

Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2023.

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2023

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 2023 bis zum 30. Juni 2023.

Nach mehr als fünfzehn Monaten seit dem russischen Einmarsch in die Ukraine ist an den Finanzplätzen eine Form von Gewöhnung an den Konflikt zu konstatieren, wenngleich die Auswirkungen auf die verschiedenen Volkswirtschaften weiterhin präsent bleiben. Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor nahmen angesichts eines milden Winters spürbar ab. Die Teuerungsraten entfernten sich im Verlauf von ihren Höchstständen. Zudem führte die abrupte Abkehr von der rigiden Null-Covid-Politik und entsprechender Lockdown-Maßnahmen in China zu einer Wiederbelebung des globalen Handels.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtshalbjahr unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,00 Prozent bis 5,25 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,00 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 3,8 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen startete mit Rückenwind in das Jahr 2023 und trotz erhöhter Anleiherenditen sowie zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren aus dem Bankensektor bestimmte eine Aufwärtsbewegung das Bild an den Aktienmärkten. Der Euro tendierte im Verhältnis zum US-Dollar seit dem Jahreswechsel in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende Juni bei 1,09 US-Dollar.

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka.de 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 2023	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023	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.

Anlageziel des Fonds ist es einen mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachs durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und die positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte zu erreichen. Um dies zu erreichen, legt der quantitativ und aktiv gemanagte Fonds 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.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus. Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten. Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen.

Wichtige Kennzahlen

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Performance*	6 Monate
	3,0%
ISIN	DE000DK0V6D3
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

Die Einstufung welche Unternehmen in diesem Sinne kontroverse Geschäftspraktiken anwenden, erfolgt im Rahmen des Investmentprozesses. Unternehmen, die kontroverse Waffen herstellen, werden grundsätzlich aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Nicht investiert wird zudem in Staaten, die nach dem Freedom-House Index als „unfrei“ („not free“) eingestuft werden und/oder nach dem Corruption-Perceptions-Index einen Score von weniger als 40 aufweisen. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens „BBB“ oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

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

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

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35% des Sondervermögens in Wertpapiere 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) investieren.

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	27.029.642,26	60,30
Australien	254.826,80	0,57
Dänemark	405.995,27	0,90
Deutschland	1.143.083,01	2,54
Finnland	222.039,72	0,49
Frankreich	998.150,97	2,23
Großbritannien	937.338,37	2,09
Hongkong	36.225,14	0,08
Irland	440.381,51	0,99
Israel	133.637,88	0,30
Italien	340.900,08	0,75
Japan	1.154.453,42	2,59
Kanada	1.119.172,95	2,51
Neuseeland	30.047,95	0,07
Niederlande	998.089,49	2,23
Österreich	288.497,74	0,65
Schweden	261.042,36	0,58
Schweiz	345.723,55	0,77
Spanien	144.666,80	0,32
USA	17.775.369,25	39,64
2. Anleihen	10.202.792,13	22,74
Belgien	683.031,00	1,52
Bermuda	156.168,93	0,35
Deutschland	437.200,00	0,97
Finnland	181.541,00	0,40
Frankreich	1.672.564,36	3,74
Italien	299.031,00	0,67
Niederlande	555.282,00	1,23
Österreich	164.990,00	0,37
Schweden	293.628,00	0,65
Spanien	462.878,00	1,03
USA	5.296.477,84	11,81
3. Investmentanteile	5.302.778,70	11,81
Deutschland	774.161,80	1,73
Irland	1.944.188,41	4,34
Luxemburg	2.584.428,49	5,74
4. Sonstige Wertpapiere	50.438,54	0,11
Schweiz	50.438,54	0,11
5. Derivate	219.005,18	0,49
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	1.433.192,37	3,20
7. Sonstige Vermögensgegenstände	1.143.975,22	2,54
II. Verbindlichkeiten	-536.503,89	-1,19
III. Fondsvermögen	44.845.320,51	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	27.029.642,26	60,30
AUD	254.826,80	0,57
CAD	1.119.172,95	2,51
CHF	249.509,70	0,56
DKK	405.995,27	0,90
EUR	3.924.874,09	8,74
GBP	947.974,58	2,11
HKD	36.225,14	0,08
JPY	1.154.453,42	2,59
NZD	30.047,95	0,07
SEK	367.071,76	0,82
USD	18.539.490,60	41,35
2. Anleihen	10.202.792,13	22,74
EUR	5.856.313,70	13,04
USD	4.346.478,43	9,70
3. Investmentanteile	5.302.778,70	11,81
EUR	2.655.269,50	5,92
USD	2.647.509,20	5,89
4. Sonstige Wertpapiere	50.438,54	0,11
CHF	50.438,54	0,11
5. Derivate	219.005,18	0,49
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	1.433.192,37	3,20
7. Sonstige Vermögensgegenstände	1.143.975,22	2,54
II. Verbindlichkeiten	-536.503,89	-1,19
III. Fondsvermögen	44.845.320,51	100,00

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

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteil bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								32.726.182,22	72,98
Aktien								27.029.642,26	60,30
EUR								3.924.874,09	8,74
IT0001233417	AZA S.p.A. Azioni nom.	STK		48.806	0	0	EUR 1,678	81.872,07	0,18
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		4.959	0	0	EUR 31,275	155.092,73	0,35
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		644	0	175	EUR 213,850	137.719,40	0,31
AT0000730007	Andritz AG Inhaber-Aktien	STK		2.212	0	0	EUR 50,200	111.042,40	0,25
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		264	63	85	EUR 655,300	172.999,20	0,39
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		5.684	0	0	EUR 27,180	154.491,12	0,34
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		9.810	9.810	0	EUR 7,078	69.435,18	0,15
IE00BD1RP616	Bank of Ireland Group PLC Reg.Shares	STK		2.400	2.400	0	EUR 8,884	21.321,60	0,05
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien	STK		1.359	0	0	EUR 103,600	140.792,40	0,31
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK		2.564	0	0	EUR 57,850	148.327,40	0,33
DE000A1DAHH0	Brenntag SE Namens-Aktien	STK		963	963	0	EUR 70,820	68.199,66	0,15
FR0000125338	Capgemini SE Actions Port.	STK		571	0	0	EUR 171,650	98.012,15	0,22
NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam	STK		5.203	0	0	EUR 13,180	68.575,54	0,15
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur	STK		1.351	0	0	EUR 55,700	75.250,70	0,17
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		9.990	9.990	0	EUR 11,665	116.533,35	0,26
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK		924	0	0	EUR 96,100	88.796,40	0,20
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK		1.887	1.887	0	EUR 38,240	72.158,88	0,16
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien	STK		1.201	1.201	0	EUR 70,860	85.102,86	0,19
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK		4.325	0	0	EUR 37,095	160.435,88	0,36
FR0010259150	Ipsen S.A. Actions au Porteur	STK		680	0	0	EUR 110,500	75.140,00	0,17
IT0005211237	Italgas S.P.A. Azioni nom.	STK		10.896	0	0	EUR 5,445	59.328,72	0,13
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B	STK		3.499	0	0	EUR 17,255	60.375,25	0,13
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK		12.291	0	0	EUR 10,990	135.078,09	0,30
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK		1.837	0	0	EUR 73,720	135.423,64	0,30
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		782	0	333	EUR 149,650	117.026,30	0,26
FI0009000681	Nokia Oyj Reg.Shares	STK		14.389	0	0	EUR 3,867	55.635,07	0,12
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien	STK		2.292	0	0	EUR 38,970	89.319,24	0,20
IT0004176001	Prismyn S.p.A. Azioni nom.	STK		1.715	1.715	0	EUR 37,680	64.621,20	0,14
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		1.927	0	378	EUR 74,300	143.176,10	0,32
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder	STK		2.076	0	697	EUR 48,440	100.561,44	0,22
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		4.882	0	0	EUR 15,410	75.231,62	0,17
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		1.904	0	0	EUR 98,050	186.687,20	0,42
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK		719	719	0	EUR 152,560	109.690,64	0,24
NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen op naam	STK		8.209	0	0	EUR 16,160	132.657,44	0,30
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder	STK		1.469	1.469	0	EUR 45,130	66.295,97	0,15
FR0000121204	Wendel SE Actions Port.	STK		303	0	0	EUR 93,300	28.269,90	0,06
AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien	STK		3.159	3.159	0	EUR 27,900	88.136,10	0,20
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		1.525	0	0	EUR 115,450	176.061,25	0,39
AUD								254.826,80	0,57
AU000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK		8.480	0	0	AUD 20,550	106.285,76	0,24
AU000000GPT8	GPT Group Reg.Units	STK		23.794	23.794	0	AUD 4,140	60.080,73	0,13
AU000000MGR9	Mirvac Group Reg.Stapled Units	STK		64.176	0	0	AUD 2,260	88.460,31	0,20
CAD								1.119.172,95	2,51
CA11284V1058	Brookfield Renewable Corp. Reg.Shs Cl.A Sub.Vot.	STK		3.700	2.100	0	CAD 41,370	106.309,73	0,24
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK		1.800	0	0	CAD 137,570	171.981,61	0,38
CA3759161035	Gildan Activewear Inc. Reg.Shares (Sub.Vtg)	STK		2.900	0	0	CAD 42,170	84.935,13	0,19
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares	STK		1.600	0	0	CAD 119,240	132.503,61	0,30
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK		5.000	0	0	CAD 24,730	85.877,60	0,19
CA6665111002	Northland Power Inc. Reg.Shares	STK		3.100	0	0	CAD 27,250	58.669,71	0,13
CA67077M1086	Nutrien Ltd Reg.Shares	STK		1.400	0	0	CAD 78,090	75.929,27	0,17
CA6837151068	Open Text Corp. Reg.Shares	STK		1.800	0	0	CAD 54,010	67.520,00	0,15
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)	STK		2.200	0	4.300	CAD 31,750	48.512,33	0,11
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK		1.800	0	0	CAD 68,200	85.259,47	0,19
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK		1.000	0	0	CAD 81,460	56.575,73	0,13
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK		700	0	0	CAD 106,490	51.771,72	0,12
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK		1.200	0	0	CAD 111,980	93.327,04	0,21
CHF								249.509,70	0,56
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK		950	0	0	CHF 107,780	104.838,99	0,23
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		951	951	2.627	CHF 89,850	87.490,25	0,20
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK		131	0	107	CHF 426,300	57.180,46	0,13
DKK								405.995,27	0,90
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK		58	0	0	DKK 12.050,000	93.847,35	0,21
DK0010181759	Carlsberg AS Navne-Aktier B	STK		807	0	0	DKK 1.089,000	118.007,17	0,26
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		1.335	0	314	DKK 1.083,000	194.140,75	0,43
GBP								947.974,58	2,11
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares	STK		633	633	0	GBP 113,000	83.276,38	0,19
GB0031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares	STK		3.184	0	0	GBP 21,230	78.697,83	0,18

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien		STK	3.556	0	0	GBP 23,240	96.213,85	0,21
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares		STK	10.500	2.420	0	GBP 13,950	170.530,95	0,38
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC Reg.Shares		STK	12.498	0	0	GBP 6,444	93.763,92	0,21
GB00B06QFB75	IG Group Holdings PLC Reg.Shares		STK	7.036	7.036	0	GBP 6,760	55.374,81	0,12
GB00BLDRH360	OSB GROUP PLC Reg.Shares		STK	5.439	5.439	0	GBP 4,810	30.458,17	0,07
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares		STK	910	910	0	GBP 58,980	62.486,45	0,14
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC Reg.Shares		STK	4.106	4.106	0	GBP 16,400	78.397,55	0,17
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares		STK	3.676	834	0	GBP 40,965	175.318,67	0,39
GB00BD6GN030	Virgin Money UK PLC Reg.Shares		STK	13.508	13.508	0	GBP 1,492	23.456,00	0,05
HKD								36.225,14	0,08
HK0000063609	Swire Properties Ltd. Reg.Shares		STK	16.000	16.000	0	HKD 19,260	36.225,14	0,08
JPY								1.154.453,42	2,59
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares		STK	6.000	0	0	JPY 2.149,000	81.996,82	0,18
JP3486800000	Daito Trust Constr. Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.200	500	0	JPY 14.585,000	111.300,48	0,25
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Reg.Shares		STK	600	600	0	JPY 18.595,000	70.950,72	0,16
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Reg.Shares		STK	2.600	2.600	0	JPY 4.028,000	66.599,68	0,15
JP3304200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares		STK	2.500	2.500	0	JPY 3.881,000	61.701,11	0,14
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares		STK	30.000	28.800	3.100	JPY 170,500	32.527,82	0,07
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares		STK	3.300	0	0	JPY 2.606,000	54.688,71	0,12
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares		STK	8.800	0	0	JPY 2.612,500	146.200,32	0,33
JP3326000001	Sankyu Inc. Reg.Shares		STK	2.600	0	0	JPY 4.748,000	78.504,29	0,18
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares		STK	2.900	2.900	0	JPY 4.768,000	87.931,32	0,20
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.100	0	0	JPY 6.459,000	86.256,92	0,19
JP3106600004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares		STK	4.800	0	0	JPY 3.315,000	101.189,19	0,23
JP3659000008	West Japan Railway Co. Reg.Shares		STK	1.900	1.900	0	JPY 5.990,000	72.375,20	0,16
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares		STK	3.900	0	0	JPY 4.122,000	102.230,84	0,23
NZD								30.047,95	0,07
NZTELE000154	Spark New Zealand Ltd. Reg.Shares		STK	10.528	0	0	NZD 5,090	30.047,95	0,07
SEK								367.071,76	0,82
SE0017486897	Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria)		STK	7.212	0	5.648	SEK 134,100	81.913,94	0,18
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares		STK	10.645	4.528	0	SEK 117,600	106.029,40	0,24
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria)		STK	4.544	0	0	SEK 119,450	45.972,46	0,10
SE0000114837	Trelleborg AB Namn-Aktier B (fria)		STK	5.782	0	0	SEK 271,900	133.155,96	0,30
USD								18.539.490,60	41,35
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares		STK	1.942	0	0	USD 107,660	192.581,14	0,43
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	419	0	897	USD 133,230	51.419,31	0,11
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A		STK	598	0	0	USD 308,330	169.834,97	0,38
US00507V1098	Activision Blizzard Inc. Reg.Shares		STK	1.522	0	0	USD 83,080	116.471,94	0,26
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares		STK	509	177	0	USD 483,770	226.812,44	0,51
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares		STK	1.757	0	0	USD 69,120	111.862,79	0,25
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares		STK	826	0	0	USD 118,050	89.816,52	0,20
US00971T1016	Akamai Technologies Inc. Reg.Shares		STK	1.597	0	0	USD 89,190	131.199,22	0,29
IE00BFR3W74	Allegion PLC Reg.Shares		STK	1.020	0	0	USD 119,580	112.348,92	0,25
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C		STK	2.908	0	1.432	USD 120,010	321.456,34	0,72
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	2.215	0	785	USD 119,100	242.994,06	0,54
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares		STK	4.119	0	0	USD 127,900	485.257,77	1,08
US0311001004	AMETEK Inc. Reg.Shares		STK	584	584	0	USD 160,140	86.143,56	0,19
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	858	0	0	USD 221,160	174.784,95	0,39
US0326541051	Analog Devices Inc. Reg.Shares		STK	695	0	0	USD 189,480	121.299,31	0,27
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	9.032	235	1.158	USD 189,590	1.577.282,62	3,51
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	729	0	0	USD 216,460	145.350,10	0,32
US0533321024	AutoZone Inc. Reg.Shares		STK	57	0	19	USD 2.455,400	128.916,13	0,29
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares		STK	3.456	0	0	USD 28,660	91.234,71	0,20
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares		STK	498	0	262	USD 260,520	119.503,49	0,27
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares		STK	1.964	0	0	USD 83,210	150.531,42	0,34
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares		STK	523	523	0	USD 282,130	135.913,04	0,30
US0936711052	Block H. & R. Inc. Reg.Shares		STK	1.733	0	0	USD 32,020	51.112,84	0,11
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	2.892	0	476	USD 64,000	170.485,88	0,38
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares		STK	373	107	0	USD 862,570	296.355,74	0,66
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)		STK	811	0	0	USD 94,280	70.428,85	0,16
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	635	0	184	USD 228,540	133.673,74	0,30
US14448C1045	Carrier Global Corp. Reg.Shares		STK	2.035	2.035	0	USD 49,490	92.766,68	0,21
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares		STK	627	0	0	USD 244,240	141.056,95	0,31
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares		STK	625	0	0	USD 135,740	78.144,43	0,17
IL0010824113	Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares		STK	1.134	0	0	USD 127,940	133.637,88	0,30
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	5.421	1.124	0	USD 51,210	255.708,02	0,57
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC Reg.Shares		STK	1.456	1.456	0	USD 63,810	85.577,64	0,19
US1924461023	Cognizant Technology Sol. Corp. Reg.Shs Cl.A		STK	2.104	0	0	USD 64,540	125.079,13	0,28
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares		STK	339	0	0	USD 76,560	23.906,27	0,05
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A		STK	2.999	0	2.706	USD 41,470	114.556,74	0,26
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares		STK	289	289	0	USD 242,000	64.420,39	0,14
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares		STK	1.404	593	0	USD 68,760	88.922,80	0,20
US2358511028	Danaher Corp. Reg.Shares		STK	280	0	0	USD 237,770	61.323,26	0,14
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares		STK	720	255	0	USD 165,300	109.626,49	0,24
US2441991054	Deere & Co. Reg.Shares		STK	419	0	90	USD 401,630	155.006,65	0,35

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares	STK		686	0	627	USD 117,900	74.498,60	0,17
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares	STK		1.486	0	1.399	USD 53,240	72.873,06	0,16
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		6.557	0	0	USD 26,720	161.380,78	0,36
US23355L1061	DXC Technology Co. Reg.Shares	STK		2.422	0	0	USD 26,230	58.517,07	0,13
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares	STK		389	0	62	USD 440,100	157.692,53	0,35
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares	STK		151	151	0	USD 464,490	64.604,61	0,14
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares	STK		1.282	486	0	USD 120,140	141.868,45	0,32
US3032501047	Fair Isaac Corp. Reg.Shares	STK		157	0	0	USD 796,540	115.190,70	0,26
US3377381088	Fiserv Inc. Reg.Shares	STK		768	768	0	USD 124,050	87.754,25	0,20
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares	STK		343	0	81	USD 342,540	108.222,01	0,24
US6687711084	Gen Digital Inc. Reg.Shares	STK		4.599	0	0	USD 18,430	78.072,65	0,17
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares	STK		1.950	1.950	0	USD 76,300	137.046,93	0,31
US375581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares	STK		2.376	0	467	USD 76,010	166.351,73	0,37
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares	STK		368	0	304	USD 300,440	101.839,38	0,23
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares	STK		1.436	0	376	USD 80,900	107.007,23	0,24
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares	STK		7.765	0	0	USD 16,650	119.087,41	0,27
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares	STK		2.065	0	0	USD 80,070	152.300,05	0,34
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares	STK		2.660	0	2.055	USD 30,320	74.288,40	0,17
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares	STK		249	249	0	USD 443,860	101.801,81	0,23
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares	STK		6.349	0	0	USD 32,910	192.461,28	0,43
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares	STK		2.281	0	0	USD 38,090	80.028,82	0,18
US4262811015	Jack Henry & Associates Inc. Reg.Shares	STK		691	0	0	USD 166,480	105.962,03	0,24
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares	STK		2.070	0	237	USD 164,100	312.888,13	0,70
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares	STK		1.603	0	0	USD 143,430	211.779,39	0,47
US4878361082	Kellogg Co. Reg.Shares	STK		905	0	1.048	USD 66,820	55.701,28	0,12
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares	STK		727	0	184	USD 165,340	110.719,09	0,25
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares	STK		598	0	0	USD 240,480	132.461,70	0,30
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares	STK		438	0	0	USD 322,990	130.308,68	0,29
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares	STK		908	0	0	USD 222,820	186.358,92	0,42
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A	STK		1.507	0	0	USD 90,660	125.845,92	0,28
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares	STK		1.054	0	0	USD 185,930	180.509,57	0,40
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares	STK		2.273	0	0	USD 57,340	120.051,42	0,27
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A	STK		489	0	0	USD 387,670	174.614,87	0,39
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares	STK		399	0	0	USD 294,470	108.224,13	0,24
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares	STK		279	233	0	USD 420,880	108.161,49	0,24
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK		2.637	0	275	USD 113,540	275.784,07	0,61
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK		101	0	0	USD 1.316,880	122.511,75	0,27
US5950171042	Microchip Technology Inc. Reg.Shares	STK		1.508	0	0	USD 86,980	120.817,80	0,27
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK		3.641	0	885	USD 335,050	1.123.674,34	2,51
US60770K1079	Moderna Inc. Reg.Shares	STK		400	400	0	USD 122,110	44.990,56	0,10
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares	STK		477	0	0	USD 294,770	129.512,54	0,29
US6703461052	Nucor Corp. Reg.Shares	STK		581	581	0	USD 163,330	87.408,22	0,19
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares	STK		708	0	0	USD 408,220	266.218,17	0,59
US6819191064	Omnicom Group Inc. Reg.Shares	STK		1.698	0	0	USD 94,130	147.223,08	0,33
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares	STK		1.616	0	0	USD 130,720	194.577,92	0,43
US6951561090	Packaging Corp. of America Reg.Shares	STK		234	0	0	USD 131,860	28.420,98	0,06
US7010941042	Parker-Hannifin Corp. Reg.Shares	STK		491	0	0	USD 386,750	174.912,96	0,39
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares	STK		513	0	0	USD 109,330	51.661,48	0,12
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK		4.084	0	0	USD 36,120	135.876,28	0,30
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares	STK		1.685	0	0	USD 77,320	120.005,71	0,27
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares	STK		1.012	0	0	USD 118,060	110.050,86	0,25
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares	STK		1.137	0	0	USD 141,140	147.815,76	0,33
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK		114	0	0	USD 708,420	74.388,50	0,17
US7595091023	Reliance Steel & Alumin. Co. Reg.Shares	STK		285	285	0	USD 270,810	71.091,83	0,16
US7703231032	Robert Half International Inc. Reg.Shares	STK		1.436	0	0	USD 74,070	97.973,12	0,22
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares	STK		537	0	0	USD 286,960	141.940,33	0,32
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares	STK		883	0	0	USD 34,070	27.710,41	0,06
US8716071076	Synopsis Inc. Reg.Shares	STK		360	0	155	USD 427,900	141.891,03	0,32
US8760301072	Tapestry Inc. Reg.Shares	STK		3.512	0	0	USD 42,830	138.551,98	0,31
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares	STK		228	0	0	USD 257,500	54.078,20	0,12
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK		1.220	0	0	USD 176,790	198.667,89	0,44
US1255231003	The Cigna Group Reg.Shares	STK		500	0	0	USD 277,250	127.688,48	0,28
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares	STK		1.646	0	0	USD 60,020	90.998,87	0,20
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK		807	399	0	USD 307,820	228.812,91	0,51
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares	STK		2.275	0	0	USD 46,320	97.064,43	0,22
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK		1.037	0	0	USD 149,380	142.686,00	0,32
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares	STK		229	0	248	USD 514,390	108.502,10	0,24
US9026811052	UGI Corp. Reg.Shares	STK		1.469	0	0	USD 26,850	36.330,91	0,08
US90384S3031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares	STK		403	0	0	USD 465,280	172.714,82	0,39
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B	STK		860	0	0	USD 176,050	139.458,39	0,31
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares	STK		573	328	82	USD 476,440	251.462,37	0,56
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares	STK		4.087	0	0	USD 36,990	139.251,26	0,31
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK		649	0	0	USD 348,180	208.141,50	0,46
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		793	0	0	USD 234,320	171.156,23	0,38
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares	STK		219	219	0	USD 782,300	157.807,49	0,35
US94106L1098	Waste Management Inc. Reg.Shares	STK		662	0	0	USD 169,610	103.423,59	0,23

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares		STK	395	0	0	USD 261,950	95.307,19	0,21
US9598021098	Western Union Co. Reg.Shares		STK	7.587	0	0	USD 11,620	81.205,67	0,18
IE008DB6Q211	Willis Towers Watson PLC Reg.Shares		STK	639	0	0	USD 232,550	136.876,02	0,31
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	1.357	0	0	USD 137,260	171.567,10	0,38
Verzinsliche Wertpapiere								5.646.101,42	12,57
EUR								4.977.340,20	11,08
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 20/30		EUR	400.000	0	0	% 93,720	374.880,00	0,84
XS2177552390	2,5000 % Amadeus IT Group S.A. MTN 20/24		EUR	200.000	0	0	% 98,464	196.928,00	0,44
XS2079713322	0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26		EUR	300.000	0	0	% 88,650	265.950,00	0,59
XS2049584084	0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27 ¹⁾		EUR	200.000	0	0	% 82,495	164.990,00	0,37
BE0002466416	3,0000 % Elia Transm. Belgium S.A./N.V. Bonds 14/29		EUR	400.000	0	0	% 96,683	386.730,00	0,86
XS1584122177	1,1250 % Essity AB MTN 17/24		EUR	300.000	0	0	% 97,876	293.628,00	0,65
XS2047479469	0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27 ¹⁾		EUR	500.000	0	0	% 87,440	437.200,00	0,97
FR0013420023	0,2500 % HSBC Continental Europe S.A. MTN 19/24		EUR	300.000	0	0	% 96,731	290.193,00	0,65
XS1963837197	1,9790 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Bonds 19/30		EUR	400.000	0	0	% 86,681	346.722,00	0,77
FR0013320249	1,8000 % Mercalys Bonds 18/26		EUR	300.000	0	0	% 89,471	268.413,00	0,60
XS1041934800	2,8750 % Naturgy Finance B.V. MTN 14/24		EUR	300.000	0	0	% 99,244	297.732,00	0,66
FR0013506532	1,7500 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 20/30		EUR	300.000	0	0	% 89,575	268.725,00	0,60
BE6265262327	2,3750 % Proximus S.A. MTN 14/24		EUR	300.000	0	0	% 98,767	296.301,00	0,66
XS2203995910	0,5000 % Sodexo S.A. Notes 20/24		EUR	300.000	0	0	% 98,148	294.444,00	0,66
XS2087643651	1,0000 % Stryker Corp. Notes 19/31		EUR	200.000	0	0	% 78,942	157.883,20	0,35
XS1718480327	0,3750 % United Parcel Service Inc. Notes 17/23		EUR	200.000	0	0	% 98,765	197.530,00	0,44
XS2478685931	2,2500 % UPM Kymmene Corp. MTN 22/29		EUR	200.000	0	0	% 90,771	181.541,00	0,40
XS2324836878	0,2500 % Wolters Kluwer N.V. Notes 21/28		EUR	300.000	0	0	% 85,850	257.550,00	0,57
USD								668.761,22	1,49
US209111EU37	6,7500 % Cons. Edison Co. New York Inc. Debts 5.2008B 08/38		USD	190.000	0	0	% 110,895	194.077,39	0,43
US404119BU21	4,5000 % HCA Inc. Notes 16/27		USD	300.000	0	0	% 96,613	266.974,16	0,60
US617446HD43	7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32 ¹⁾		USD	200.000	0	0	% 112,750	207.709,67	0,46
Sonstige Beteiligungswertpapiere								50.438,54	0,11
CHF								50.438,54	0,11
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	179	0	275	CHF 275,200	50.438,54	0,11
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								4.556.690,71	10,17
Verzinsliche Wertpapiere								4.556.690,71	10,17
EUR								878.973,50	1,96
XS1395004408	3,8750 % LKQ It.Bondco di LKQ It.Bondco Notes 16/24 Reg.S		EUR	300.000	0	0	% 99,677	299.031,00	0,67
XS2369906644	0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33 ¹⁾		EUR	400.000	0	0	% 72,196	288.782,00	0,64
XS2168625460	0,2500 % PepsiCo Inc. Notes 20/24		EUR	300.000	0	0	% 97,054	291.160,50	0,65
USD								3.677.717,21	8,21
US00287YAR09	4,5000 % AbbVie Inc. Notes 15/35		USD	200.000	0	0	% 94,120	173.389,21	0,39
US00928QAU58	2,8500 % Aircastle Ltd. Notes 21/28 144A		USD	200.000	0	0	% 84,772	156.168,93	0,35
US037833AT77	4,4500 % Apple Inc. Notes 14/44		USD	200.000	0	0	% 96,576	177.913,69	0,40
US093662AH70	3,8750 % Block Financial LLC Notes 20/30		USD	400.000	0	0	% 88,096	324.585,27	0,72
US11135FAL58	4,1100 % Broadcom Inc. Notes 20/28		USD	300.000	0	0	% 93,885	259.433,06	0,58
US22822VAR24	3,3000 % Crown Castle Inc. Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 88,040	162.188,00	0,36
US126650DR85	2,1250 % CVS Health Corp. Notes 21/31		USD	200.000	0	0	% 79,181	145.868,37	0,33
US256677AG02	3,5000 % Dollar General Corp. (New) Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 89,071	164.087,87	0,37
US256746AH16	4,2000 % Dollar Tree Inc. Notes 18/28		USD	400.000	0	0	% 95,430	351.603,19	0,78
US268317AS33	3,6250 % Electricité de France (E.D.F.) Notes 15/25 144A		USD	200.000	200.000	0	% 95,488	175.909,36	0,39
US30225VAG23	2,3500 % Extra Space Storage L.P. Notes 21/32		USD	500.000	0	0	% 77,685	357.781,51	0,80
US41283LBA26	3,0500 % Harley Davidson Finl Serv.Inc. Notes 22/27 144A		USD	200.000	200.000	0	% 88,700	163.404,41	0,36
US460690BP43	4,6500 % Interpublic Group of Comp.Inc. Notes 18/28		USD	200.000	200.000	0	% 95,056	175.112,61	0,39
US460690BR09	4,7500 % Interpublic Group of Comp.Inc. Notes 20/30		USD	200.000	200.000	0	% 96,299	177.402,48	0,40
US459200JZ55	3,3000 % Intl Business Machines Corp. Notes 19/26		USD	200.000	200.000	0	% 94,918	174.859,30	0,39

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
US48203RAP91	2,0000 % Juniper Networks Inc. Notes 20/30		USD	500.000	0	0	% 77,437	356.641,18	0,80	
US785592AS57	5,0000 % Sabine Pass Liquefaction LLC Notes 17/27		USD	200.000	0	0	% 98,452	181.368,77	0,40	
Wertpapier-Investmentanteile								5.302.778,70	11,81	
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								774.161,80	1,73	
EUR								774.161,80	1,73	
DE0005424568	Deka-Vega Plus I (A)		ANT	11.420	0	0	EUR 67,790	774.161,80	1,73	
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								918.611,70	2,04	
EUR								918.611,70	2,04	
LU1685588219	Deka-MultiFactor Global Corporates I		ANT	1.880	0	0	EUR 81,960	154.084,80	0,34	
LU1685587591	Deka-MultiFactor Global Corporates HY I		ANT	9.285	0	0	EUR 82,340	764.526,90	1,70	
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								3.610.005,20	8,04	
EUR								962.496,00	2,15	
IE00BKLC5874	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	222.800	251.700	104.000	EUR 4,320	962.496,00	2,15	
USD								2.647.509,20	5,89	
IE00BKFO9C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	243.600	333.300	167.400	USD 4,375	981.692,41	2,19	
LU1974695790	UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE Act. Nom.A-acc.		ANT	146.200	199.800	98.400	USD 12,370	1.665.816,79	3,70	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	42.585.651,63	94,96
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte								-154.759,44	-0,35	
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl -37				-24.605,00	-0,05	
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) Sep. 23		XIOM	USD	Anzahl 2				4.288,49	0,01	
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) Sep. 23		XCME	USD	Anzahl 5				679,32	0,00	
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 23		XCME	USD	Anzahl -42				-92.991,80	-0,21	
ESTX Mid Index Future (FMCE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl 11				-935,00	0,00	
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 23		IFEU	GBP	Anzahl 2				-1.148,88	0,00	
MDAX Mini Future (FSMX) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl 11				1.243,29	0,00	
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) Sep. 23		IFUS	USD	Anzahl 46				-57.836,32	-0,13	
OMX Index Future (O30) Juli 23		XNDX	SEK	Anzahl -8				1.202,71	0,00	
OMXC25 Index Future (OMW) Juli 23		XNDX	DKK	Anzahl -8				1.353,53	0,00	
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 23		XMOD	CAD	Anzahl -2				-724,88	0,00	
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 23		XSFE	AUD	Anzahl 2				1.585,77	0,00	
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 23		XEUR	CHF	Anzahl 4				-1.433,47	0,00	
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 23		XOSE	JPY	Anzahl 3				14.562,80	0,03	
Optionsrechte								29.622,81	0,07	
Optionsrechte auf Aktienindices								29.622,81	0,07	
Nasdaq-100 Index (N100) Call Aug. 23 15200		XCBO		Anzahl 1			USD 321,600	29.622,81	0,07	
Summe Aktienindex-Derivate								EUR	-125.136,63	-0,28
Zins-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte								-25.149,62	-0,07	
10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 23		XEUR	EUR	1.100.000				-16.825,38	-0,04	
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 23		XEUR	EUR	-1.300.000				26.070,00	0,06	
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 23		XEUR	EUR	500.000				-11.650,00	-0,03	
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 23		XEUR	EUR	1.100.000				-110,00	0,00	
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 23		XCBT	USD	-300.000				4.965,35	0,01	
Long Gilt Future (FLG) Sep. 23		IFEU	GBP	700.000				-4.400,80	-0,01	
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 23		XEUR	EUR	1.700.000				-29.920,00	-0,07	
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 23		XCBT	USD	-1.100.000				18.738,78	0,04	
Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 23		XCBT	USD	1.200.000				-13.701,47	-0,03	
Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) Sep. 23		XCBT	USD	-100.000				1.194,56	0,00	
US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 23		XCBT	USD	-200.000				489,34	0,00	
Summe Zins-Derivate								EUR	-25.149,62	-0,07
Devisen-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Kauf)								-21.551,51	-0,04	
Offene Positionen										
AUD/EUR 220.000,00		OTC						-1.392,05	0,00	
CHF/EUR 360.000,00		OTC						-1.457,39	0,00	
JPY/EUR 58.000.000,00		OTC						-18.702,07	-0,04	
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								186.684,37	0,42	
Offene Positionen										
CAD/EUR 530.000,00		OTC						385,68	0,00	
DKK/EUR 2.200.000,00		OTC						1,23	0,00	
SEK/EUR 2.500.000,00		OTC						3.249,70	0,01	
USD/EUR 15.900.000,00		OTC						183.047,76	0,41	
Summe Devisen-Derivate								EUR	165.132,86	0,38

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Swaps									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Inflation Swaps (IFS)									
Protection Seller									
	IFS Euro HICP Ex-Tobacco EUR / 1,6125% EUR / BNP_PAR 03.08.2028	OTC	STK	1.300.000				204.158,57 204.158,57	0,46 0,46
Summe Swaps							EUR	204.158,57	0,46
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	584.652,15			% 100,000	584.652,15	1,30
EUR-Guthaben bei									
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	2.357,68			% 100,000	2.357,68	0,01
	Landesbank Saar		EUR	3.676,50			% 100,000	3.676,50	0,01
	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-		EUR	5.232,36			% 100,000	5.232,36	0,01
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	624.747,54			% 100,000	83.890,26	0,19
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	265.229,26			% 100,000	22.665,97	0,05
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	454.751,48			% 100,000	38.516,55	0,09
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	92.511,20			% 100,000	56.423,72	0,13
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	63.028,38			% 100,000	43.774,57	0,10
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	63.028,47			% 100,000	64.535,37	0,14
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	35.815,22			% 100,000	41.697,24	0,09
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	33.593,31			% 100,000	3.948,99	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	16.518.530,00			% 100,000	105.046,30	0,23
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	48.357,56			% 100,000	27.115,38	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	379.607,65			% 100,000	349.659,33	0,78
Summe Bankguthaben							EUR	1.433.192,37	3,20
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	1.433.192,37	3,20
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	75.553,41				75.553,41	0,17
	Dividendenansprüche		EUR	25.462,22				25.462,22	0,06
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	1.029.867,39				1.029.867,39	2,28
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	114,62				114,62	0,00
	Forderungen aus Anteilschneidengeschäften		EUR	198,50				198,50	0,00
	Forderungen aus Quellensteuerrückstellungen		EUR	12.779,08				12.779,08	0,03
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.143.975,22	2,54
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-37,83				-37,83	0,00
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-36.466,06				-36.466,06	-0,08
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-500.000,00				-500.000,00	-1,11
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-536.503,89	-1,19
Fondsvermögen									
Umlaufende Anteile							EUR	44.845.320,51	100,00
Anteilwert							STK	450.927.000	
							EUR	99,45	

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

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27	EUR	200.000	164.990,00	
0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27	EUR	500.000	437.200,00	
7,2500 % Morgan Stanley MTN 02/32	USD	200.000	207.709,67	
0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33	EUR	400.000	288.782,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		1.098.681,67	1.098.681,67

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85894 = 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,44720 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,70165 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,80665 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,97665 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08565 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,43984 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	157,25000 = 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,50680 = 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,63958 = 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,78340 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24
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)
IFUS	New York/N.Y. - ICE Futures U.S.
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 (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
AUD				
AU000000ANZ3	ANZ Group Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	1.963	1.963
AU0000261372	ANZ Group Holdings Ltd. Reg.Shares Def.	STK	0	1.963
CAD				
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK	0	100
CA55027C1068	Lumine Group Inc. Reg.Shs (Sub.Vtg.)	STK	300	300
CA7751092007	Rogers Communications Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	0	2.200
CA0641491075	The Bank of Nova Scotia Reg.Shares	STK	0	2.100
CHF				
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien	STK	0	9.038
EUR				
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK	0	874
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam	STK	0	7.343
IT0003828271	Recordati Ind.Chim.Farm. SpA Azioni nom.	STK	1.720	1.720
FI0009005961	Stora Enso Oyj Reg.Shares Cl.R	STK	0	7.060
BE0003826436	Telenet Group Holding N.V. Actions Nom.	STK	0	1.366
FR0000127771	Vivendi SE Actions Porteur	STK	0	4.913
GBP				
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares	STK	0	32.570
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg.Shares	STK	0	15.873
JPY				
JP3112000009	AGC Inc. Reg.Shares	STK	0	1.500
JP3219000001	Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.700
JP3918000005	Meiji Holdings Co.Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.000
JP3695200000	NGK Insulators Ltd. Reg.Shares	STK	0	9.000
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Reg.Shares	STK	0	2.300
JP3402600005	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	3.700
JP3595200001	Tosoh Corp. Reg.Shares	STK	0	7.500
JP3939000000	Yamada Holdings Co. Ltd. Ltd. Reg.Shares	STK	0	12.900
SEK				
SE0000190126	Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria)	STK	0	150
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Akt. B (fria)	STK	0	8.404
USD				
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc. Reg.Shares	STK	0	786
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares	STK	0	7.739
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	1.587
US1720621010	Cincinnati Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	682
US1729674242	Citigroup Inc. Reg.Shares	STK	1.563	1.563
US23918K1088	DaVita Inc. Reg.Shares	STK	0	983
US37940X1028	Global Payments Inc. Reg.Shares	STK	0	581
US46266C1053	IQVIA Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	275
US81211K1007	Sealed Air Corp. Reg.Shares	STK	0	1.296
US82968B1035	Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	21.160

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US78467J1007	SS&C Technologies Holdings Reg.Shares	STK	0	1.264
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK	0	988
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	497
US9029733048	U.S. Bancorp Reg.Shares	STK	0	3.271
US9344231041	Warner Bros. Discovery Inc. Reg.Shares S.A	STK	0	1.872
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1346695437	2,1250 % alstria office REIT-AG Anl. 16/23	EUR	0	300.000
XS2196322155	0,1420 % Exxon Mobil Corp. Notes 20/24 Reg.S	EUR	0	200.000
DE000A13SJM6	0,8750 % Freistaat Thüringen Landessch. S.2014/02 14/24	EUR	0	1.000.000
XS1411535799	0,6500 % Johnson & Johnson Notes 16/24	EUR	0	200.000
DE000NRW0FU3	1,2500 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1325 14/25	EUR	0	500.000
XS1520733301	1,0000 % Sampo OYJ MTN 16/23	EUR	0	200.000
FR0011625433	2,5000 % Sanofi S.A. MTN 13/23	EUR	0	200.000
XS1054534422	2,5500 % Walmart Inc. Notes 14/26	EUR	0	200.000
USD				
US406216AY74	7,4500 % Halliburton Co. Notes 09/39	USD	0	200.000
US023551AJ38	7,3000 % Hess Corp. Notes 01/31	USD	0	200.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
BE6286963051	2,3750 % Barry Callebaut Services N.V. Notes 16/24	EUR	0	400.000
USD				
US09261HAH03	2,3500 % Blackstone Private Credit Fund Notes 21/24	USD	0	400.000
US26867LAL45	3,2500 % EMD Finance LLC Notes 15/25 144A	USD	200.000	200.000
US33834DAA28	2,8500 % Five Corners Funding Trust II Notes 20/30 144A 3C7	USD	0	200.000
US55336VAR15	4,0000 % MPLX L.P. Notes 18/28	USD	0	200.000
US682680AW38	4,3500 % Oneok Inc. (New) Notes 19/29	USD	0	200.000
US723787AQ06	1,9000 % Pioneer Natural Resources Co. Notes 20/30	USD	0	200.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	11.847
(Basiswert(e): ESTX Mid Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, MDAX Performance-Index, MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, Russell 2000 Index, S&P/ASX 200 Index, Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	15.049
(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/TSX 60 Index (Price) (CAD))		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	12.347
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Two-Year US Treasury Note Future (TU))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	6.863
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Schatz Future (FGBS), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY), US Treasury Long Bond Future (US))		
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	14.672
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index)		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	10.200
(Basiswert(e): S&P 500 Index)		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	671
CAD/EUR	EUR	537
CHF/EUR	EUR	602
DKK/EUR	EUR	269
GBP/EUR	EUR	709
JPY/EUR	EUR	321
SEK/EUR	EUR	219
USD/EUR	EUR	21.338
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	728
CAD/EUR	EUR	1.504
CHF/EUR	EUR	899
DKK/EUR	EUR	630
GBP/EUR	EUR	780
JPY/EUR	EUR	903
SEK/EUR	EUR	560

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. EUR	Volumen in 1.000 29.695
USD/EUR		
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	844
<small>(Basiswert(e): 0,2500 % HSBC Continental Europe S.A. MTN 19/24, 0,2500 % Wolters Kluwer N.V. Notes 21/28, 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26, 2,5000 % Amadeus IT Group S.A. MTN 20/24, Wienerberger AG Inhaber-Aktien)</small>		

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	450.927
Anteilwert	EUR	99,45

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
Verzinsliche Wertpapiere	1.098.681,67	2,45

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	1.098.681,67	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	1.098.681,67

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 Anleihenrating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR
unbefristet	1.676.278,01

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	697,59	100,00
Kostenanteil des Fonds	230,21	33,00
Ertragsanteil der KVG	230,21	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.

Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

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

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds
2,58% (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
Berlin Hyp AG	982.480,68
Bayerische Landesbank	693.797,33

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	1
Clearstream Banking Frankfurt	1.676.278,01 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.

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

Frankfurt am Main, den 3. Juli 2023
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 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,1 Mio.

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

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 2023

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



Deka Investment GmbH

Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
www.deka.de

