

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2023.

# **Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch**

Ein Investmentfonds gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom  
17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW).



**.Deka**  
Investments

# Bericht des Vorstands.

30. Juni 2023

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch 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.

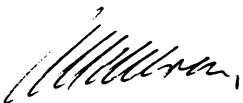
Das Gros der globalen Aktienbörsen startete mit Rückenwind in das Jahr 2023 und trotz erhöhter Anleiherenditen sowie zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren aus dem Bankensektor bestimmte eine Aufwärtsbewegung das Bild an den Aktienmärkten. Der Euro tendierte im Verhältnis zum US-Dollar seit dem Jahreswechsel 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](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 International S.A.  
Der Vorstand



Holger Hildebrandt



Eugen Lehnertz

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023	6
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 Dynamisch 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 wie Aktien und Anleihen an. Im Rahmen des Wertpapierauswahlprozesses werden neben wirtschaftlichen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien (Ökologie, Soziales und Governance) berücksichtigt.

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. 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.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

Performance*	6 Monate
Anteilklasse CF (A)	4,2%
Anteilklasse I (A)	4,4%

### ISIN

Anteilklasse CF (A)	LU0236907720
Anteilklasse I (A)	LU0236908371

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

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, der Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) und supranationaler Einrichtungen (bspw. KfW, EIB, ESM) investieren.

Die Verwaltungsgesellschaft hat auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>44.392.831,48</b>	<b>71,86</b>
<b>Aktien</b>								<b>39.475.718,28</b>	<b>63,88</b>
<b>EUR</b>								<b>5.738.291,54</b>	<b>9,29</b>
IT0001233417	AZA S.p.A. Azioni nom.	STK		66.721	0	0	EUR 1,678	111.924,48	0,18
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		6.820	0	1.951	EUR 31,275	213.295,50	0,35
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		947	0	228	EUR 213,850	202.515,95	0,33
AT0000730007	Andritz AG Inhaber-Aktien	STK		3.537	0	0	EUR 50,200	177.557,40	0,29
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		340	175	201	EUR 655,300	222.802,00	0,36
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		7.131	0	1.996	EUR 27,180	193.820,58	0,31
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		13.911	13.911	0	EUR 7,078	98.462,06	0,16
IE00BD1RP616	Bank of Ireland Group PLC Reg.Shares	STK		4.313	4.313	0	EUR 8,884	38.316,69	0,06
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien	STK		2.372	0	499	EUR 103,600	245.739,20	0,40
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK		3.500	0	1.014	EUR 57,850	202.475,00	0,33
DE000A1DAHH0	Brenntag SE Namens-Aktien	STK		1.572	1.572	0	EUR 70,820	111.329,04	0,18
FR0000125338	Capgemini SE Actions Port.	STK		836	0	0	EUR 171,650	143.499,40	0,23
NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam	STK		8.160	0	0	EUR 13,180	107.548,80	0,17
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur	STK		2.125	0	0	EUR 55,700	118.362,50	0,19
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		10.969	10.969	0	EUR 11,665	127.953,39	0,21
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK		1.485	0	0	EUR 96,100	142.708,50	0,23
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK		3.094	3.094	0	EUR 38,240	118.314,56	0,19
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien	STK		2.785	2.785	0	EUR 70,860	197.345,10	0,32
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK		5.473	0	1.488	EUR 37,095	203.020,94	0,33
FR0010259150	Ipsen S.A. Actions au Porteur	STK		982	0	0	EUR 110,500	108.511,00	0,18
IT0005211237	Italgas S.P.A. Azioni nom.	STK		15.903	0	0	EUR 5,445	86.591,84	0,14
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B	STK		6.803	0	0	EUR 17,255	117.385,77	0,19
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK		17.928	0	0	EUR 10,990	197.028,72	0,32
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK		2.643	0	705	EUR 73,720	194.841,96	0,32
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		1.092	0	740	EUR 149,650	163.417,80	0,26
FI0009000681	Nokia Oyj Reg.Shares	STK		22.800	0	0	EUR 3,867	88.156,20	0,14
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien	STK		2.567	0	1.137	EUR 38,970	100.035,99	0,16
IT0004176001	Prismian S.p.A. Azioni nom.	STK		2.456	2.456	0	EUR 37,680	92.542,08	0,15
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		2.832	0	990	EUR 74,300	210.417,60	0,34
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder	STK		2.942	0	1.092	EUR 48,440	142.510,48	0,23
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		6.712	0	0	EUR 15,410	103.431,92	0,17
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		2.480	0	543	EUR 98,050	243.164,00	0,39
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK		1.186	1.186	0	EUR 152,560	180.936,16	0,29
NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen op naam	STK		9.844	0	3.389	EUR 16,160	159.079,04	0,26
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder	STK		2.113	2.113	0	EUR 45,130	95.359,69	0,15
FR0000121204	Wendel SE Actions Port.	STK		1.109	629	0	EUR 93,300	103.469,70	0,17
AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien	STK		5.111	5.111	0	EUR 27,900	142.596,90	0,23
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		2.008	0	597	EUR 115,450	231.823,60	0,38
<b>AUD</b>								<b>183.129,86</b>	<b>0,30</b>
AU000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK		14.611	0	0	AUD 20,550	183.129,86	0,30
<b>CAD</b>								<b>1.734.635,11</b>	<b>2,80</b>
CA11284V1058	Brookfield Renewable Corp. Reg.Shs Cl.A Sub.Vot.	STK		6.700	4.200	0	CAD 41,370	192.506,81	0,31
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK		2.500	0	500	CAD 137,570	238.863,35	0,39
CA3759161035	Gildan Activewear Inc. Reg.Shares (Sub.Vtg)	STK		4.600	0	0	CAD 42,170	134.724,69	0,22
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares	STK		2.100	0	800	CAD 119,240	173.910,99	0,28
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK		8.800	0	0	CAD 24,730	151.144,57	0,24
CA6665111002	Northland Power Inc. Reg.Shares	STK		5.000	0	0	CAD 27,250	94.628,57	0,15
CA67077M1086	Nutrien Ltd Reg.Shares	STK		2.200	0	0	CAD 78,090	119.317,42	0,19
CA6837151068	Open Text Corp. Reg.Shares	STK		2.900	0	0	CAD 54,010	108.782,23	0,18
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)	STK		3.200	0	5.600	CAD 31,750	70.563,40	0,11
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK		2.600	0	0	CAD 68,200	123.152,57	0,20
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK		1.600	0	0	CAD 81,460	90.521,17	0,15
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK		1.200	0	0	CAD 106,490	88.751,53	0,14
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK		1.900	0	0	CAD 111,980	147.767,81	0,24
<b>CHF</b>								<b>359.566,19</b>	<b>0,57</b>
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK		1.364	0	0	CHF 107,780	150.526,72	0,24
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		1.366	1.366	4.211	CHF 89,850	125.669,48	0,20
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK		191	0	133	CHF 426,300	83.369,99	0,13
<b>DKK</b>								<b>594.914,60</b>	<b>0,96</b>
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK		93	0	0	DKK 12.050,000	150.479,37	0,24
DK0010181759	Carlsberg AS Navne-Aktier B	STK		1.108	0	0	DKK 1.089,000	162.022,24	0,26
DK00060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		1.942	0	722	DKK 1.083,000	282.412,99	0,46
<b>GBP</b>								<b>1.463.608,96</b>	<b>2,38</b>
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares	STK		918	918	0	GBP 113,000	120.770,49	0,20
GB0031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares	STK		7.039	2.472	0	GBP 21,230	173.980,53	0,28
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien	STK		5.711	0	0	GBP 23,240	154.521,17	0,25
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares	STK		13.005	0	0	GBP 13,950	211.214,76	0,34

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC Reg.Shares	STK		19.911	0	0	GBP 6,444	149.378,57	0,24
GB000606QFB75	IG Group Holdings PLC Reg.Shares	STK		12.635	12.635	0	GBP 6,760	99.440,12	0,16
GB00BLDRH360	OSB GROUP PLC Reg.Shares	STK		9.776	9.776	0	GBP 4,810	54.745,19	0,09
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares	STK		1.485	1.485	0	GBP 58,980	101.969,65	0,17
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC Reg.Shares	STK		6.763	6.763	0	GBP 16,400	129.128,75	0,21
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK		4.747	1.450	1.254	GBP 40,965	226.397,64	0,37
GB00BD6GN030	Virgin Money UK PLC Reg.Shares	STK		24.223	24.223	0	GBP 1,492	42.062,09	0,07
<b>HKD</b>								<b>65.205,25</b>	<b>0,11</b>
HK0000063609	Swire Properties Ltd. Reg.Shares	STK		28.800	28.800	0	HKD 19,260	65.205,25	0,11
<b>JPY</b>								<b>1.698.521,47</b>	<b>2,74</b>
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares	STK		9.500	0	0	JPY 2.149,000	129.828,30	0,21
JP3486800000	Daito Trust Constr. Co. Ltd. Reg.Shares	STK		1.500	0	0	JPY 14.585,000	139.125,60	0,23
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Reg.Shares	STK		900	900	0	JPY 18.595,000	106.426,07	0,17
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Reg.Shares	STK		4.200	4.200	0	JPY 4.028,000	107.584,10	0,17
JP3004200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares	STK		4.100	4.100	0	JPY 3.881,000	101.189,83	0,16
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares	STK		45.000	43.200	5.200	JPY 170,500	48.791,73	0,08
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares	STK		5.300	0	0	JPY 2.606,000	87.833,39	0,14
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares	STK		11.200	0	3.600	JPY 2.612,500	186.073,13	0,30
JP3326000001	Sankyu Inc. Reg.Shares	STK		3.500	0	0	JPY 4.748,000	105.678,86	0,17
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK		4.100	4.100	0	JPY 4.768,000	124.316,69	0,20
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares	STK		2.900	0	0	JPY 6.459,000	119.116,69	0,19
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares	STK		8.100	0	0	JPY 3.315,000	170.756,76	0,28
JP3659000008	West Japan Railway Co. Reg.Shares	STK		2.800	2.800	0	JPY 5.990,000	106.658,19	0,17
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK		6.300	0	0	JPY 4.122,000	165.142,13	0,27
<b>NZD</b>								<b>48.265,67</b>	<b>0,08</b>
NZTELE000154	Spark New Zealand Ltd. Reg.Shares	STK		16.911	0	0	NZD 5,090	48.265,67	0,08
<b>SEK</b>								<b>568.868,27</b>	<b>0,93</b>
SE0017486897	Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria)	STK		12.960	0	7.564	SEK 134,100	147.199,76	0,24
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK		16.460	6.824	0	SEK 117,600	163.949,64	0,27
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria)	STK		6.569	0	0	SEK 119,450	66.459,75	0,11
SE0000114837	Trelleborg AB Namn-Aktier B (fria)	STK		8.305	0	0	SEK 271,900	191.259,12	0,31
<b>USD</b>								<b>27.020.711,36</b>	<b>43,72</b>
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares	STK		2.696	0	520	USD 107,660	267.352,61	0,43
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares	STK		753	0	1.201	USD 133,230	92.407,49	0,15
IE0084BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A	STK		759	0	217	USD 308,330	215.559,78	0,35
US00507V1098	Activision Blizzard Inc. Reg.Shares	STK		2.112	0	0	USD 83,080	161.622,03	0,26
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares	STK		784	238	0	USD 483,770	349.353,55	0,57
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares	STK		2.801	0	0	USD 69,120	178.331,06	0,29
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK		1.357	0	0	USD 118,050	147.555,70	0,24
US00971T1016	Akamai Technologies Inc. Reg.Shares	STK		2.265	0	0	USD 89,190	186.077,79	0,30
IE00BFR3W74	Allegation PLC Reg.Shares	STK		1.547	0	0	USD 119,580	170.395,86	0,28
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C	STK		3.589	732	4.023	USD 120,010	396.735,49	0,64
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		3.033	0	1.987	USD 119,100	332.731,82	0,54
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares	STK		4.965	1.037	2.772	USD 127,900	584.924,70	0,95
US0311001004	AMETEK Inc. Reg.Shares	STK		861	861	0	USD 160,140	127.002,75	0,21
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK		1.179	0	284	USD 221,160	240.176,52	0,39
US0326541051	Analog Devices Inc. Reg.Shares	STK		1.107	0	0	USD 189,480	193.206,25	0,31
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares	STK		11.687	916	5.356	USD 189,590	2.040.932,46	3,31
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares	STK		1.174	0	0	USD 216,460	234.075,48	0,38
US0533321024	AutoZone Inc. Reg.Shares	STK		85	0	22	USD 2.455,400	192.243,36	0,31
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares	STK		6.398	0	0	USD 28,660	168.900,36	0,27
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares	STK		767	0	442	USD 260,520	184.054,57	0,30
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares	STK		2.437	0	789	USD 83,210	186.784,66	0,30
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares	STK		844	844	0	USD 282,130	219.331,94	0,35
US0936711052	Block H. & R. Inc. Reg.Shares	STK		2.529	0	0	USD 32,020	74.589,95	0,12
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares	STK		4.359	0	795	USD 64,000	256.966,79	0,42
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares	STK		464	154	111	USD 862,570	368.657,01	0,60
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)	STK		1.304	0	0	USD 94,280	113.241,95	0,18
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares	STK		917	0	494	USD 228,540	193.037,52	0,31
US14448C1045	Carrier Global Corp. Reg.Shares	STK		2.992	2.992	0	USD 49,490	136.392,10	0,22
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares	STK		999	0	0	USD 244,240	224.746,24	0,36
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares	STK		914	0	0	USD 135,740	114.278,41	0,18
IL0010824113	Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares	STK		1.820	0	0	USD 127,940	214.480,54	0,35
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares	STK		7.295	1.935	1.461	USD 51,210	344.104,41	0,56
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC Reg.Shares	STK		2.385	2.385	0	USD 63,810	140.180,40	0,23
US1924461023	Cognizant Technology Sol. Corp. Reg.Shs Cl.A	STK		3.350	0	0	USD 64,540	199.151,66	0,32
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares	STK		540	0	0	USD 76,560	38.080,78	0,06
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A	STK		4.913	0	4.164	USD 41,470	187.668,32	0,30
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares	STK		467	467	0	USD 242,000	104.098,01	0,17
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares	STK		2.162	829	0	USD 68,760	136.930,98	0,22
US2358511028	Danaher Corp. Reg.Shares	STK		408	0	0	USD 237,770	89.356,75	0,14
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares	STK		743	0	0	USD 165,300	113.128,45	0,18
US2441991054	Deere & Co. Reg.Shares	STK		632	0	151	USD 401,630	233.804,78	0,38
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares	STK		990	0	1.098	USD 117,900	107.512,55	0,17
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares	STK		2.146	0	2.452	USD 53,240	105.239,29	0,17



# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		10.430	0	0	USD 26,720	256.702,99	0,42
US23355L1061	DXC Technology Co. Reg.Shares	STK		3.859	0	0	USD 26,230	93.235,91	0,15
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares	STK		586	0	131	USD 440,100	237.552,25	0,38
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares	STK		219	219	0	USD 464,490	93.698,07	0,15
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares	STK		1.833	525	0	USD 120,140	202.843,11	0,33
US3032501047	Fair Isaac Corp. Reg.Shares	STK		238	0	0	USD 796,540	174.620,29	0,28
US3377381088	Fiserv Inc. Reg.Shares	STK		1.259	1.259	0	USD 124,050	143.857,55	0,23
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares	STK		617	0	0	USD 342,540	194.673,40	0,32
US6687711084	Gen Digital Inc. Reg.Shares	STK		6.624	0	0	USD 18,430	112.449,06	0,18
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares	STK		2.543	3.150	607	USD 76,300	178.723,25	0,29
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares	STK		3.581	0	942	USD 76,010	250.717,83	0,41
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares	STK		595	0	382	USD 300,440	164.658,78	0,27
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares	STK		2.464	0	0	USD 80,900	183.611,29	0,30
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares	STK		14.648	0	0	USD 16,650	224.648,09	0,36
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares	STK		2.818	0	650	USD 80,070	207.836,10	0,34
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares	STK		3.843	0	4.369	USD 30,320	107.327,19	0,17
US4648591028	Humana Inc. Reg.Shares	STK		427	427	0	USD 143,860	315.489,80	0,28
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares	STK		10.218	0	0	USD 32,910	309.744,74	0,50
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares	STK		3.604	0	0	USD 38,090	126.446,24	0,20
US4262811015	Jack Henry & Associates Inc. Reg.Shares	STK		1.250	0	0	USD 166,480	191.682,40	0,31
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares	STK		2.932	0	770	USD 164,100	443.182,61	0,72
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares	STK		2.388	0	484	USD 143,430	315.489,19	0,51
US4878361082	Kellogg Co. Reg.Shares	STK		1.483	0	1.218	USD 66,820	91.276,25	0,15
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares	STK		1.328	0	0	USD 165,340	202.248,90	0,33
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares	STK		836	0	0	USD 240,480	185.180,56	0,30
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares	STK		630	0	0	USD 322,990	187.430,30	0,30
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares	STK		1.347	0	380	USD 222,820	276.459,76	0,45
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A	STK		1.756	0	641	USD 90,660	146.639,30	0,24
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares	STK		1.390	0	342	USD 185,930	238.053,42	0,39
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares	STK		4.134	0	0	USD 57,340	192.342,52	0,35
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A	STK		645	0	135	USD 387,670	230.320,22	0,37
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares	STK		550	0	0	USD 294,470	149.181,14	0,24
US58155Q1031	Mckesson Corp. Reg.Shares	STK		456	383	0	USD 420,880	176.780,07	0,29
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK		3.736	0	1.334	USD 113,540	390.720,25	0,63
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK		147	0	0	USD 1.316,880	178.309,18	0,29
US5950171042	Microchip Technology Inc. Reg.Shares	STK		2.391	0	0	USD 86,980	191.561,90	0,31
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK		5.259	0	1.992	USD 335,050	1.623.016,58	2,63
US60770K1079	Moderna Inc. Reg.Shares	STK		615	615	0	USD 122,110	69.172,98	0,11
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares	STK		760	0	0	USD 294,770	206.351,22	0,33
US6703461052	Nucor Corp. Reg.Shares	STK		879	879	0	USD 163,330	132.240,66	0,21
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares	STK		1.039	143	309	USD 408,220	390.678,93	0,63
US6819191064	Omnicom Group Inc. Reg.Shares	STK		2.259	0	0	USD 94,130	195.863,92	0,32
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares	STK		2.327	0	0	USD 130,720	280.187,39	0,45
US6951561090	Packaging Corp. of America Reg.Shares	STK		384	0	0	USD 131,860	46.639,56	0,08
US7010941042	Parker-Hannifin Corp. Reg.Shares	STK		702	0	168	USD 386,750	250.079,22	0,40
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares	STK		826	0	0	USD 109,330	83.182,04	0,13
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK		5.392	0	1.317	USD 36,120	179.393,95	0,29
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares	STK		2.418	0	0	USD 77,320	172.209,98	0,28
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares	STK		1.663	0	0	USD 118,060	180.844,45	0,29
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares	STK		1.809	0	0	USD 141,140	235.179,16	0,38
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK		182	0	0	USD 708,420	118.760,60	0,19
US7595091023	Reliance Steel & Alumin. Co. Reg.Shares	STK		411	411	0	USD 270,810	102.521,91	0,17
US7703231032	Robert Half International Inc. Reg.Shares	STK		2.360	0	0	USD 74,070	161.014,32	0,26
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares	STK		775	0	0	USD 286,960	204.848,71	0,33
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares	STK		1.404	0	0	USD 34,070	44.060,50	0,07
US8716071076	Synopsys Inc. Reg.Shares	STK		521	0	251	USD 427,900	205.347,86	0,33
US8760301072	Tapestry Inc. Reg.Shares	STK		5.586	0	0	USD 42,830	220.373,40	0,36
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares	STK		336	0	0	USD 257,500	79.694,19	0,13
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK		1.605	0	339	USD 176,790	261.362,27	0,42
US1255231003	The Cigna Group Reg.Shares	STK		789	0	0	USD 277,250	201.492,42	0,33
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares	STK		2.626	0	0	USD 60,020	145.178,02	0,23
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK		1.110	733	212	USD 307,820	314.724,08	0,51
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares	STK		3.611	0	0	USD 46,320	154.065,79	0,25
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK		1.645	0	0	USD 149,380	226.343,76	0,37
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares	STK		370	0	386	USD 514,390	175.309,08	0,28
US9026811052	UGI Corp. Reg.Shares	STK		2.413	0	0	USD 26,850	59.677,66	0,10
US90384S3031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares	STK		519	0	124	USD 465,280	222.429,25	0,36
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B	STK		1.328	0	322	USD 176,050	215.349,70	0,35
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares	STK		923	656	254	USD 476,440	405.060,67	0,66
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares	STK		6.343	0	1.420	USD 36,990	216.117,14	0,35
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK		844	0	188	USD 348,180	270.680,16	0,44
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		1.041	0	262	USD 234,320	224.683,02	0,36
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares	STK		354	354	0	USD 782,300	255.086,08	0,41
US94106L1098	Waste Management Inc. Reg.Shares	STK		934	0	0	USD 169,610	145.917,87	0,24
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares	STK		649	0	0	USD 261,950	156.593,33	0,25
US9598021098	Western Union Co. Reg.Shares	STK		12.464	0	0	USD 11,620	133.405,50	0,22

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
IE00BDB6Q211	Willis Towers Watson PLC Reg.Shares		STK	1.016	0	0	USD 232,550	217.630,73	0,35
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	1.754	0	540	USD 137,260	221.760,27	0,36
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>4.839.342,04</b>	<b>7,85</b>
<b>EUR</b>								<b>3.494.643,00</b>	<b>5,67</b>
FR0011509488	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 13/28		EUR	300.000	300.000	0	% 97,050	291.150,00	0,47
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 20/30		EUR	200.000	0	0	% 93,720	187.440,00	0,30
XS2444286145	1,3750 % Alfa Laval Treasury Intl. AB MTN 22/29		EUR	300.000	300.000	0	% 86,055	258.165,00	0,42
XS1205616698	2,0000 % APA Infrastructure Ltd. MTN 15/27		EUR	300.000	300.000	0	% 91,802	275.406,00	0,45
XS2049584084	0,3750 % BAWAG P.S.K. Non-Preferred MTN 19/27		EUR	200.000	0	0	% 82,495	164.990,00	0,27
XS2481288525	2,7500 % Coloplast Finance B.V. MTN 22/30		EUR	400.000	400.000	0	% 93,354	373.414,00	0,60
XS2528582377	3,0000 % Compass Group Fin. Netherl. BV MTN 22/30		EUR	400.000	400.000	0	% 95,330	381.320,00	0,62
BE0002432079	3,2500 % Elia Transm. Belgium S.A./N.V. Bonds 13/28		EUR	200.000	0	0	% 98,653	197.306,00	0,32
XS1799641045	4,1250 % LKQ European Holdings B.V. Notes 18/28 Reg.S		EUR	400.000	400.000	0	% 98,100	392.400,00	0,64
FR0013425147	1,2500 % MMS USA Investments Inc. Notes 19/28		EUR	200.000	0	0	% 87,950	175.900,00	0,28
XS1603892149	1,8750 % Morgan Stanley MTN S.J 17/27		EUR	200.000	0	0	% 91,761	183.521,00	0,30
XS2472603740	2,1250 % Royal Bank of Canada MTN 22/29		EUR	300.000	300.000	0	% 89,969	269.907,00	0,44
XS2190256706	0,7500 % Snam S.p.A. MTN 20/30		EUR	200.000	0	0	% 80,207	160.413,00	0,26
XS1875284702	1,3750 % SSE PLC MTN 18/27		EUR	200.000	0	0	% 91,656	183.311,00	0,30
<b>USD</b>								<b>1.344.699,04</b>	<b>2,18</b>
US035240AQ30	4,7500 % Anheuser-Busch InBev Ww Inc. Notes 19/29		USD	200.000	0	0	% 99,080	182.525,68	0,30
US25156PAC77	8,7500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. Notes 00/30		USD	200.000	0	0	% 119,045	219.306,41	0,35
US35805BAA61	3,7500 % Fresenius Med.C.US F.III Inc. Notes 19/29 144A		USD	200.000	0	0	% 87,922	161.971,17	0,26
US44962LAJ61	4,2500 % IHS Markit Ltd. Notes 19/29		USD	200.000	0	0	% 94,434	173.966,75	0,28
US521865AY17	3,8000 % Lear Corp. Notes 17/27		USD	200.000	0	0	% 92,719	170.807,53	0,28
US60871RAD26	5,0000 % Molson Coors Beverage Co. Notes 12/42		USD	200.000	0	0	% 92,370	170.165,34	0,28
US681936BH22	5,2500 % Omega Healthcare Invest. Inc. Notes 15/26		USD	300.000	0	0	% 96,245	265.956,16	0,43
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>								<b>77.771,16</b>	<b>0,13</b>
<b>CHF</b>								<b>77.771,16</b>	<b>0,13</b>
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	276	0	375	CHF 275,200	77.771,16	0,13
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>3.516.829,14</b>	<b>5,67</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>3.516.829,14</b>	<b>5,67</b>
<b>EUR</b>								<b>1.215.747,40</b>	<b>1,96</b>
XS2598332133	4,2500 % Autoliv Inc. MTN 23/28		EUR	300.000	300.000	0	% 99,065	297.195,00	0,48
XS2521013909	3,6250 % Chorus Ltd. MTN 22/29		EUR	300.000	300.000	0	% 97,305	291.915,00	0,47
XS1240751229	2,1250 % Eli Lilly and Company Notes 15/30 <sup>1)</sup>		EUR	400.000	400.000	0	% 91,571	366.282,40	0,59
XS2068065163	1,2500 % Informa PLC MTN 19/28		EUR	300.000	300.000	0	% 86,785	260.355,00	0,42
<b>USD</b>								<b>2.301.081,74</b>	<b>3,71</b>
US09857LAR96	4,6250 % Booking Holdings Inc. Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 97,391	179.414,18	0,29
US20030NAC56	7,0500 % Comcast Corp. Notes 03/33		USD	200.000	0	0	% 114,776	211.441,99	0,34
US22822VAR24	3,3000 % Crown Castle Inc. Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 88,040	162.188,00	0,26
US30212PAP09	3,8000 % Expedia Group Inc. Notes 17/28		USD	300.000	0	0	% 93,265	257.721,18	0,42
US412822AE80	4,6250 % Harley-Davidson Inc. Notes 15/45		USD	200.000	0	0	% 75,521	139.124,95	0,23
US404119BX69	4,1250 % HCA Inc. Notes 19/29		USD	200.000	0	0	% 92,092	169.653,20	0,27
US595112BQ52	4,6630 % Micron Technology Inc. Notes 19/30		USD	200.000	0	0	% 94,230	173.591,86	0,28
US62954HAY45	3,4000 % NXP B.V./NXP Fd. LLC/NXP USA Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 88,267	162.607,65	0,26
US785592AX43	4,5000 % Sabine Pass Liquefaction LLC Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 94,786	174.616,13	0,28
US858119BK53	3,4500 % Steel Dynamics Inc. Notes 19/30		USD	200.000	0	0	% 88,705	163.413,62	0,26
US860630AG72	4,0000 % Stifel Financial Corp. Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 85,695	157.868,56	0,26
US87264ABF12	3,8750 % T-Mobile USA Inc. Notes 20/30		USD	200.000	0	0	% 91,645	168.829,73	0,27
US963320AW61	4,7500 % Whirlpool Corp. Notes 19/29		USD	200.000	0	0	% 98,040	180.610,69	0,29



# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>9.898.854,47</b>	<b>16,04</b>	
<b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>683.058,86</b>	<b>1,10</b>	
<b>EUR</b>								<b>683.058,86</b>	<b>1,10</b>	
LU1685588219	Deka-MultiFactor Gl. Corp. FCP Inhaber-Anteile I		ANT	1.389	0	0	EUR 81,960	113.842,44	0,18	
LU1685587591	Deka-MultiFactor Gl.Cor.HY FCP Inhaber-Anteile I		ANT	6.913	0	0	EUR 82,340	569.216,42	0,92	
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>854.154,00</b>	<b>1,38</b>	
<b>EUR</b>								<b>854.154,00</b>	<b>1,38</b>	
DE0005424568	Deka-Vega Plus Inhaber-Anteile I (A)		ANT	12.600	0	0	EUR 67,790	854.154,00	1,38	
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>8.361.641,61</b>	<b>13,56</b>	
<b>EUR</b>								<b>1.980.720,00</b>	<b>3,22</b>	
IE00BKLC5874	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	458.500	473.600	174.600	EUR 4,320	1.980.720,00	3,22	
<b>USD</b>								<b>6.380.921,61</b>	<b>10,34</b>	
IE00BKFO9C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	500.500	706.700	371.200	USD 4,375	2.016.982,96	3,27	
LU1974695790	UBS LFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE Act. Nom.A-acc.		ANT	383.000	517.500	254.300	USD 12,370	4.363.938,65	7,07	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>57.808.515,09</b>	<b>93,57</b>
<b>Derivate</b>										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
								<b>-171.455,94</b>	<b>-0,29</b>	
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) Sep. 23		XIOM	USD	Anzahl 4				13.775,56	0,02	
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) Sep. 23		XCME	USD	Anzahl 9				1.222,77	0,00	
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 23		XCME	USD	Anzahl -48				-106.276,34	-0,17	
ESTX Mid Index Future (FMCE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl 22				-1.870,00	0,00	
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 23		IFEU	GBP	Anzahl 6				-3.446,64	-0,01	
MDAX Mini Future (FSMX) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl 21				2.373,55	0,00	
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) Sep. 23		IFUS	USD	Anzahl 157				-106.080,04	-0,17	
MSCI World Index Future (FMWO) Sep. 23		XEUR	USD	Anzahl -37				-11.757,93	-0,02	
OMX Index Future (O30) Juli 23		XNDX	SEK	Anzahl -9				1.353,05	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 -1				-362,44	0,00	
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 23		XSFE	AUD	Anzahl 5				3.964,43	0,01	
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 23		XEUR	CHF	Anzahl 9				-3.225,31	-0,01	
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 23		XOSE	JPY	Anzahl 10				37.519,87	0,06	
<b>Optionsrechte**)</b>								<b>59.245,61</b>	<b>0,10</b>	
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>								<b>59.245,61</b>	<b>0,10</b>	
Nasdaq-100 Index (N100) Call Aug. 23 15200		XCBO		Anzahl 2			USD 321,600	59.245,61	0,10	
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>-112.210,33</b>	<b>-0,19</b>
<b>Zins-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Zinsterminkontrakte</b>										
								<b>-64.323,18</b>	<b>-0,10</b>	
10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 23		XEUR	EUR	1.300.000				-19.780,00	-0,03	
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 23		XEUR	EUR	-2.800.000				55.830,00	0,09	
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 23		XEUR	EUR	1.000.000				-23.360,00	-0,04	
EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 23		XEUR	EUR	1.400.000				-14.140,00	-0,02	
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 23		XEUR	EUR	1.300.000				-130,00	0,00	
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 23		XCBT	USD	100.000				-1.647,92	0,00	
Long Gilt Future (FLG) Sep. 23		IFEU	GBP	800.000				-5.029,48	-0,01	
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 23		XEUR	EUR	2.100.000				-36.960,00	-0,06	
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 23		XCBT	USD	-900.000				14.701,74	0,02	
Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 23		XCBT	USD	2.400.000				-27.201,46	-0,04	
Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) Sep. 23		XCBT	USD	600.000				-7.340,07	-0,01	
US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 23		XCBT	USD	-300.000				734,01	0,00	
<b>Summe der Zins-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>-64.323,18</b>	<b>-0,10</b>
<b>Devisen-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>										
								<b>-39.353,62</b>	<b>-0,07</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
AUD/EUR 590.000,00		OTC						-3.695,76	-0,01	
CHF/EUR 750.000,00		OTC						-3.094,13	-0,01	
GBP/EUR 200.000,00		OTC						990,63	0,00	
JPY/EUR 104.000.000,00		OTC						-33.554,36	-0,05	
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>180.365,63</b>	<b>0,29</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
CAD/EUR 800.000,00		OTC						558,09	0,00	
SEK/EUR 4.600.000,00		OTC						5.979,38	0,01	
USD/EUR 17.900.000,00		OTC						173.828,16	0,28	
<b>Summe der Devisen-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>141.012,01</b>	<b>0,22</b>

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Swaps</b>									
<b>Inflation Swaps (IFS)</b>									
<b>Protection Seller</b>									
	IFS Euro HICP Ex-Tobacco EUR / 1,6125% EUR / BNP_PAR 03.08.2028	OTC	STK	1.800.000				282.681,09 282.681,09	0,46 0,46
<b>Summe der Swaps</b>							<b>EUR</b>	<b>282.681,09</b>	<b>0,46</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.121.925,51			% 100,000	1.121.925,51	1,81
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	5.365,59			% 100,000	5.365,59	0,01
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	1.055.270,80			% 100,000	141.700,34	0,23
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	21.269,82			% 100,000	1.817,68	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	2.249.207,82			% 100,000	190.503,47	0,31
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	102.281,88			% 100,000	62.382,98	0,10
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	153.251,38			% 100,000	106.436,40	0,17
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	177.494,05			% 100,000	181.737,62	0,29
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	129.874,91			% 100,000	151.204,58	0,24
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	37.349,97			% 100,000	4.390,60	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	61.617.410,00			% 100,000	391.843,62	0,63
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	16.188,53			% 100,000	9.077,34	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	218.482,61			% 100,000	201.245,90	0,33
<b>Summe der Bankguthaben<sup>2)</sup></b>							<b>EUR</b>	<b>2.569.631,63</b>	<b>4,14</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>2.569.631,63</b>	<b>4,14</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Zinsansprüche		EUR	85.919,64				85.919,64	0,14
	Dividendenansprüche		EUR	41.457,75				41.457,75	0,07
	Einschüsse (Initial Margins)		AUD	75.000,00				45.743,42	0,07
	Einschüsse (Initial Margins)		CAD	14.100,00				9.792,75	0,02
	Einschüsse (Initial Margins)		DKK	171.999,99				23.095,93	0,04
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	285.836,60				285.836,60	0,46
	Einschüsse (Initial Margins)		GBP	60.000,00				69.853,95	0,11
	Einschüsse (Initial Margins)		JPY	8.000.000,00				50.874,40	0,08
	Einschüsse (Initial Margins)		SEK	256.500,00				21.725,04	0,04
	Einschüsse (Initial Margins)		USD	1.300.350,00				1.197.761,71	1,94
	Forderungen aus Anteilschneingeschäften		EUR	186,09				186,09	0,00
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	24,29				24,29	0,00
<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>1.832.271,57</b>	<b>2,97</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verwaltungsvergütung		EUR	-53.266,64				-53.266,64	-0,09
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-8,01				-8,01	0,00
	Kostenpauschale		EUR	-9.157,43				-9.157,43	-0,01
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-600.000,00				-600.000,00	-0,97
	Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-201,41				-201,41	0,00
<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-662.633,49</b>	<b>-1,07</b>
<b>Fondsvermögen</b>									
<b>Umlaufende Anteile Klasse CF (A)</b>							<b>EUR</b>	<b>61.794.944,39</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile Klasse I (A)</b>							<b>STK</b>	<b>742.914,000</b>	
<b>Anteilwert Klasse CF (A)</b>							<b>STK</b>	<b>242.427,000</b>	
<b>Anteilwert Klasse I (A)</b>							<b>EUR</b>	<b>62,21</b>	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>							<b>EUR</b>	<b>64,25</b>	
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>93,57</b>
									<b>0,39</b>

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

\*\*) Bei Future-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung durch tägliche Ausgleichszahlungen (Variation Margin); bei Stock-Styled Optionsrechten erfolgt die Prämienverrechnung bei Geschäftsabschluss. Stock-Styled Optionsrechte fließen mit ihrem Kurswert in das Sondervermögen ein, Future-Styled Optionsrechte mit ihrem unrealisierten Ergebnis.

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

<sup>2)</sup> In dieser Position enthalten sind die für sonstige Derivate hinterlegten Sicherheiten.

## Gesamtbetrag der bei Derivaten hinterlegten Sicherheiten

### Euro-Guthaben von:

BNP Paribas S.A.  
J.P. Morgan SE

260.000,00  
340.000,00

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

## Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen

Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
2,1250 % Eli Lilly and Company Notes 15/30	EUR 100.000		91.570,60	
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>			<b>91.570,60</b>	<b>91.570,60</b>

## Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen empfangenen Sicherheiten:

Aktien und aktienähnliche Wertpapiere 478.440,00 EUR

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

In-/ ausländische Aktien, Renten, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 29./30.06.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 30.06.2023

## 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

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 30.06.2023 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Devisentermingeschäfte (Kauf)	AUD/EUR	0,6 Mio.	EUR	359.294,49
	CHF/EUR	0,8 Mio.	EUR	770.985,95
	GBP/EUR	0,2 Mio.	EUR	232.058,38
	JPY/EUR	104,0 Mio.	EUR	666.608,36
			<b>EUR</b>	<b>2.028.947,18</b>
Devisentermingeschäfte (Verkauf)	CAD/EUR	0,8 Mio.	EUR	554.235,01
	SEK/EUR	4,6 Mio.	EUR	389.573,67
	USD/EUR	17,9 Mio.	EUR	16.429.826,36
			<b>EUR</b>	<b>17.373.635,04</b>
Finanztermingeschäfte	- gekaufte Terminkontrakte auf Indices		<b>EUR</b>	<b>13.731.687,06</b>
	- verkaufte Terminkontrakte auf Indices		<b>EUR</b>	<b>12.466.759,85</b>
	- gekaufte Terminkontrakte auf Renten		<b>EUR</b>	<b>13.486.701,08</b>
	- verkaufte Terminkontrakte auf Renten		<b>EUR</b>	<b>4.513.522,55</b>

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

## 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	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
	91.570,60	0,15

### 10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	91.570,60	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	absolute Beträge in EUR
unbefristet	91.570,60

### 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.

Von den Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten sowie ggf. nach Restlaufzeit variieren. Die Haircuts fallen für die aufgeführten Wertpapierkategorien wie folgt aus:

- Bankguthaben 0%
- Aktien 5% - 40%
- Renten 0,5% - 30%

Darüber hinaus kann für Sicherheiten in einer anderen Währung als der Fondswährung ein zusätzlicher Wertabschlag von bis zu 10%-Punkten angewandt werden. In besonderen Marktsituationen (z.B. Marktturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

### 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 Wertpapierleihengeschäfte 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 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

### Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
unbefristet	478.440,00

### Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	588,40	100,00
Kostenanteil des Fonds	194,16	33,00
Ertragsanteil der KVG	194,16	33,00

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihengeschäften gerechnet.

Der Ertragsanteil der KVG entspricht maximal dem Kostenanteil des Fonds. Der Kostenanteil der KVG ist auf Ebene des Sondervermögens im Einzelnen nicht bestimmbar.

Geschäftsbedingt gibt es bei Principalgeschäften keine expliziten Kosten durch Dritte. Sofern diese Geschäfte getätigt werden, sind Ertrags- und Kostenanteile Dritter über die in den Wertpapierleihesätzen enthaltenen Margen abgedeckt und damit bereits im Ertragsanteil des Fonds berücksichtigt. Bei Agencygeschäften werden Erträge und Kosten Dritter über eine Gebührenaufteilung (Fee split) definiert. Hier beträgt der Ertragsanteil des Agenten zwischen 20% und 35% vom Bruttoleihesatz.

Kosten Dritter als Agent der KVG werden nicht auf Ebene des Sondervermögens offengelegt.

### 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.

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

0,16% (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
RWE AG	478.440,00

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

## 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 478.440,00 EUR

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.

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>AUD</b>				
AU000000ANZ3	ANZ Group Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	5.058	5.058
AU0000261372	ANZ Group Holdings Ltd. Reg.Shares Def.	STK	0	5.058
AU000000MGR9	Mirvac Group Reg.Stapled Units	STK	0	93.610
<b>CAD</b>				
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	3.000
CA0641491075	The Bank of Nova Scotia Reg.Shares	STK	0	3.000
<b>CHF</b>				
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien	STK	0	12.972
<b>EUR</b>				
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK	0	1.399
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam	STK	0	11.794
IT0003828271	Recordati Ind.Chim.Farm. SpA Azioni nom.	STK	2.640	2.640
FI0009005961	Stora Enso Oyj Reg.Shares Cl.R	STK	0	11.270
BE0003826436	Telenet Group Holding N.V. Actions Nom.	STK	0	1.887
FR0000127771	Vivendi SE Actions Porteur	STK	0	7.760
<b>GBP</b>				
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares	STK	0	44.274
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg.Shares	STK	0	22.961
<b>JPY</b>				
JP3112000009	AGC Inc. Reg.Shares	STK	0	2.500
JP3219000001	Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	11.200
JP3918000005	Meiji Holdings Co.Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.400
JP3695200000	NGK Insulators Ltd. Reg.Shares	STK	0	14.300
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Reg.Shares	STK	0	3.700
JP3402600005	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	5.900
JP3595200001	Tosoh Corp. Reg.Shares	STK	0	12.000
JP3939000000	Yamada Holdings Co. Ltd. Ltd. Reg.Shares	STK	0	20.500
<b>SEK</b>				
SE0000190126	Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria)	STK	0	218
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Akt. B (fria)	STK	0	11.604
<b>USD</b>				
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc. Reg.Shares	STK	0	1.640
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares	STK	0	14.233
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	2.524
US1720621010	Cincinnati Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	1.089
US1729674242	Citigroup Inc. Reg.Shares	STK	2.406	2.406
US23918K1088	DaVita Inc. Reg.Shares	STK	0	1.575
US37940X1028	Global Payments Inc. Reg.Shares	STK	0	803
US46266C1053	IQVIA Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	442
US81211K1007	Sealed Air Corp. Reg.Shares	STK	0	2.065
US82968B1035	Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	33.574
US78467J1007	SS&C Technologies Holdings Reg.Shares	STK	0	2.006
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK	0	1.573

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	790
US9029733048	U.S. Bancorp Reg.Shares	STK	0	5.203
US9344231041	Warner Bros. Discovery Inc. Reg.Shares S.A	STK	0	3.443
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS1040506898	2,9720 % BP Capital Markets PLC MTN 14/26	EUR	0	200.000
BE0000328378	2,2500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.68 13/23	EUR	0	2.000.000
BE0000332412	2,6000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.72 14/24	EUR	0	500.000
DE000A2YPAD6	0,0000 % Konsortium HB,HH,MV,RP,SL,SH Laender. Nr.57 19/29	EUR	0	2.000.000
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
DE0001030856	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Zero Unv.Schatzanw. 22/23	EUR	0	3.000.000



# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

**Verwaltungsvergütung der in dem Fonds gehaltenen Investmentanteile per 30.06.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.**

	<b>Verwaltungsvergütung in % p.a. per 30.06.2023</b>
Deka-MultiFactor Gl. Corp. FCP Inhaber-Anteile I	0,35
Deka-MultiFactor Gl.Cor.HY FCP Inhaber-Anteile I	0,40
Deka-Vega Plus Inhaber-Anteile I (A)	0,70
UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE Act. Nom.A-acc.	0,45
iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	0,50
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	0,25

Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeabschläge für den Erwerb bzw. die Rückgabe von Investmentanteilen an anderen OGA wurden dem Fonds im Berichtszeitraum nicht berechnet.

# Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch

---

Luxemburg, den 3. Juli 2023  
Deka International S.A.  
Der Vorstand

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka International S.A.  
6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Luxemburg

### Eigenmittel zum 31. Dezember 2022

gezeichnet und eingezahlt	EUR 10,4 Mio.
haftend	EUR 77,5 Mio.

### Vorstand

Holger Hildebrandt  
Direktor der Deka International S.A., Luxemburg

Eugen Lehnertz  
Direktor der Deka International S.A., Luxemburg

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Thomas Schneider  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main  
und der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

### Stellvertretender Vorsitzender

Holger Knüppe  
Leiter Beteiligungen der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main

### Unabhängiges Mitglied

Marie-Anne van den Berg, Luxemburg

## Verwahr- und Zahlstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main, Niederlassung Luxemburg  
6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Luxemburg

## Cabinet de révision agréé für den Fonds und die Verwaltungsgesellschaft

Deloitte Audit  
Société à responsabilité limitée  
20 Boulevard de Kockelscheuer  
1821 Luxembourg,  
Großherzogtum Luxemburg

## Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

Stand: 30. Juni 2023

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



**Deka International S.A.**

6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Postfach 5 45  
2015 Luxembourg  
Luxemburg

Telefon: (+3 52) 34 09 - 27 39  
Telefax: (+3 52) 34 09 - 22 90  
[www.deka.lu](http://www.deka.lu)

 **Finanzgruppe**