie Inc. Notes 15/35  | USD   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 96,525    | 184.851,82          | 0,39                    |
| US00928QAU58  | 2,8500 % Aircaastle Ltd. Notes 21/28 144A                               | USD   |                              | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 80,922    | 154.971,03          | 0,33                    |
| US037833AT77  | 4,4500 % Apple Inc. Notes 14/44   | USD   |                              | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 100,140   | 191.774,79          | 0,40                    |
| US09261HAG20  | 2,3500 % Blackstone Private Credit Fund Notes 21/24 144A                | USD   |                              | 400.000            | 400.000                            | 0                 | % 91,856    | 351.820,75          | 0,74                    |

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| ISIN  | Gattungsbezeichnung   | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs        | Kurswert in EUR          | % des Fondsvermögens *) |
|---|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-------------|--------------------------|-------------------------|
| US11135FAL58  | 4,1100 % Broadcom Inc. Notes 20/28                          |       | USD                          | 300.000            | 300.000                            | 0                 | % 94,539    | 271.574,18               | 0,57                    |
| US22822VAR24  | 3,3000 % Crown Castle Internatl Corp. Notes 20/30           |       | USD                          | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 88,033    | 168.589,65               | 0,36                    |
| US126650DR85  | 2,1250 % CVS Health Corp. Notes 21/31                       |       | USD                          | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 80,856    | 154.844,64               | 0,33                    |
| US30212PAP09  | 3,8000 % Expedia Group Inc. Notes 17/28                     |       | USD                          | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 91,295    | 174.836,02               | 0,37                    |
| US30225VAG23  | 2,3500 % Extra Space Storage L.P. Notes 21/32               |       | USD                          | 500.000            | 500.000                            | 0                 | % 79,403    | 380.155,12               | 0,80                    |
| US33834DAA28  | 2,8500 % Five Corners Funding Trust II Notes 20/30 144A 3C7 |       | USD                          | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 85,598    | 163.925,89               | 0,35                    |
| US48203RAP91  | 2,0000 % Juniper Networks Inc. Notes 20/30                  |       | USD                          | 500.000            | 500.000                            | 0                 | % 78,273    | 374.745,06               | 0,79                    |
| US55336VAR15  | 4,0000 % MPLX L.P. Notes 18/28                              |       | USD                          | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 94,828    | 181.601,00               | 0,38                    |
| US682680AW38  | 4,3500 % Oneok Inc. (New) Notes 19/29                       |       | USD                          | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 93,595    | 179.240,68               | 0,38                    |
| US723787AQ06  | 1,9000 % Pioneer Natural Resources Co. Notes 20/30          |       | USD                          | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 81,322    | 155.737,06               | 0,33                    |
| US785592AS57  | 5,0000 % Sabine Pass Liquefaction LLC Notes 17/27           |       | USD                          | 200.000            | 0                                  | 0                 | % 100,422   | 192.314,84               | 0,41                    |
| <b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>165.224,30</b>        | <b>0,35</b>             |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>165.224,30</b>        | <b>0,35</b>             |
| <b>USD</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>165.224,30</b>        | <b>0,35</b>             |
| US55037AAB44  | 3,1000 % Lundin Energy Finance B.V. Notes 21/31 144A        |       | USD                          | 200.000            | 200.000                            | 0                 | % 86,276    | 165.224,30               | 0,35                    |
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>1.675.800,75</b>      | <b>3,52</b>             |
| <b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>757.374,40</b>        | <b>1,59</b>             |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>757.374,40</b>        | <b>1,59</b>             |
| DE0005424568  | Deka-Vega Plus I (A)  |       | ANT                          | 11.420             | 0                                  | 0                 | EUR 66,320  | 757.374,40               | 1,59                    |
| <b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>913.862,50</b>        | <b>1,92</b>             |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>913.862,50</b>        | <b>1,92</b>             |
| LU1685588219  | Deka-MultiFactor Global Corporates I                        |       | ANT                          | 1.880              | 0                                  | 0                 | EUR 83,780  | 157.506,40               | 0,33                    |
| LU1685587591  | Deka-MultiFactor Global Corporates HY I                     |       | ANT                          | 9.285              | 0                                  | 0                 | EUR 81,460  | 756.356,10               | 1,59                    |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>                                       |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>4.563,85</b>          | <b>0,01</b>             |
| <b>EUR</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>4.149,50</b>          | <b>0,01</b>             |
| IE00BKLC5874  | iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.              |       | ANT                          | 1.000              | 106.000                            | 264.000           | EUR 4,150   | 4.149,50                 | 0,01                    |
| <b>USD</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>414,35</b>            | <b>0,00</b>             |
| IE00BKCF09C98   | iShs II-€ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.              |       | ANT                          | 100                | 136.000                            | 386.900           | USD 4,327   | 414,35                   | 0,00                    |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 39.627.391,00</b> | <b>83,60</b>            |
| <b>Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                          |                         |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                          |                         |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                          |                         |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                          |                         |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>-28.552,46</b>        | <b>-0,07</b>            |
| DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 22  |   | XEUR  | EUR                          | Anzahl -44         |                                    |                   |             | 17.820,00                | 0,04                    |
| E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) Sep. 22   |   | XIOM  | USD                          | Anzahl 6           |                                    |                   |             | 41.894,00                | 0,09                    |
| E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) Sep. 22  |   | XCME  | USD                          | Anzahl 11          |                                    |                   |             | 2.872,83                 | 0,01                    |
| E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 22  |   | XCME  | USD                          | Anzahl -28         |                                    |                   |             | -91.370,56               | -0,19                   |
| ESTX Mid Index Future (FMCE) Sep. 22  |   | XEUR  | EUR                          | Anzahl 20          |                                    |                   |             | -7.190,00                | -0,02                   |
| FTSE 100 Index Future (FII) Sep. 22   |   | IFEU  | GBP                          | Anzahl 1           |                                    |                   |             | 261,38                   | 0,00                    |
| MDAX Mini Future (FSMX) Sep. 22   |   | XEUR  | EUR                          | Anzahl 16          |                                    |                   |             | -31.003,48               | -0,07                   |
| OMX Index Future (O30) Juli 22  |   | XNDX  | SEK                          | Anzahl -20         |                                    |                   |             | 10.740,36                | 0,02                    |
| OMXC25 Index Future (OMW) Juli 22   |   | XNDX  | DKK                          | Anzahl -8          |                                    |                   |             | -4.669,46                | -0,01                   |
| S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 22  |   | XMOD  | CAD                          | Anzahl -5          |                                    |                   |             | 19.930,09                | 0,04                    |
| Swiss Market Index Future (S30) Sep. 22   |   | XEUR  | CHF                          | Anzahl -1          |                                    |                   |             | 491,14                   | 0,00                    |
| Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 22                                      |   | XOSE  | JPY                          | Anzahl -2          |                                    |                   |             | 11.671,24                | 0,02                    |
| <b>Optionsrechte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>436.864,58</b>        | <b>0,92</b>             |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>436.864,58</b>        | <b>0,92</b>             |
| DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Call Aug. 22 3750  |   | XEUR  |                              | Anzahl 58          |                                    |                   | EUR 19,900  | 11.542,00                | 0,02                    |
| DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Aug. 22 3400   |   | XEUR  |                              | Anzahl 111         |                                    |                   | EUR 122,300 | 135.753,00               | 0,29                    |
| S & P 500 Index (S500) Call Aug. 22 4200  |   | XCBO  |                              | Anzahl 4           |                                    |                   | USD 15,830  | 6.063,10                 | 0,01                    |
| S & P 500 Index (S500) Put Aug. 22 3800   |   | XCBO  |                              | Anzahl 16          |                                    |                   | USD 135,000 | 206.827,21               | 0,44                    |
| S & P 500 Index (S500) Put Dez. 22 3300   |   | XCBO  |                              | Anzahl 8           |                                    |                   | USD 100,100 | 76.679,27                | 0,16                    |
| <b>Summe Aktienindex-Derivate</b>   |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>EUR 408.312,12</b>    | <b>0,85</b>             |
| <b>Zins-Derivate</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                          |                         |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             |                          |                         |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>  |   |       |                              |                    |                                    |                   |             | <b>86.060,74</b>         | <b>0,19</b>             |
| 10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 22   |   | XEUR  | EUR                          | 300.000            |                                    |                   |             | -10.545,00               | -0,02                   |
| EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 22   |   | XEUR  | EUR                          | -900.000           |                                    |                   |             | 12.420,00                | 0,03                    |
| EURO Bund Future (FGBL) Sep. 22   |   | XEUR  | EUR                          | -500.000           |                                    |                   |             | 19.350,00                | 0,04                    |
| EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 22   |   | XEUR  | EUR                          | -1.500.000         |                                    |                   |             | 4.375,00                 | 0,01                    |
| EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 22  |   | XEUR  | EUR                          | 300.000            |                                    |                   |             | -5.970,00                | -0,01                   |
| Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 22  |   | XCBT  | USD                          | -900.000           |                                    |                   |             | 14.931,54                | 0,03                    |
| Long Gilt Future (FLG) Sep. 22  |   | IFEU  | GBP                          | 500.000            |                                    |                   |             | -29.913,34               | -0,06                   |

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| ISIN | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens *) |
|------|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------|----------------------|-------------------------|
|      | Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep.22                            | XEUR  | EUR                          | 500.000            |                                    |                   |            | -18.530,00           | -0,4                    |
|      | Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 22                      | XCBT  | USD                          | -3.700.000         |                                    |                   |            | 103.518,33           | 0,22                    |
|      | Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 22                      | XCBT  | USD                          | 400.000            |                                    |                   |            | -3.575,79            | -0,01                   |
|      | <b>Summe Zins-Derivate</b>   |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>86.060,74</b>     | <b>0,19</b>             |
|      | <b>Devisen-Derivate</b>  |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | Forderungen/ Verbindlichkeiten                                     |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | <b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>                            |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>-210.858,19</b>   | <b>-0,46</b>            |
|      | <b>Offene Positionen</b>   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | AUD/EUR 200.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 2.283,04             | 0,00                    |
|      | CAD/EUR 1.300.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 1.707,21             | 0,00                    |
|      | CHF/EUR 320.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -14.953,98           | -0,03                   |
|      | DKK/EUR 1.600.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 3,39                 | 0,00                    |
|      | JPY/EUR 60.000.000,00  |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -3.536,87            | -0,01                   |
|      | NOK/EUR 2.200.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 4.214,11             | 0,01                    |
|      | SEK/EUR 6.000.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | 10.624,94            | 0,02                    |
|      | USD/EUR 8.600.000,00   |       | OTC                          |                    |                                    |                   |            | -211.200,03          | -0,45                   |
|      | <b>Summe Devisen-Derivate</b>                                      |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>-210.858,19</b>   | <b>-0,46</b>            |
|      | <b>Swaps</b>   |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | Forderungen/ Verbindlichkeiten                                     |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | <b>Inflation Swaps (IFS)</b>                                       |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | <b>Protection Seller</b>   |       |                              |                    |                                    |                   |            | <b>161.227,81</b>    | <b>0,34</b>             |
|      | IFS Euro HICP Ex-Tobacco EUR / 1,6125% EUR / BNP_PAR 03.08.2028    |       | OTC                          | STK                | 1.300.000                          |                   |            | 161.227,81           | 0,34                    |
|      | <b>Summe Swaps</b>   |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>161.227,81</b>    | <b>0,34</b>             |
|      | <b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>           |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | <b>Bankguthaben</b>  |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | <b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>                          |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | EUR                          |                    | 5.565.333,37                       |                   | % 100,000  | 5.565.333,37         | 11,73                   |
|      | <b>EUR-Guthaben bei</b>  |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | Landesbank Baden-Württemberg                                       |       | EUR                          |                    | 2.345,33                           |                   | % 100,000  | 2.345,33             | 0,00                    |
|      | Landesbank Saar  |       | EUR                          |                    | 3.631,71                           |                   | % 100,000  | 3.631,71             | 0,01                    |
|      | Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-                             |       | EUR                          |                    | 5.209,78                           |                   | % 100,000  | 5.209,78             | 0,01                    |
|      | <b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>                      |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | DKK                          |                    | 296.586,67                         |                   | % 100,000  | 39.865,94            | 0,08                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | NOK                          |                    | 1.467.396,77                       |                   | % 100,000  | 141.726,12           | 0,30                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | SEK                          |                    | 2.275.511,86                       |                   | % 100,000  | 212.890,48           | 0,45                    |
|      | <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                          |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | AUD                          |                    | 155.052,30                         |                   | % 100,000  | 102.153,26           | 0,22                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | CAD                          |                    | 223.106,97                         |                   | % 100,000  | 165.471,57           | 0,35                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | CHF                          |                    | 110.425,23                         |                   | % 100,000  | 110.683,12           | 0,23                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | GBP                          |                    | 72.012,91                          |                   | % 100,000  | 83.656,18            | 0,18                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | HKD                          |                    | 41.809,88                          |                   | % 100,000  | 5.102,62             | 0,01                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | JPY                          |                    | 43.102.010,00                      |                   | % 100,000  | 303.044,44           | 0,64                    |
|      | DekaBank Deutsche Girozentrale                                     |       | USD                          |                    | 1.877.132,69                       |                   | % 100,000  | 1.797.417,24         | 3,78                    |
|      | <b>Summe Bankguthaben</b>  |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>8.538.531,16</b>  | <b>17,99</b>            |
|      | <b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b> |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>8.538.531,16</b>  | <b>17,99</b>            |
|      | <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                               |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | Zinsansprüche  |       | EUR                          |                    | 88.133,61                          |                   |            | 88.133,61            | 0,19                    |
|      | Dividendenansprüche  |       | EUR                          |                    | 23.715,83                          |                   |            | 23.715,83            | 0,05                    |
|      | Forderungen aus Wertpapier-Darlehen                                |       | EUR                          |                    | 225,72                             |                   |            | 225,72               | 0,00                    |
|      | Forderungen aus Anteilschneingeschäften                            |       | EUR                          |                    | 198,52                             |                   |            | 198,52               | 0,00                    |
|      | Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung                        |       | EUR                          |                    | 26.474,16                          |                   |            | 26.474,16            | 0,06                    |
|      | Forderungen aus Cash Collateral                                    |       | EUR                          |                    | 10.000,00                          |                   |            | 10.000,00            | 0,02                    |
|      | <b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>                         |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>148.747,84</b>    | <b>0,32</b>             |
|      | <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                  |       |                              |                    |                                    |                   |            |                      |                         |
|      | Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen                          |       | EUR                          |                    | -74,51                             |                   |            | -74,51               | 0,00                    |
|      | Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften                      |       | EUR                          |                    | -106.406,72                        |                   |            | -106.406,72          | -0,22                   |
|      | Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften                         |       | EUR                          |                    | -1.200.223,95                      |                   |            | -1.200.223,95        | -2,53                   |
|      | Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten                       |       | EUR                          |                    | -38.799,98                         |                   |            | -38.799,98           | -0,08                   |
|      | <b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>                            |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>-1.345.505,16</b> | <b>-2,83</b>            |
|      | <b>Fondsvermögen</b>   |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>47.413.907,32</b> | <b>100,00</b>           |
|      | <b>Umlaufende Anteile</b>  |       |                              |                    |                                    |                   | <b>STK</b> | <b>476.185,000</b>   |                         |
|      | <b>Anteilwert</b>  |       |                              |                    |                                    |                   | <b>EUR</b> | <b>99,57</b>         |                         |

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

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

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Nominal<br>in Währung | Wertpapier-Darlehen<br>in EUR |                     | gesamt              |
|--|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|---------------------|
|  |                                  | befristet                     | unbefristet         |                     |
| <b>Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)</b>                        |                                  |                               |                     |                     |
| Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: |                                  |                               |                     |                     |
| Husqvarna AB Namn-Aktier B   | STK                              | 9.556                         | 67.356,41           |                     |
| Nokia Oyj Reg.Shares   | STK                              | 132                           | 588,06              |                     |
| Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares  | STK                              | 726                           | 87.264,59           |                     |
| 2,1250 % alstria office REIT-AG Anl. 16/23   | EUR                              | 300.000                       | 298.342,50          |                     |
| 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26                          | EUR                              | 300.000                       | 270.234,00          |                     |
| 0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27                                      | EUR                              | 200.000                       | 170.723,00          |                     |
| 0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27  | EUR                              | 500.000                       | 435.900,00          |                     |
| 1,7500 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 20/30  | EUR                              | 300.000                       | 274.296,00          |                     |
| 1,5000 % VGP N.V. Bonds 21/29  | EUR                              | 100.000                       | 66.963,00           |                     |
| 0,4520 % Wintershall Dea Finance B.V. Notes 19/23                                  | EUR                              | 100.000                       | 97.849,00           |                     |
| <b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>          | <b>EUR</b>                       |                               | <b>1.769.516,56</b> | <b>1.769.516,56</b> |

**Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 1.488.570,00**

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2022

|                               |       |           |                |
|-------------------------------|-------|-----------|----------------|
| Vereinigtes Königreich, Pfund | (GBP) | 0,86082   | = 1 Euro (EUR) |
| Dänemark, Kronen              | (DKK) | 7,43960   | = 1 Euro (EUR) |
| Norwegen, Kronen              | (NOK) | 10,35375  | = 1 Euro (EUR) |
| Schweden, Kronen              | (SEK) | 10,68865  | = 1 Euro (EUR) |
| Schweiz, Franken              | (CHF) | 0,99767   | = 1 Euro (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar    | (USD) | 1,04435   | = 1 Euro (EUR) |
| Kanada, Dollar                | (CAD) | 1,34831   | = 1 Euro (EUR) |
| Japan, Yen                    | (JPY) | 142,23000 | = 1 Euro (EUR) |
| Hongkong, Dollar              | (HKD) | 8,19380   | = 1 Euro (EUR) |
| Australien, Dollar            | (AUD) | 1,51784   | = 1 Euro (EUR) |

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

|      |   |
|------|---|
| IFEU | London - ICE Futures Europe   |
| XEUR | 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)                                 |
| XCBT | Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)                                     |
| XMOD | Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options                     |
| XNDX | Stockholm - Nasdaq Stockholm - Derivatives                                  |

**OTC** Over-the-Counter

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

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung                              | Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|-------------------------------------|--|---|----------------|-------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |  |   |                |                   |
| <b>Aktien</b>                       |  |   |                |                   |
| <b>CAD</b>                          |  |   |                |                   |
| CA01626P3043                        | Alimentation Couche-Tard Inc. Reg.Shs (Mul. Vtg) | STK                                     | 0              | 3.200             |
| CA11777Q2099                        | B2Gold Corp. Reg.Shares                          | STK                                     | 0              | 17.300            |
| <b>CHF</b>                          |  |   |                |                   |
| CH0012214059                        | Holcim Ltd. Namens-Aktien                        | STK                                     | 0              | 2.176             |
| CH0025751329                        | Logitech International S.A. Namens-Aktien        | STK                                     | 0              | 1.071             |
| <b>DKK</b>                          |  |   |                |                   |
| DK0060634707                        | Royal Unibrew AS Navne-Aktier                    | STK                                     | 0              | 1.151             |
| <b>EUR</b>                          |  |   |                |                   |
| DE000A1DAHH0                        | Brenntag SE Namens-Aktien                        | STK                                     | 0              | 1.727             |
| DE000DTR0CK8                        | Daimler Truck Holding AG Namens-Aktien           | STK                                     | 0              | 1.166             |
| ES0130670112                        | Endesa S.A. Acciones Port.                       | STK                                     | 0              | 3.772             |
| DE0006047004                        | HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien               | STK                                     | 0              | 1.021             |
| DE0007164600                        | SAP SE Inhaber-Aktien                            | STK                                     | 0              | 1.811             |
| IE00B1RR8406                        | Smurfit Kappa Group PLC Reg.Shares               | STK                                     | 0              | 1.662             |
| FR0000120271                        | TotalEnergies SE Actions au Porteur              | STK                                     | 1.785          | 1.785             |
| <b>GBP</b>                          |  |   |                |                   |
| GB0009895292                        | AstraZeneca PLC Reg.Shares                       | STK                                     | 0              | 858               |
| IE0002424939                        | DCC PLC Reg.Shares                               | STK                                     | 0              | 855               |
| GB0032089863                        | NEXT PLC Reg.Shares                              | STK                                     | 0              | 1.390             |
| <b>JPY</b>                          |  |   |                |                   |
| JP3830000000                        | Brother Industries Ltd. Reg.Shares               | STK                                     | 0              | 4.100             |
| JP3360800001                        | Hulic Co. Ltd. Reg.Shares                        | STK                                     | 0              | 8.000             |
| JP3756600007                        | Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares                     | STK                                     | 0              | 300               |

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| ISIN  | Gattungsbezeichnung                                    | Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|---|--|---|----------------|-------------------|
| JP3762600009  | Nomura Holdings Inc. Reg.Shares                        | STK                                     | 0              | 37.800            |
| JP3500610005  | Resona Holdings Inc. Reg.Shares                        | STK                                     | 0              | 18.700            |
| JP3449020001  | Taiheiy Cement Corp. Reg.Shares                        | STK                                     | 0              | 3.400             |
| JP3443600006  | Taisei Corp. Reg.Shares                                | STK                                     | 0              | 2.500             |
| JP3940000007  | Yamato Holdings Co. Ltd. Reg.Shares                    | STK                                     | 0              | 5.600             |
| <b>NOK</b>  |  |   |                |                   |
| NO0010208051  | Yara International ASA Navne-Aksjer                    | STK                                     | 0              | 2.765             |
| <b>SEK</b>  |  |   |                |                   |
| SE0016589188  | Electrolux, AB Namn-Aktier B                           | STK                                     | 0              | 5.636             |
| SE0000667891  | Sandvik AB Namn-Aktier                                 | STK                                     | 0              | 5.247             |
| SE0000113250  | Skanska AB Namn-Aktier B (fria)                        | STK                                     | 0              | 5.700             |
| <b>USD</b>  |  |   |                |                   |
| US88579Y1010  | 3M Co. Reg.Shares                                      | STK                                     | 0              | 656               |
| US0234361089  | Amedisys Inc. Reg.Shares                               | STK                                     | 0              | 378               |
| US1344291091  | Campbell Soup Co. Reg.Shares                           | STK                                     | 0              | 1.891             |
| US14149Y1082  | Cardinal Health Inc. Reg.Shares                        | STK                                     | 0              | 2.780             |
| US2567461080  | Dollar Tree Inc. Reg.Shares                            | STK                                     | 0              | 1.388             |
| US2786421030  | eBay Inc. Reg.Shares                                   | STK                                     | 0              | 2.316             |
| US29082K1051  | Embecta Corp. Reg.Shares                               | STK                                     | 190            | 190               |
| US34959E1091  | Fortinet Inc. Reg.Shares                               | STK                                     | 0              | 396               |
| US3687361044  | Generac Holdings Inc. Reg.Shares                       | STK                                     | 0              | 259               |
| US4943681035  | Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares                        | STK                                     | 0              | 732               |
| US5779331041  | Maximus Inc. Reg.Shares                                | STK                                     | 0              | 758               |
| US67103H1077  | O'Reilly Automotive Inc.[New] Reg.Shares               | STK                                     | 0              | 177               |
| US74736K1016  | Qorvo Inc. Reg.Shares                                  | STK                                     | 0              | 857               |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |  |   |                |                   |
| <b>EUR</b>  |  |   |                |                   |
| XS1485603747  | 1,6000 % Aptiv PLC Notes 16/28                         | EUR                                     | 0              | 200.000           |
| XS1076018305  | 3,3750 % AT & T Inc. Notes 14/34                       | EUR                                     | 0              | 300.000           |
| XS2344772426  | 1,7500 % Hammerson Ireland Finance DAC Nts 21/27 Reg.S | EUR                                     | 300.000        | 300.000           |
| XS2123970241  | 0,6250 % V.F. Corp. Notes 20/32                        | EUR                                     | 0              | 200.000           |
| XS2234567662  | 1,2500 % Volkswagen Intl Finance N.V. MTN 20/32        | EUR                                     | 200.000        | 200.000           |
| <b>USD</b>  |  |   |                |                   |
| US035240AR13  | 4,9000 % Anheuser-Busch InBev Ww Inc. Notes 19/31      | USD                                     | 0              | 200.000           |
| US04686JAA97  | 4,1250 % Athene Holding Ltd. Notes 18/28               | USD                                     | 0              | 200.000           |
| US824348AU08  | 2,7500 % Sherwin-Williams Co. Notes 17/22              | USD                                     | 0              | 15.000            |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |  |   |                |                   |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |  |   |                |                   |
| <b>EUR</b>  |  |   |                |                   |
| XS1137512668  | 1,5000 % Mölnlycke Holding AB Notes 14/22              | EUR                                     | 0              | 97.000            |
| XS2050968333  | 1,5000 % Smurfit Kappa Treasury PUC Notes 19/27        | EUR                                     | 0              | 600.000           |
| <b>USD</b>  |  |   |                |                   |
| US01400EAB92  | 3,0000 % Alcon Finance Corp. Notes 19/29 144A          | USD                                     | 0              | 200.000           |
| US20030NBH35  | 4,2500 % Comcast Corp. Notes 13/33                     | USD                                     | 0              | 200.000           |
| US278642AW32  | 2,7000 % eBay Inc. Notes 20/30                         | USD                                     | 0              | 200.000           |
| US62947QAY44  | 5,5500 % NXP B.V./NXP Funding LLC Notes 18/28 144A     | USD                                     | 0              | 200.000           |
| US860630AG72  | 4,0000 % Stifel Financial Corp. Notes 20/30            | USD                                     | 0              | 200.000           |
| <b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>  |  |   |                |                   |
| <b>Aktien</b>   |  |   |                |                   |
| <b>SEK</b>  |  |   |                |                   |
| SE0017486871  | Atlas Copco AB Namn-Aktier B Red.                      | STK                                     | 3.215          | 3.215             |
| SE0011166628  | Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria)                     | STK                                     | 0              | 3.215             |
| <b>Wertpapier-Investmentanteile</b>   |  |   |                |                   |
| <b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>                                 |  |   |                |                   |
| <b>USD</b>  |  |   |                |                   |
| LU1686830909  | L. I. Fd - L. I. DL Li. EM S. Act. Nom. Dis.           | ANT                                     | 11.700         | 19.200            |
| <b>Geldmarktfonds</b>   |  |   |                |                   |
| <b>Gruppenfremde Geldmarktfonds</b>   |  |   |                |                   |
| LI0516543951  | Altra Access Fd-Gl.Macro Alpha Inh.-Ant. I Acc.        | ANT                                     |                | 12.550            |

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000 |
|--|------------------------------|------------------|
| <b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>   |                              |                  |
| <b>Terminkontrakte</b>   |                              |                  |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>   |                              |                  |
| <b>Gekaufte Kontrakte:</b>   | <b>EUR</b>                   | <b>6.448</b>     |
| (Basiswert(e): ESTX Mid Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, MDAX Performance-Index, MSCI Emerging Markets Index, Nasdaq-100 Index, Russell 2000 Index)  |                              |                  |
| <b>Verkaufte Kontrakte:</b>  | <b>EUR</b>                   | <b>18.676</b>    |
| (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), OMX Stockholm 30 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY)) |                              |                  |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>   |                              |                  |
| <b>Gekaufte Kontrakte:</b>   | <b>EUR</b>                   | <b>7.173</b>     |

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw.<br>Anteile bzw. Whg. | Volumen<br>in 1.000 |
|--|---------------------------------|---------------------|
| (Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU))  |                                 |                     |
| <b>Verkaufte Kontrakte:</b>  | EUR                             | 9.290               |
| (Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))   |                                 |                     |
| <b>Optionsrechte</b>   |                                 |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>  |                                 |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>   |                                 |                     |
| <b>Gekaufte Kaufoptionen (Call):</b>   | EUR                             | 23.244              |
| (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index)   |                                 |                     |
| <b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>  | EUR                             | 35.007              |
| (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)   |                                 |                     |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>  |                                 |                     |
| <b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>  |                                 |                     |
| <b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>   |                                 |                     |
| AUD/EUR  | EUR                             | 197                 |
| CAD/EUR  | EUR                             | 1.070               |
| CHF/EUR  | EUR                             | 316                 |
| DKK/EUR  | EUR                             | 202                 |
| GBP/EUR  | EUR                             | 97                  |
| JPY/EUR  | EUR                             | 896                 |
| NOK/EUR  | EUR                             | 223                 |
| SEK/EUR  | EUR                             | 557                 |
| USD/EUR  | EUR                             | 9.656               |
| <b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>   |                                 |                     |
| <b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>  |                                 |                     |
| AUD/EUR  | EUR                             | 135                 |
| CAD/EUR  | EUR                             | 1.756               |
| CHF/EUR  | EUR                             | 601                 |
| DKK/EUR  | EUR                             | 202                 |
| GBP/EUR  | EUR                             | 95                  |
| JPY/EUR  | EUR                             | 1.195               |
| NOK/EUR  | EUR                             | 521                 |
| SEK/EUR  | EUR                             | 1.455               |
| USD/EUR  | EUR                             | 19.682              |
| <b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>  |                                 |                     |
| <b>unbefristet</b>   | EUR                             | 8.585               |
| (Basiswert(e): 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26, 0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27, 0,4520 % Wintershall Dea Finance B.V. Notes 19/23, 0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27, 0,6250 % V.F. Corp. Notes 20/32, 0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33, 1,2500 % Volkswagen Intl Finance N.V. MTN 20/32, 1,5000 % Smurfit Kappa Treasury PUC Notes 19/27, 1,5000 % VGP N.V. Bonds 21/29, 1,7500 % Hammerson Ireland Finance DAC Nts 21/27 Reg.S, 1,7500 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 20/30, 1,8750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. MTN 19/34, 2,1250 % alstria office REIT-AG Anl. 16/23, 2,3500 % Extra Space Storage L.P. Notes 21/32, 3,8000 % Expedia Group Inc. Notes 17/28, Ally Financial Inc. Reg.Shares, Barratt Developments PLC Reg.Shares, Nokia Oyj Reg.Shares, Skanska AB Namn-Aktier B (fria), Telenet Group Holding N.V. Actions Nom., Zebra Technologies Corp. Reg.Shares Cl.A) |                                 |                     |

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

## Anhang.

|                    |     |         |
|--------------------|-----|---------|
| Umlaufende Anteile | STK | 476.185 |
| Anteilwert         | EUR | 99,57   |

### 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 Umsatzzumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte 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.

#### Sonstiges

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

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

#### Verwendete Vermögensgegenstände

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

|                          | Marktwert in EUR | in % des Fondsvermögens |
|--------------------------|------------------|-------------------------|
| Aktien                   | 155.209,06       | 0,33                    |
| Verzinsliche Wertpapiere | 1.614.307,50     | 3,40                    |

#### 10 größte Gegenparteien

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

|  | Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR | Sitzstaat   |
|--|---------------------------------------|-------------|
| DekaBank Deutsche Girozentrale           | 545.802,61                            | Deutschland |
| Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme | 1.223.713,95                          | Deutschland |

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

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

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

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

|             | absolute Beträge in EUR |
|-------------|-------------------------|
| unbefristet | 1.769.516,56            |

#### 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.

#### Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindex (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX 50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder des GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter [www.eurexrepo.com](http://www.eurexrepo.com) entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag in Höhe von 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

#### Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

##### Wertpapier-Darlehen

EUR  
USD

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

##### Wertpapier-Darlehen

|                       | absolute Beträge in EUR |
|-----------------------|-------------------------|
| Restlaufzeit 1-7 Tage | 1.303.051,14            |



# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

unbefristet

961.408,85

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

## Ertrags- und Kostenanteile

### Wertpapier-Darlehen

|                         | absolute Beträge in EUR | in % der Bruttoerträge des Fonds |
|-------------------------|-------------------------|----------------------------------|
| Ertragsanteil des Fonds | 1.204,79                | 100,00                           |
| Kostenanteil des Fonds  | 397,60                  | 33,00                            |
| Ertragsanteil der KVG   | 397,60                  | 33,00                            |

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

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

## Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

4,47% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

### Wertpapier-Darlehen

|  | absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR |
|--|---|
| Spanien, Königreich  | 584.280,68  |
| American Honda Finance Corp.   | 510.783,62  |
| LfA Förderbank Bayern  | 295.516,46  |
| Italien, Republik  | 172.425,83  |
| AstraZeneca PLC  | 157.508,30  |
| Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria | 141.465,69  |
| Portugal, Republik   | 92.383,57   |
| Österreich, Republik   | 74.805,19   |
| Mailand, Stadt   | 43.854,27   |
| Caixabank S.A.   | 35.976,09   |

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

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

|                                       |  |
|---------------------------------------|--|
| Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer      | 3  |
| J.P.Morgan AG Frankfurt               | 668.291,92 EUR (absolut/verwahrter Betrag)   |
| Clearstream Banking Frankfurt         | 293.116,93 EUR (absolut/verwahrter Betrag)   |
| Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus | 1.303.051,14 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 Swaps |       |
| 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.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2022  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

# 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 und der S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 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](http://www.deka.de)

