

Jahresbericht  
zum 31. Januar 2023.  
**Deka-Nachhaltigkeit  
BasisStrategie Renten**

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



**.Deka**  
Investments

# Bericht des Vorstands.

31. Januar 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds DekaNachhaltigkeit BasisStrategie Renten für den Zeitraum vom 1. Februar 2022 bis zum 31. Januar 2023.

In der Berichtsperiode rückten die Pandemie und ihre Auswirkungen an den Finanzmärkten zusehends in den Hintergrund. Mit dem Einmarsch Russlands in die Ukraine erfolgte hingegen bereits zu Beginn des Berichtszeitraums eine jähe Zäsur, die auch an den Kapitalmärkten massive Unruhe auslöste. Die als Reaktion auf den Angriffskrieg initiierten Sanktionsmaßnahmen des Westens gegen den russischen Aggressor setzten eine Vergeltungsspirale in Gang, in deren Folge Russland u.a. die Lieferung von Gas an verschiedene europäische Länder massiv beschränkte und zahlreiche ausländische Unternehmen ihre dortigen Geschäftstätigkeiten einstellen mussten. Exorbitante Preissteigerungen sowie Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im Winter sorgten phasenweise für große Verunsicherung, insbesondere in Europa. Daneben führte die Null-Covid-Politik in China mit damit einhergehenden Lockdown-Maßnahmen zu wiederholten Beeinträchtigungen im internationalen Handel, ehe im Dezember die Staatsführung einen abrupten Wechsel in der Pandemiepolitik vollzog.

In der Geld- und Fiskalpolitik rückte im Laufe des Berichtszeitraums die dynamische Inflationsentwicklung in den Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu einer scharfen Zinswende zwang. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 4,25 bis 4,50 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen seit Juli 2022 erst auf 2,50 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in den kommenden Monaten in Aussicht gestellt, wobei die Zinsschritte zuletzt angesichts etwas nachlassender Teuerungsraten gemäßiger ausfielen. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo merklich an. Ende Januar 2023 rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,5 Prozent.

Angesichts zahlreicher Belastungsfaktoren und Unsicherheiten wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode starke Schwankungen auf. Zwischen Februar und September kam es zu einer ausgeprägten Korrekturphase, ehe in den letzten Monaten eine Gegenbewegung einsetzte. Stark unter Druck geriet der Euro, der zeitweise unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, ehe ab November eine deutliche Erholung festzustellen war.

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter [www.deka.de](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.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2023	7
Anhang	34
Ökologische und/oder soziale Merkmale	38
BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE	56
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	58

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

# Jahresbericht 01.02.2022 bis 31.01.2023

## Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

### Tätigkeitsbericht.

Das Anlageziel des Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Hierzu sollen überwiegend die Zins-, Kurs- und Währungschancen der europäischen Rentenmärkte einschließlich Zentral- und Osteuropas genutzt werden. Gleichzeitig werden bei der Auswahl der Anlagen Nachhaltigkeitskriterien beachtet.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds zu mindestens 60 Prozent des Fondsvermögens in verzinsliche Wertpapiere von Ausstellern aus ganz Europa (inklusive Osteuropa) an. Maximal 40 Prozent dürfen in verzinsliche Wertpapiere außereuropäischer Aussteller investiert werden, die auf Euro oder US-Dollar lauten. Davon dürfen maximal 15 Prozent des Fondsvermögens nicht gegenüber dem Euro währungsgesichert sein. Die Anlagen erfolgen u.a. in Staats- und Unternehmensanleihen sowie in besicherten Anleihen, z.B. Pfandbriefen. 85 Prozent der Wertpapiere müssen ein Investment-Grade-Rating aufweisen (eine gute bis sehr gute Schuldnerqualität der Wertpapiere oder deren Aussteller). Mindestens 60 Prozent der Anlagen lauten auf Euro oder sind gegenüber dem Euro währungsgesichert.

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

#### Wichtige Kennzahlen

##### Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
Anteilklasse CF	-0,5%	-0,4%	-0,4%
Anteilklasse TF (A)	-0,5%	-0,5%	-0,5%

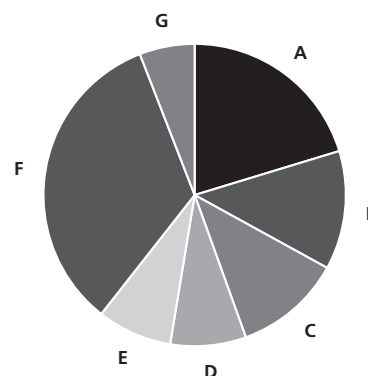
#### ISIN

Anteilklasse CF	LU0107368036
Anteilklasse TF (A)	LU1084635462

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

#### Fondsstruktur

##### Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten



A	USA	20,3%
B	Niederlande	12,7%
C	Frankreich	11,5%
D	Großbritannien	8,1%
E	Spanien	8,0%
F	Sonstige Länder	33,5%
G	Barreserve, Sonstiges	5,9%

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

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35 Prozent des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Mitgliedstaaten der Europäischen Union und ihrer Gebietskörperschaften, der Mitgliedstaaten der OECD und internationalen Einrichtungen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen mindestens ein Mitgliedstaat der EU angehört, investieren. Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental orientierte Investmentansatz kombiniert gezielt „Top-Down“ sowie „Bottom-Up“-Elemente. Die Basis stellt die Analyse makroökonomischer sowie (geo)politischer Parameter

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

dar, ergänzt durch qualitative sowie quantitative fundamentale Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände, z.B. Bonitätsanalyse der Emittenten, relativer Vergleich der Wertpapiere mit anderen korrespondierenden Ausstellern. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation /Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

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.

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

## Leichtes Minus

An den internationalen Finanzmärkten rückte die Corona-Pandemie sukzessive in den Hintergrund, während der völkerrechtswidrige Überfall Russlands auf die Ukraine Ende Februar auch an den Kapitalmärkten Spuren hinterließ. Explodierende Energie- und Rohstoffpreise als Folge der wechselseitigen Sanktionsmaßnahmen sorgten für massive Verunsicherung und rückläufige Kurse, insbesondere in Europa. Gleichzeitig sorgten stark gestiegene Inflationsraten für Belastungen, da die großen Notenbanken mit einem raschen Wechsel in der Geldpolitik entgegenzusteuern versuchten.

Die internationalen Währungshüter sahen sich angesichts der weltweit massiv anziehenden Inflationsraten gezwungen, die Zinswende mit einem ambitionierten geldpolitischen Straffungsmodus einzuleiten. Die US-Notenbank Federal Reserve erhöhte die US-Leitzinsen im Berichtszeitraum signifikant auf die Spanne von zuletzt 4,25 bis 4,50 Prozent. Die Europäische Zentralbank ging etwas gemäßiger vor und hob die Zinsen auf 2,50 Prozent an. Weitere Zinserhöhungen wurden für die kommenden Monate in Aussicht gestellt, wobei die Zinsschritte zuletzt zurückhaltender ausfielen. Insgesamt sind die Renditen an den Rentenmärkten in der Berichtsperiode kräftig gestiegen. Zudem weiteten sich die Risikospreads über weite Strecken merklich aus. Erst ab November war wieder eine etwas freundlichere Entwicklung festzustellen.

Der Anlagefokus richtete sich im Berichtszeitraum auch mit der Nachhaltigkeitsausrichtung nach wie vor insbesondere auf internationale Unternehmensanleihen, die teilweise mit besonderen Ausstattungsmerkmalen versehen waren. In der Branchenstruktur wurde der Anteil in Anleihen von Banken weiter erhöht. Zu einer deutlichen Reduktion kam es im Sektor Immobilien. Daneben bestanden weiterhin kleinere Positionen in Staatsanleihen, Titel halbstaatlicher Emittenten und besicherten Papieren. Unter Ratinggesichtspunkten entfielen über 91 Prozent auf Investment Grade-Anleihen, der High Yield-Bereich wurde per saldo noch etwas reduziert.

## Wertentwicklung im Berichtszeitraum Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

Index: 31.01.2022 = 100



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

Zu den favorisierten Regionen gehörten die USA und Europa, während Schwellenländer tendenziell gemieden wurden. Fremdwährungspositionen wurden weitgehend abgesichert. Die Zinssensitivität der Anlagen (Duration) verlängerte sich ab Oktober spürbar.

Zum Berichtsstichtag war der Fonds mit 94,1 Prozent in Wertpapieren investiert. Daneben fanden strategische Zinsabsicherungen statt. Durch den Derivateinsatz (Zinsterminkontrakte) verringerte sich der Netto-Investitionsgrad um knapp 30,1 Prozentpunkte. Zudem kamen Devisentermingeschäfte sowie Zins- und Credit Default Swaps (CDS) zum Einsatz.

Als vorteilhaft für die Wertentwicklung des Fonds erwiesen sich u.a. die Zinsabsicherungen sowie eine wieder etwas offensivere Positionierung im vierten Quartal 2022. Nachteile ergaben sich hingegen aus der allgemeinen Marktschwäche im Zuge der restriktiveren Geldpolitik.

In der Berichtsperiode verzeichnete der Fonds Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten in den beiden Anteilklassen CF und TF (A) ein leichtes Minus von 0,5 Prozent.

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

## Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>707.831.694,05</b>	<b>64,82</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>707.831.694,05</b>	<b>64,82</b>
<b>EUR</b>								<b>622.585.422,33</b>	<b>57,02</b>
XS2457496359	1,5000 % A2A S.p.A. MTN 22/28	EUR		1.000.000	1.175.000	175.000	% 88,437	884.365,00	0,08
XS2573331837	2,6040 % ABN AMRO Bank N.V. FLR MTN 23/25	EUR		2.200.000	2.200.000	0	% 100,109	2.202.398,00	0,20
XS2102283061	0,6000 % ABN AMRO Bank N.V. Non-Pref. MTN 20/27	EUR		1.000.000	0	0	% 89,162	891.615,00	0,08
XS2536941656	4,2500 % ABN AMRO Bank N.V. Non-Preferred MTN 22/30	EUR		2.000.000	6.000.000	4.000.000	% 101,361	2.027.220,00	0,19
XS2573331324	3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. Preferred MTN 23/26	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 100,646	2.012.910,00	0,18
XS2388941077	0,3750 % Acciona Energia Fin. Fil. SA MTN 21/27 <sup>1)</sup>	EUR		2.500.000	0	0	% 87,421	2.185.512,50	0,20
FR0014006ND8	2,3750 % ACCOR S.A. Bonds 21/28	EUR		1.000.000	0	500.000	% 88,125	881.250,00	0,08
XS2579284469	3,8750 % ACEA S.p.A. MTN 23/31 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	4.475.000	2.475.000	% 99,435	1.988.700,00	0,18
XS0911388675	6,0000 % Achmea B.V. FLR MTN 13/43	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 100,410	2.008.200,00	0,18
XS2560411543	3,6250 % Achmea B.V. MTN 22/25	EUR		2.000.000	3.500.000	1.500.000	% 99,722	1.994.430,00	0,18
XS2008921947	0,6250 % Aegon Bank N.V. Non-Preferred Nts 19/24	EUR		1.000.000	0	0	% 95,902	959.015,00	0,09
XS1061711575	4,0000 % AEGON N.V. FLR MTN 14/44	EUR		1.000.000	0	1.483.000	% 99,085	990.850,00	0,09
FR0013505625	2,1250 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 20/26	EUR		1.000.000	0	0	% 95,265	952.645,00	0,09
XS2150015555	1,7500 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Notes 20/27 <sup>1)</sup>	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 94,025	940.250,00	0,09
XS2555925218	5,7500 % AIB Group PLC FLR MTN 22/29	EUR		3.000.000	4.425.000	1.425.000	% 105,737	3.172.110,00	0,29
XS2578472339	4,6250 % AIB Group PLC FLR MTN 23/29	EUR		1.550.000	1.550.000	0	% 99,837	1.547.473,50	0,14
XS2003442436	1,2500 % AIB Group PLC MTN 19/24	EUR		2.000.000	0	2.350.000	% 96,910	1.938.200,00	0,18
FR001400F2R8	8,1250 % Air France-KLM S.A. Sustain.Lkd MTN 23/28	EUR		3.000.000	3.000.000	0	% 99,182	2.975.445,00	0,27
FR001400CND2	2,8750 % Air Liquide Finance S.A. MTN 22/32	EUR		4.100.000	4.100.000	0	% 97,091	3.980.731,00	0,36
XS2462466611	1,5000 % Akzo Nobel N.V. MTN 22/28	EUR		2.500.000	5.000.000	2.500.000	% 90,496	2.262.387,50	0,21
XS2498554992	4,0000 % ALD S.A. MTN 22/27 <sup>1)</sup>	EUR		1.400.000	1.400.000	0	% 101,243	1.417.395,00	0,13
XS2531420730	2,6250 % Allander N.V. MTN 22/27	EUR		2.000.000	2.825.000	825.000	% 97,645	1.952.900,00	0,18
DE000A3KY342	0,0000 % Allianz Finance II B.V. Zero MTN 21/26 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	1.500.000	% 89,469	1.789.380,00	0,16
DE000A13R7Z7	3,3750 % Allianz SE FLR MTN 14/Und.	EUR		2.000.000	0	0	% 98,190	1.963.800,00	0,18
XS1369278764	2,0000 % Amgen Inc. Notes 16/26	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 95,854	1.917.080,00	0,18
XS2445667236	1,2500 % Andorra MTN 22/27 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	3.400.000	1.400.000	% 90,720	1.814.400,00	0,17
XS2389757944	0,2000 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. MT Notes 21/27	EUR		2.000.000	1.700.000	0	% 84,932	1.698.630,00	0,16
FR0012300812	1,8750 % APRR MTN 14/25	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 97,207	1.944.130,00	0,18
BE6333133039	1,3750 % Argenta Spaarbank N.V. FLR Non-Pref. MTN 22/29	EUR		1.000.000	2.000.000	1.000.000	% 86,366	863.655,00	0,08
XS1140860534	4,5960 % Assicurazioni Generali S.p.A. FLR MTN 14/Und.	EUR		1.500.000	0	0	% 98,362	1.475.430,00	0,14
XS1907118464	2,8220 % AT & T Inc. FLR Notes 18/23	EUR		3.000.000	0	2.000.000	% 100,443	3.013.290,00	0,28
FR0013251170	1,1250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 17/26 <sup>1)</sup>	EUR		1.200.000	0	0	% 93,674	1.124.082,00	0,10
XS1134541306	3,9410 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und.	EUR		1.500.000	0	500.000	% 98,625	1.479.375,00	0,14
XS2573807778	3,6250 % AXA S.A. MTN 23/33	EUR		1.950.000	1.950.000	0	% 100,683	1.963.308,75	0,18
XS2545425980	5,0350 % Banca Mediolanum S.p.A. FLR Preferred MTN 22/27	EUR		2.000.000	3.225.000	1.225.000	% 101,177	2.023.530,00	0,19
XS2573712044	4,6250 % Banco Bilbao Vizcaya Ar. FLR N.-Pref. MTN 23/31 <sup>1)</sup>	EUR		3.000.000	3.600.000	600.000	% 101,681	3.050.415,00	0,28
XS2545206166	4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/29	EUR		2.000.000	3.400.000	1.400.000	% 102,932	2.058.630,00	0,19
XS2553801502	5,1250 % Banco de Sabadell S.A. FLR Preferred MTN 22/28	EUR		2.100.000	2.100.000	0	% 102,865	2.160.154,50	0,20
ES0413900905	3,3750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 23/26	EUR		2.500.000	2.500.000	0	% 100,134	2.503.337,50	0,23
XS2476266205	2,7320 % Banco Santander S.A. FLR Preferred MTN 22/24	EUR		2.000.000	2.300.000	300.000	% 100,834	2.016.670,00	0,18
XS2538366878	3,6250 % Banco Santander S.A. FLR Preferred MTN 22/26	EUR		1.100.000	2.900.000	1.800.000	% 99,555	1.095.099,50	0,10
XS2575952341	2,8380 % Banco Santander S.A. FLR Preferred MTN 23/25 <sup>1)</sup>	EUR		2.300.000	2.300.000	0	% 100,154	2.303.542,00	0,21
XS2575952424	3,7500 % Banco Santander S.A. Preferred MTN 23/26	EUR		2.000.000	2.900.000	900.000	% 99,834	1.996.670,00	0,18
XS2575952697	3,8750 % Banco Santander S.A. Preferred MTN 23/28	EUR		2.400.000	2.400.000	0	% 99,980	2.399.508,00	0,22
XS2387929834	3,0810 % Bank of America Corp. FLR MTN 21/26	EUR		2.000.000	0	3.000.000	% 98,933	1.978.650,00	0,18
XS2462324232	1,9490 % Bank of America Corp. FLR MTN 22/26 <sup>1)</sup>	EUR		1.000.000	4.250.000	3.250.000	% 94,574	945.735,00	0,09
XS2561182622	6,7500 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 22/33 <sup>1)</sup>	EUR		3.000.000	4.000.000	1.000.000	% 104,780	3.143.385,00	0,29
XS2576362839	4,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 23/28 <sup>1)</sup>	EUR		3.000.000	4.650.000	1.650.000	% 101,408	3.042.240,00	0,28

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
ES0313679K13	0,8750 % Bankinter S.A. Preferred Bonos 19/24 <sup>1)</sup>		EUR	2.500.000	0	1.100.000	% 97,417	2.435.412,50	0,22
XS2342059784	2,7980 % Barclays PLC FLR MTN 21/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	0	4.650.000	% 98,639	1.972.780,00	0,18
XS2560422581	5,2620 % Barclays PLC FLR MTN 22/34		EUR	2.000.000	7.250.000	5.250.000	% 102,757	2.055.130,00	0,19
XS1968814332	2,3750 % BAWAG Group AG FLR MTN 19/29		EUR	1.500.000	0	0	% 95,630	1.434.450,00	0,13
XS2531479462	4,1250 % BAWAG P.S.K. Preferred MTN 23/27		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 100,834	1.613.336,00	0,15
XS2535283548	8,0000 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 22/26		EUR	1.500.000	2.700.000	1.200.000	% 102,768	1.541.512,50	0,14
XS2363719050	1,2500 % Bca Pop. di Sondrio S.c.p.A. FLR MTN 21/27 <sup>1)</sup>		EUR	450.000	0	0	% 86,459	389.065,50	0,04
XS2002532567	0,6320 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl Notes 19/23		EUR	2.000.000	0	1.150.000	% 99,221	1.984.410,00	0,18
BE6340794013	5,2500 % Belfius Bank S.A. FLR MTN 23/33		EUR	4.000.000	9.000.000	5.000.000	% 100,135	4.005.380,00	0,37
BE6299156735	1,0000 % Belfius Bank S.A. Non-Preferred MTN 17/24		EUR	1.500.000	0	1.000.000	% 95,984	1.439.760,00	0,13
DE000A2YNQW7	4,5000 % Bilfinger SE Anl. 19/24		EUR	2.000.000	0	0	% 100,500	2.010.000,00	0,18
XS2280845491	0,0000 % BMW Finance N.V. MTN 21/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 91,558	1.831.150,00	0,17
XS1980828724	0,1250 % BNG Bank N.V. MTN 19/26		EUR	500.000	0	0	% 91,599	457.995,00	0,04
XS1626933102	2,7250 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 17/24 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	0	5.500.000	% 100,794	2.015.870,00	0,18
FR001400F0V4	3,8750 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 23/31		EUR	3.000.000	5.000.000	2.000.000	% 101,217	3.036.495,00	0,28
FR001400CFW8	3,6250 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 22/29		EUR	3.000.000	11.500.000	8.500.000	% 97,945	2.938.335,00	0,27
FR001400FB22	5,1250 % BPCE S.A. FLR MTN 23/35 <sup>1)</sup>		EUR	2.100.000	2.100.000	0	% 99,528	2.090.077,50	0,19
FR001400F075	4,3750 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 23/28		EUR	3.000.000	4.900.000	1.900.000	% 100,915	3.027.450,00	0,28
FR001400F083	4,5000 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 23/33		EUR	3.000.000	3.800.000	800.000	% 101,524	3.045.720,00	0,28
FR0014007VF4	0,3750 % BPCE S.A. Pref. MTN 22/26		EUR	1.000.000	0	1.500.000	% 91,076	910.755,00	0,08
XS2534908889	8,6250 % BPER Banca S.p.A FLR MTN 22/33		EUR	1.400.000	1.400.000	0	% 105,500	1.477.000,00	0,14
FR001400CMY0	3,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Preferred MTN 22/27		EUR	2.100.000	2.100.000	0	% 98,051	2.059.060,50	0,19
XS1028952312	2,3750 % Brambles Finance Ltd. Bonds 14/24		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 98,293	1.965.850,00	0,18
XS2496028502	2,7500 % British Telecommunications PLC MTN 22/27		EUR	4.000.000	4.425.000	425.000	% 96,852	3.874.080,00	0,35
DE0001102358	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	0	% 98,587	985.865,00	0,09
XS2558978883	6,2500 % Caixabank S.A. FLR MTN 22/33		EUR	3.000.000	6.800.000	3.800.000	% 103,780	3.113.400,00	0,29
XS2555187801	5,3750 % Caixabank S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/30		EUR	3.000.000	6.200.000	3.200.000	% 104,620	3.138.600,00	0,29
XS2530034649	3,7500 % Caixabank S.A. MTN 22/29		EUR	2.000.000	5.000.000	3.000.000	% 99,648	1.992.950,00	0,18
XS2025468542	0,0400 % Canadian Imperial Bk of Comm. MT Cov. Bonds 19/27 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	0	% 86,997	869.970,00	0,08
FR0013507852	1,6250 % Capgemini SE Notes 20/26 <sup>1)</sup>		EUR	1.200.000	0	0	% 94,955	1.139.460,00	0,10
XS2465792294	2,2500 % Cellnex Finance Company S.A. MTN 22/26		EUR	1.000.000	4.800.000	3.800.000	% 94,003	940.025,00	0,09
XS2555412001	6,6930 % Česká Sporitelna AS FLR Non-Pref.MTN 22/25		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 103,122	2.578.037,50	0,24
XS2536364081	3,7130 % Citigroup Inc. FLR MTN 22/28		EUR	2.500.000	5.225.000	2.725.000	% 99,079	2.476.975,00	0,23
XS1678966935	1,7500 % CNH Industrial Finance Euro.SA MTN 17/25		EUR	2.000.000	0	0	% 95,446	1.908.920,00	0,17
XS2533012790	2,7500 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 22/25		EUR	4.000.000	6.600.000	2.600.000	% 97,936	3.917.440,00	0,36
XS0926785808	2,3750 % Coca-Cola Europacific Pa. PLC Notes 13/25		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 98,513	1.970.250,00	0,18
XS1958646082	0,5000 % Colgate-Palmolive Co. Bonds 19/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 92,577	925.770,00	0,08
XS2481287394	2,5520 % Coloplast Finance B.V. FLR MTN 22/24 <sup>1)</sup>		EUR	2.100.000	2.100.000	0	% 100,537	2.111.266,50	0,19
XS2481287808	2,2500 % Coloplast Finance B.V. MTN 22/27		EUR	1.000.000	1.475.000	475.000	% 94,809	948.090,00	0,09
DE000CZ43ZN8	5,1250 % Commerzbank AG MT FLN 23/30		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 101,796	1.628.728,00	0,15
DE000CZ45W81	6,5000 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 22/32		EUR	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 102,405	2.048.100,00	0,19
DE000CZ40LW5	4,0000 % Commerzbank AG T2 Nachr. MTN S.874 17/27 <sup>1)</sup>		EUR	1.500.000	0	3.500.000	% 98,839	1.482.585,00	0,14
XS1577586321	1,0000 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 17/25		EUR	1.000.000	0	3.000.000	% 95,530	955.295,00	0,09
XS2517103417	2,1250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 22/28		EUR	1.200.000	1.200.000	0	% 93,957	1.127.484,00	0,10

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2576245281	3,5000 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 23/29		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 100,008	1.600.120,00	0,15
ES0000101818	2,1460 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 17/27 <sup>1)</sup>		EUR	1.300.000	0	0	% 96,095	1.249.228,50	0,11
XS2193657561	1,1250 % Conti-Gummi Finance B.V. MTN 20/24		EUR	1.000.000	0	750.000	% 96,419	964.185,00	0,09
XS2572996606	4,0000 % Coöperatieve Rabobank U.A. Non-Pref. MTN 23/30		EUR	2.000.000	3.500.000	1.500.000	% 100,673	2.013.450,00	0,18
FR0012444750	4,2500 % Crédit Agricole Assurances SA FLR Notes 15/Und.		EUR	2.000.000	0	0	% 98,750	1.975.000,00	0,18
FR0013516184	1,6250 % Crédit Agricole S.A. FLR MTN 20/30 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 92,911	929.105,00	0,09
FR001400F1U4	4,2500 % Crédit Agricole S.A. FLR Non-Pref. MTN 23/29		EUR	2.400.000	2.400.000	0	% 100,869	2.420.844,00	0,22
FR001400D0Y0	4,0000 % Crédit Agricole S.A. FLR Non-Prefer. 22/26		EUR	2.000.000	2.700.000	700.000	% 100,251	2.005.010,00	0,18
FR001400E7J5	3,3750 % Crédit Agricole S.A. Preferred MTN 22/27		EUR	3.000.000	5.400.000	2.400.000	% 99,270	2.978.100,00	0,27
FR001400CQ85	3,3750 % Crédit Mutuel Arkéa MTN 22/27		EUR	4.300.000	4.300.000	0	% 98,239	4.224.277,00	0,39
XS2169281131	0,8750 % CRH Finland Services Oyj MTN 20/23		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 98,308	983.075,00	0,09
XS2147994995	1,7000 % Danaher Corp. Notes 20/24		EUR	1.800.000	0	0	% 98,298	1.769.360,40	0,16
XS2573569220	4,0000 % Danske Bank AS FLR Preferred MTN 23/27		EUR	2.000.000	6.750.000	4.750.000	% 99,995	1.999.900,00	0,18
XS2573569576	4,1250 % Danske Bank AS FLR Preferred MTN 23/31		EUR	2.000.000	5.000.000	3.000.000	% 100,247	2.004.940,00	0,18
XS2517101478	1,1250 % DekaBank Dt.Girozent. MTN Hyp.-Pfe.R.A157 22/25		EUR	400.000	400.000	0	% 95,212	380.848,00	0,03
DE000DL19VD6	1,3750 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/26 <sup>1)</sup>		EUR	1.500.000	0	0	% 94,764	1.421.460,00	0,13
DE000DL19WL7	1,8750 % Deutsche Bank AG FLR MTN 22/28		EUR	1.000.000	2.600.000	1.600.000	% 89,982	899.820,00	0,08
DE000A30VT06	5,0000 % Deutsche Bank AG FLR MTN 22/30		EUR	5.000.000	6.300.000	1.300.000	% 100,070	5.003.475,00	0,46
DE000A30VQ09	4,0000 % Deutsche Bank AG MTN 22/27		EUR	5.000.000	7.600.000	2.600.000	% 100,776	5.038.775,00	0,46
XS1405765733	1,2500 % Dover Corp. Notes 16/26 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	0	650.000	% 91,286	2.738.568,00	0,25
FR0013247202	1,8750 % Edenred SE Notes 17/27 <sup>1)</sup>		EUR	1.600.000	0	0	% 95,196	1.523.128,00	0,14
PTEDP4OM0025	5,9430 % EDP - Energias de Portugal SA FLR MTN 23/83 <sup>1)</sup>		EUR	2.200.000	2.200.000	0	% 99,850	2.196.700,00	0,20
XS1846632104	1,6250 % EDP Finance B.V. MTN 18/26 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	4.000.000	% 94,709	947.090,00	0,09
XS2542914986	3,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/30 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.625.000	625.000	% 101,020	2.020.400,00	0,19
BE0002629104	1,3750 % Elia Transm. Belgium S.A./N.V. MTN 19/26		EUR	2.000.000	1.000.000	0	% 93,950	1.879.000,00	0,17
FR001400AK26	4,1250 % Elis S.A. MTN 22/27		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 98,500	985.000,00	0,09
XS1077882394	2,7500 % Emirates Telecommunic. Grp Co. MTN 14/26		EUR	1.000.000	0	0	% 98,003	980.025,00	0,09
XS2576550243	6,6250 % ENEL S.p.A. FLR Nts 23/Und. <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 102,055	3.061.650,00	0,28
XS2576550086	6,3750 % ENEL S.p.A. FLR Nts. 23/Und. <sup>1)</sup>		EUR	4.000.000	5.200.000	1.200.000	% 102,188	4.087.500,00	0,37
FR0013504644	1,3750 % Engie S.A. MTN 20/25 <sup>1)</sup>		EUR	1.500.000	0	800.000	% 95,753	1.436.287,50	0,13
FR001400A1H6	3,5000 % Engie S.A. MTN 22/29		EUR	4.000.000	5.000.000	1.000.000	% 99,479	3.979.140,00	0,36
FR001400F1G3	3,6250 % Engie S.A. MTN 23/30		EUR	2.000.000	2.700.000	700.000	% 99,750	1.994.990,00	0,18
AT0000A32562	4,0000 % Erste Group Bank AG FLR Pref. MTN 23/31		EUR	3.000.000	3.700.000	700.000	% 99,808	2.994.225,00	0,27
XS2579480307	6,7500 % Eurofins Scientific S.E. FLR Notes 23/Und.		EUR	1.450.000	1.450.000	0	% 101,625	1.473.562,50	0,13
XS2549047673	3,7250 % FCA Bank S.p.A. FLR MTN 22/24		EUR	1.500.000	3.750.000	2.250.000	% 100,269	1.504.027,50	0,14
XS2549047244	4,2500 % FCA Bank S.p.A. MTN 22/24		EUR	1.500.000	3.150.000	1.650.000	% 100,353	1.505.295,00	0,14
ES0205032032	1,3820 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 20/26 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 92,893	2.786.775,00	0,26
XS2532681074	3,7500 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA MTN 22/27		EUR	4.000.000	4.600.000	600.000	% 98,696	3.947.820,00	0,36
XS2405467528	0,1250 % General Mills Inc. Notes 21/25		EUR	4.000.000	2.825.000	0	% 91,660	3.666.400,00	0,34
XS2412258522	0,8750 % GN Store Nord AS MTN 21/24 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	0	1.550.000	% 92,000	1.840.000,00	0,17
XS2553817680	3,0000 % GSK Capital B.V. MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.600.000	600.000	% 99,210	1.984.200,00	0,18
XS2549815913	5,8750 % Hannover Rueck SE FLR Sub. Anl. 22/43		EUR	2.000.000	4.300.000	2.300.000	% 106,195	2.123.900,00	0,19
XS2530219349	2,6250 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 22/27		EUR	3.500.000	3.500.000	0	% 98,162	3.435.652,50	0,31
XS2553547444	6,3640 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 22/32		EUR	2.000.000	3.575.000	1.575.000	% 105,130	2.102.600,00	0,19
FI4000523550	4,2500 % Huhtamaeki Oyj Notes 22/27		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 99,273	992.725,00	0,09
AT0000A2XG57	1,3750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG MTN 22/25		EUR	2.000.000	2.800.000	800.000	% 94,488	1.889.750,00	0,17
XS2580221658	4,8750 % Iberdrola Finanzas S.A. FLR MTN 23/Und. <sup>1)</sup>		EUR	4.500.000	4.500.000	0	% 98,688	4.440.937,50	0,41
XS1847692636	1,2500 % Iberdrola Finanzas S.A. MTN 18/26		EUR	1.500.000	3.000.000	1.500.000	% 93,871	1.408.057,50	0,13



# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2558916693	3,1250 % Iberdrola Finanzas S.A. MTN 22/28	EUR		4.100.000	4.100.000	0	% 99,441	4.077.081,00	0,37
XS2194282948	0,7500 % Infineon Technologies AG MTN 20/23	EUR		1.000.000	0	0	% 99,194	991.935,00	0,09
XS2194283672	1,1250 % Infineon Technologies AG MTN 20/26	EUR		2.000.000	1.000.000	0	% 92,542	1.850.830,00	0,17
XS2443921056	0,6250 % Infineon Technologies AG MTN 22/25	EUR		1.400.000	1.400.000	0	% 94,683	1.325.555,00	0,12
XS2200215213	1,8750 % Infrastrutt. Wireless Italiane MTN 20/26	EUR		2.000.000	0	0	% 92,960	1.859.200,00	0,17
XS2554746185	4,8750 % ING Groep N.V. FLR MTN 22/27	EUR		4.000.000	8.200.000	4.200.000	% 102,812	4.112.460,00	0,38
XS2554745708	5,2500 % ING Groep N.V. FLR MTN 22/33	EUR		2.000.000	3.500.000	1.500.000	% 107,127	2.142.540,00	0,20
DE000A1KRJV6	0,0100 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfe.21/28 <sup>1)</sup>	EUR		1.000.000	0	0	% 84,835	848.345,00	0,08
XS1912495691	0,6250 % International Bank Rec. Dev. MTN 18/27 <sup>1)</sup>	EUR		500.000	0	0	% 89,950	449.750,00	0,04
XS2529233814	4,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Non-Preferred MTN 22/27	EUR		3.000.000	7.000.000	4.000.000	% 101,633	3.048.990,00	0,28
XS1945110606	1,2500 % Intl Business Machines Corp. Notes 19/27	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 92,582	1.851.630,00	0,17
XS1704789590	1,5000 % Iren S.p.A. MTN 17/27 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	350.000	% 90,802	1.816.030,00	0,17
XS1881533563	1,9500 % Iren S.p.A. MTN 18/25	EUR		3.000.000	0	1.775.000	% 96,242	2.887.245,00	0,26
XS1673102734	1,5000 % ISS Global A/S MTN 17/27 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	2.000.000	% 89,296	1.785.920,00	0,16
XS2013618421	0,8750 % ISS Global A/S MTN 19/26 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	375.000	% 89,605	1.792.090,00	0,16
XS1685542497	1,6250 % Italgas S.P.A. MTN 17/29	EUR		2.550.000	0	0	% 87,964	2.243.082,00	0,21
XS2050543839	1,3750 % ITV PLC Notes 19/26 <sup>1)</sup>	EUR		1.500.000	1.500.000	0	% 91,458	1.371.862,50	0,13
XS2531438351	2,5000 % John Deere Bank S.A. MTN 22/26	EUR		2.000.000	3.500.000	1.500.000	% 97,327	1.946.540,00	0,18
XS2527421668	3,0000 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. Notes 22/28	EUR		5.000.000	7.825.000	2.825.000	% 97,045	4.852.250,00	0,44
BE0002846278	1,5000 % KBC Groep N.V. FLR MTN 22/26	EUR		1.000.000	3.000.000	2.000.000	% 94,957	949.570,00	0,09
BE0002875566	3,0000 % KBC Groep N.V. MTN 22/30 <sup>1)</sup>	EUR		1.500.000	2.500.000	1.000.000	% 94,583	1.418.745,00	0,13
FR0013248721	1,5000 % Kering S.A. MTN 17/27	EUR		2.000.000	1.000.000	0	% 94,290	1.885.790,00	0,17
FR001400A5N5	1,2500 % Kering S.A. MTN 22/25	EUR		2.100.000	2.100.000	0	% 96,275	2.021.775,00	0,19
AT0000A2T487	0,0100 % Kommunalkredit Austria AG MTN 21/28	EUR		1.500.000	800.000	0	% 83,643	1.254.637,50	0,11
XS0454773713	5,6250 % Kon. KPN N.V. MTN 09/24	EUR		3.000.000	3.000.000	0	% 103,590	3.107.685,00	0,28
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25 <sup>1)</sup>	EUR		7.000.000	0	0	% 95,818	6.707.260,00	0,62
NL0015031501	0,0000 % Königreich Niederlande Anl. 20/27 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	0	% 90,642	1.812.840,00	0,17
ES00000126B2	2,7500 % Königreich Spanien Bonos 14/24 <sup>1)</sup>	EUR		1.100.000	0	0	% 99,974	1.099.714,00	0,10
ES0000012E85	0,2500 % Königreich Spanien Bonos 19/24	EUR		2.500.000	0	0	% 96,388	2.409.700,00	0,22
ES00000127G9	2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25 <sup>1)</sup>	EUR		2.000.000	0	0	% 98,285	1.965.700,00	0,18
ES00000128P8	1,5000 % Königreich Spanien Obligaciones 17/27	EUR		3.000.000	0	2.000.000	% 94,548	2.836.452,00	0,26
FR001400CN47	2,6250 % La Poste MTN 22/28	EUR		5.000.000	6.000.000	1.000.000	% 94,432	4.721.600,00	0,43
XS2389315768	0,0100 % Laensfoersaekringar Hypotek AB MT Cov. Nts 21/28	EUR		1.000.000	0	0	% 84,238	842.380,00	0,08
XS2390861362	0,0000 % Landwirtschaftliche Rentenbank MTN S.1208 21/26	EUR		850.000	0	0	% 90,194	766.649,00	0,07
XS2138286229	4,5000 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 20/30	EUR		1.000.000	0	2.000.000	% 98,483	984.825,00	0,09
XS2569069375	4,5000 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 23/29 <sup>1)</sup>	EUR		3.000.000	3.000.000	0	% 101,459	3.043.755,00	0,28
XS1685653302	0,8750 % London Stock Exchange Group PLC MTN 17/24	EUR		2.125.000	0	0	% 96,363	2.047.703,13	0,19
FR0014009EH2	2,8280 % L'Oréal S.A. FLR Notes 22/24	EUR		2.700.000	2.700.000	0	% 100,839	2.722.639,50	0,25
FR0014009EI0	0,3750 % L'Oréal S.A. Notes 22/24	EUR		1.400.000	1.400.000	0	% 97,402	1.363.621,00	0,12
FR0014009EJ8	0,8750 % L'Oréal S.A. Notes 22/26	EUR		1.600.000	1.600.000	0	% 93,594	1.497.504,00	0,14
XS1596739364	1,3750 % Madrileña Red de Gas Fin. B.V. MTN 17/25	EUR		500.000	0	0	% 94,019	470.092,50	0,04
XS2027957815	1,1250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Preferred MTN 19/25	EUR		1.000.000	0	0	% 94,270	942.700,00	0,09
XS2535307743	2,6250 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 22/25	EUR		3.050.000	3.050.000	0	% 98,513	3.004.646,50	0,28
XS2535308477	3,0000 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 22/28 <sup>1)</sup>	EUR		3.000.000	5.200.000	2.200.000	% 97,850	2.935.500,00	0,27
XS2491029208	1,8750 % Merck Financial Services GmbH MTN 22/26	EUR		4.000.000	4.000.000	0	% 96,044	3.841.760,00	0,35
XS2437455277	0,2500 % Mitsubishi HC Capital UK PLC MTN 22/25	EUR		1.000.000	0	850.000	% 92,434	924.335,00	0,08
XS2548080832	4,8130 % Morgan Stanley DLR MTN 22/28	EUR		3.000.000	4.575.000	1.575.000	% 103,489	3.104.655,00	0,28

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2446386356	2,1030 % Morgan Stanley FLR MTN 22/26		EUR	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 96,202	1.924.040,00	0,18
XS2548081053	5,1480 % Morgan Stanley FLR MTN 22/34		EUR	2.000.000	6.050.000	4.050.000	% 107,137	2.142.740,00	0,20
XS2528341501	3,5300 % Nat.Gr.Elec.Distr.(East M.)PLC MTN 22/28		EUR	3.000.000	5.050.000	2.050.000	% 98,896	2.966.865,00	0,27
XS2575973776	3,8750 % National Grid PLC MTN 23/29		EUR	4.000.000	4.925.000	925.000	% 100,148	4.005.900,00	0,37
XS2576067081	4,2750 % National Grid PLC MTN 23/35 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	5.500.000	2.500.000	% 99,679	2.990.370,00	0,27
XS2528858033	4,0670 % NatWest Group PLC FLR MTN 22/28		EUR	2.000.000	8.000.000	6.000.000	% 99,950	1.998.990,00	0,18
XS2485554088	2,8480 % NatWest Markets PLC FLR MTN 22/25		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 100,348	1.505.220,00	0,14
XS2576255751	3,2780 % NatWest Markets PLC FLR MTN 23/26		EUR	1.500.000	2.500.000	1.000.000	% 100,316	1.504.732,50	0,14
XS2148372696	1,1250 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 20/26 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	0	% 95,322	953.215,00	0,09
XS2462321212	0,8750 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.375.000	375.000	% 92,678	1.853.560,00	0,17
XS2555196463	3,0000 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 22/28		EUR	3.000.000	6.075.000	3.075.000	% 100,532	3.015.945,00	0,28
XS2555198089	3,2500 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 22/31 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	4.050.000	1.050.000	% 100,564	3.016.905,00	0,28
XS1028950290	4,5000 % NN Group N.V. FLR Bonds 14/Und.		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 98,985	989.850,00	0,09
XS1076781589	4,3750 % NN Group N.V. FLR MTN 14/Und.		EUR	1.000.000	0	0	% 99,375	993.750,00	0,09
XS2171759256	2,3750 % Nokia Oyj MTN 20/25		EUR	2.000.000	0	0	% 96,624	1.932.470,00	0,18
XS1134729794	1,6250 % Novartis Finance S.A. Notes 14/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 94,753	1.895.050,00	0,17
XS2441244535	0,7500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. MTN 22/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 94,882	948.820,00	0,09
XS2449330179	1,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 91,919	1.838.370,00	0,17
XS2348030268	0,0000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. Notes 21/24 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	0	1.075.000	% 95,772	2.873.160,00	0,26
DE000NWB0584	0,5000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.058 16/26		EUR	1.300.000	0	0	% 93,320	1.213.160,00	0,11
XS2411311579	0,0820 % NTT Finance Corp. MTN 21/25		EUR	4.000.000	1.725.000	0	% 91,439	3.657.540,00	0,34
XS2019814503	0,8000 % Omnicom Finance Holdings PLC Notes 19/27		EUR	2.750.000	0	0	% 88,797	2.441.917,50	0,22
FR0013359197	1,0000 % Orange S.A. MTN 18/25		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 94,540	1.890.800,00	0,17
XS2563353361	5,2500 % Orsted A/S FLR Notes 22/Und.		EUR	3.000.000	4.425.000	1.425.000	% 100,750	3.022.500,00	0,28
XS2490471807	2,2500 % Orsted A/S MTN 22/28		EUR	3.000.000	3.450.000	450.000	% 94,595	2.837.850,00	0,26
XS2577396430	4,2500 % Pirelli & C. S.p.A. MTN 23/28 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.675.000	675.000	% 99,794	1.995.870,00	0,18
XS1405769487	0,8750 % PPG Industries Inc. Notes 16/25 <sup>1)</sup>		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 93,771	2.344.262,50	0,21
FR001400F6V1	3,8750 % PSA Banque France S.A. MTN 23/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 100,993	1.009.925,00	0,09
XS2534786590	7,3750 % Raiffeisen Bank Intl AG FLR MTN 22/32		EUR	1.000.000	2.600.000	1.600.000	% 103,613	1.036.125,00	0,09
CH1224575899	5,2300 % Raiffeisen Schweiz Genossensch Anl. 22/27		EUR	3.000.000	4.000.000	1.000.000	% 104,011	3.120.315,00	0,29
XS2577033553	7,1250 % Raiffeisenbank a.s. FLR Non-Pref. MTN 23/26		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 101,574	1.523.610,00	0,14
FR001400F0U6	4,6250 % RCI Banque S.A. MTN 23/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	5.700.000	3.700.000	% 100,546	2.010.920,00	0,18
XS1395060491	1,0000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. MTN 16/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 93,331	1.866.612,00	0,17
BE0002708890	0,0500 % Région Wallonne MTN 20/25		EUR	700.000	0	0	% 93,319	653.233,00	0,06
XS1576838376	1,0000 % RELX Finance B.V. Notes 17/24		EUR	4.000.000	0	0	% 97,276	3.891.040,00	0,36
XS1189286286	2,5000 % REN Finance B.V. MTN S.2 15/25		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 97,936	1.469.032,50	0,13
XS2015295814	0,1000 % Republik Island MTN 19/24		EUR	750.000	0	0	% 95,679	717.592,50	0,07
XS2182399274	0,6250 % Republik Island MTN 20/26		EUR	3.250.000	0	0	% 91,346	2.968.745,00	0,27
IT0005001547	3,7500 % Republik Italien B.T.P. 14/24		EUR	2.000.000	0	0	% 100,874	2.017.470,00	0,18
IT0005274805	2,0500 % Republik Italien B.T.P. 17/27		EUR	1.000.000	0	0	% 94,041	940.410,00	0,09
IT0005390874	0,8500 % Republik Italien B.T.P. 19/27		EUR	1.000.000	0	2.700.000	% 90,531	905.305,00	0,08
AT0000A1VKG0	0,5000 % Republik Österreich Bundesanl. 17/27 <sup>1)</sup>		EUR	1.300.000	0	0	% 91,644	1.191.372,00	0,11
XS1288467605	1,5000 % Republik Polen MTN 15/25 <sup>1)</sup>		EUR	1.300.000	0	0	% 96,374	1.252.862,00	0,11
XS1584894650	1,3750 % Republik Polen MTN 17/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	0	2.000.000	% 91,964	1.839.280,00	0,17
XS1766612672	1,1250 % Republik Polen MTN 18/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	0	1.825.000	% 93,815	1.876.300,00	0,17
PTOTEKOE0011	2,8750 % Republik Portugal Obr. 15/25		EUR	2.000.000	0	0	% 100,497	2.009.940,00	0,18
PTOTEXOE0024	1,9500 % Republik Portugal Obr. 19/29		EUR	1.000.000	250.000	0	% 94,616	946.160,00	0,09
PTOTEMOE0035	0,7000 % Republik Portugal Obr. 20/27		EUR	2.000.000	1.500.000	0	% 91,096	1.821.920,00	0,17
XS1599193403	2,3750 % Republik Rumänien MTN 17/27 Reg.S		EUR	2.000.000	0	0	% 90,375	1.807.500,00	0,17
SI0002103685	1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	1.400.000	0	% 93,529	1.870.574,00	0,17
XS2411720233	0,3750 % Sandvik AB MTN 21/28 <sup>1)</sup>		EUR	800.000	0	0	% 84,470	675.760,00	0,06

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2489287354	2,1250 % Sandvik AB MTN 22/27		EUR	800.000	800.000	0	% 95,158	761.260,00	0,07
XS2538368221	3,7500 % Sandvik AB MTN 22/29		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 100,966	1.817.379,00	0,17
XS1781346801	0,7500 % Santander Consumer Bank AS MTN 18/23		EUR	1.000.000	0	0	% 99,862	998.615,00	0,09
XS2441296923	0,5000 % Santander Consumer Bank AS Preferred MTN 22/25		EUR	1.000.000	1.500.000	500.000	% 91,692	916.915,00	0,08
DE000A2G8VTS	1,0000 % SAP SE MTN 18/26		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 94,472	2.834.160,00	0,26
XS2441055998	0,5000 % SBAB Bank AB (publ) Preferred MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.400.000	400.000	% 88,129	1.762.570,00	0,16
FR0012601367	0,8750 % Schneider Electric SE MTN 15/25 <sup>1)</sup>		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 95,461	2.386.525,00	0,22
FR001400DT99	3,2500 % Schneider Electric SE MTN 22/27		EUR	2.800.000	2.800.000	0	% 100,240	2.806.706,00	0,26
FR001400DTA3	3,5000 % Schneider Electric SE MTN 22/32		EUR	1.000.000	1.300.000	300.000	% 101,486	1.014.860,00	0,09
XS2489775580	3,5000 % SES S.A. MTN 22/29		EUR	1.250.000	2.000.000	750.000	% 93,806	1.172.575,00	0,11
XS2526839175	2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 22/25		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 98,196	2.945.865,00	0,27
XS2526839258	2,5000 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 22/27		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 97,169	2.915.055,00	0,27
XS2532247892	3,1250 % SKF AB Notes 22/28		EUR	3.750.000	3.750.000	0	% 97,481	3.655.518,75	0,33
XS2433211310	0,7500 % Snam S.p.A. MTN 22/29 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	800.000	0	% 82,754	1.655.080,00	0,15
FR001400EHG3	4,2500 % Société Générale S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/30		EUR	3.000.000	3.500.000	500.000	% 99,068	2.972.025,00	0,27
FR001400DZM5	4,0000 % Société Générale S.A. Pref. MTN 22/27		EUR	3.000.000	4.400.000	1.400.000	% 101,600	3.047.985,00	0,28
XS2406010285	0,2500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA Pref. MTN 21/26		EUR	2.000.000	0	0	% 87,676	1.753.510,00	0,16
XS1967582831	0,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA Preferred MTN 19/24		EUR	3.000.000	0	4.350.000	% 96,485	2.894.550,00	0,27
XS2397352233	0,0100 % Sparebanken Vest Boligkred. AS MT Hyp.-Pfe. 21/26		EUR	925.000	0	0	% 89,078	823.971,50	0,08
XS2510903862	2,8750 % SSE PLC MTN 22/29		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 95,580	1.433.700,00	0,13
XS2532312548	2,8750 % Statkraft AS MTN 22/29 <sup>1)</sup>		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 97,769	1.270.990,50	0,12
XS2407985220	0,0000 % Stedin Holding N.V. MTN 21/26		EUR	1.675.000	0	0	% 88,413	1.480.917,75	0,14
XS2087639626	0,7500 % Stryker Corp. Notes 19/29		EUR	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 85,184	1.703.670,00	0,16
FR001400AFL5	1,8750 % Suez S.A. MTN 22/27		EUR	2.300.000	2.300.000	0	% 92,390	2.124.958,50	0,19
FR001400DQ84	4,6250 % Suez S.A. MTN 22/28		EUR	4.000.000	8.000.000	4.000.000	% 103,546	4.141.820,00	0,38
XS2547609433	4,0000 % Talanx AG MTN 22/29		EUR	3.700.000	3.700.000	0	% 101,372	3.750.745,50	0,34
SK4000018925	0,5000 % Tatra Banka AS FLR MTN 21/28		EUR	1.000.000	600.000	0	% 77,370	773.700,00	0,07
XS2484502823	5,0560 % TDC Net A/S MTN 22/28		EUR	2.000.000	2.500.000	500.000	% 99,292	1.985.830,00	0,18
XS1050461034	5,8750 % Telefónica Europe B.V. FLR Secs 14/Und.		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 101,188	1.011.875,00	0,09
XS0826189028	3,0000 % Telia Company AB MTN 12/27		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 98,280	1.965.600,00	0,18
XS2477935345	1,6250 % TenneT Holding B.V. MTN 22/26		EUR	2.000.000	3.650.000	1.650.000	% 94,046	1.880.920,00	0,17
XS2549543143	3,8750 % TenneT Holding B.V. MTN 22/28		EUR	2.000.000	3.700.000	1.700.000	% 102,089	2.041.780,00	0,19
XS2438026440	0,8750 % Thames Water Utilities Fin.PLC MTN 22/28		EUR	2.000.000	0	0	% 85,744	1.714.880,00	0,16
XS2307863642	0,1250 % The Coca-Cola Co. Notes 21/29		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 83,485	2.504.550,00	0,23
XS2158820477	0,8290 % The Export-Import Bk of Korea MTN 20/25 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	0	0	% 94,642	1.892.830,00	0,17
XS2441551970	2,7320 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN 22/25 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 100,265	2.005.300,00	0,18
XS2565831943	3,6310 % The Toronto-Dominion Bank MTN 22/29		EUR	3.000.000	6.350.000	3.350.000	% 97,961	2.938.815,00	0,27
XS1405775708	0,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 16/24		EUR	3.400.000	0	0	% 95,995	3.263.843,60	0,30
XS2557526006	3,2000 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 22/26		EUR	2.000.000	3.975.000	1.975.000	% 99,584	1.991.670,00	0,18
XS2430285077	0,0640 % Toyota Finance Australia Ltd. MTN 22/25		EUR	2.000.000	2.000.000	1.000.000	% 93,786	1.875.720,00	0,17
XS2572989650	3,3750 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV MTN 23/26		EUR	2.000.000	2.650.000	650.000	% 99,952	1.999.030,00	0,18
XS2572989817	3,5000 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV MTN 23/28 <sup>1)</sup>		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 100,238	1.804.284,00	0,17
CH1236363391	4,3750 % UBS Group AG FLR MTN 23/31		EUR	1.950.000	1.950.000	0	% 101,397	1.977.231,75	0,18
XS2414835921	2,5000 % UGI International LLC Notes 21/29 Reg.S		EUR	1.050.000	0	0	% 82,090	861.945,00	0,08
ES0380907065	7,2500 % Unicaja Banco S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.200.000	2.200.000	0	% 102,292	2.250.413,00	0,21
DE000HV2AYN4	0,0100 % UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2112 21/26		EUR	450.000	0	0	% 89,655	403.447,50	0,04
XS2021993212	1,6250 % UniCredit S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 19/25		EUR	3.000.000	600.000	0	% 96,689	2.900.655,00	0,27
XS2555420103	5,8500 % UniCredit S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 22/27		EUR	4.000.000	5.200.000	1.200.000	% 103,780	4.151.200,00	0,38

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2063547041	0,5000 % UniCredit S.p.A. Preferred MTN 19/25 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	0	% 93,249	932.490,00	0,09
XS2147133495	1,2500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 20/25 <sup>1)</sup>		EUR	1.300.000	0	0	% 96,289	1.251.762,20	0,11
XS2450200824	0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 22/26 <sup>1)</sup>		EUR	1.500.000	1.950.000	450.000	% 93,354	1.400.310,00	0,13
XS2481498173	1,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 22/28		EUR	1.500.000	1.825.000	325.000	% 93,222	1.398.322,50	0,13
XS1078235733	5,7500 % UnipolSai Assicurazioni S.p.A. FLR MTN 14/Und.		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 99,840	998.400,00	0,09
XS1405767515	1,0000 % United Parcel Service Inc. Notes 16/28 <sup>1)</sup>		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 88,017	3.520.680,00	0,32
XS2496288593	3,0000 % Universal Music Group N.V. MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 97,340	2.920.200,00	0,27
FR001400EA16	5,3750 % Valéo S.E. MTN 22/27		EUR	2.000.000	4.700.000	2.700.000	% 100,780	2.015.600,00	0,18
XS1979280853	0,8750 % Verizon Communications Inc. Notes 19/27		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 89,737	2.692.098,00	0,25
XS2550881143	4,2500 % Verizon Communications Inc. Notes 22/30		EUR	3.000.000	5.425.000	2.425.000	% 103,387	3.101.595,00	0,28
XS2535724772	4,0000 % Vier Gas Transport GmbH MTN 22/27		EUR	4.000.000	5.000.000	1.000.000	% 101,154	4.046.160,00	0,37
XS2479941499	1,5000 % VISA Inc. Notes 22/26		EUR	4.775.000	4.775.000	0	% 94,689	4.521.399,75	0,41
XS2560495462	3,2500 % Vodafone International Fin.DAC MTN 22/29 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	3.050.000	1.050.000	% 98,692	1.973.830,00	0,18
XS2534276717	2,6250 % Volvo Treasury AB MTN 22/26		EUR	2.325.000	2.325.000	0	% 97,575	2.268.618,75	0,21
XS2324836878	0,2500 % Wolters Kluwer N.V. Notes 21/28 <sup>1)</sup>		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 85,828	2.574.825,00	0,24
XS2530756191	3,0000 % Wolters Kluwer N.V. Notes 22/26		EUR	1.675.000	1.675.000	0	% 98,886	1.656.340,50	0,15
FR0013521549	0,5000 % Worldline S.A. Obl. 20/23		EUR	2.400.000	0	0	% 98,964	2.375.124,00	0,22
<b>GBP</b>								<b>19.020.947,15</b>	<b>1,74</b>
XS2570940226	6,3690 % Barclays PLC FLR MTN 23/31		GBP	2.000.000	2.750.000	750.000	% 103,111	2.349.601,51	0,22
XS2579488201	6,8750 % CaixaBank S.A. FLR MTN 23/33		GBP	5.000.000	5.500.000	500.000	% 100,458	5.722.896,03	0,52
XS2560994381	8,6250 % Commerzbank AG Sub.Fix to Res. MTN 22/33		GBP	2.700.000	2.700.000	0	% 103,902	3.196.326,13	0,29
XS2563349765	7,4160 % NatWest Group PLC FLR MTN 22/33 <sup>1)</sup>		GBP	3.000.000	4.550.000	1.550.000	% 104,858	3.584.133,26	0,33
XS2555708036	7,0980 % Santander UK Group Hldgs PLC FLR MTN 22/27 <sup>1)</sup>		GBP	3.500.000	7.500.000	4.000.000	% 104,519	4.167.990,22	0,38
<b>USD</b>								<b>66.225.324,57</b>	<b>6,06</b>
US025816DB21	5,8500 % American Express Co. Notes 22/27		USD	1.900.000	1.900.000	0	% 105,398	1.853.108,78	0,17
XS2389123931	1,4830 % Arab Petrol. Investm. Corp. MTN 21/26 Reg.5		USD	2.200.000	0	0	% 90,130	1.834.877,16	0,17
US05946KAK79	5,8620 % Banco Bilbao Vizcaya Arg. FLR-Non.-Pref.Nts 22/26		USD	3.000.000	5.000.000	2.000.000	% 100,353	2.785.892,75	0,26
US05946KAL52	6,1380 % Banco Bilbao Vizcaya Arg. FLR-Non.-Pref.Nts 22/28		USD	3.000.000	4.000.000	1.000.000	% 102,937	2.857.655,11	0,26
US05964HAD70	5,7819 % Banco Santander S.A. FLR Non-Pref. Nts 17/23		USD	3.000.000	0	2.000.000	% 99,995	2.775.968,17	0,25
US05964HAR66	5,1470 % Banco Santander S.A. Non-Preferred Nts 22/25		USD	1.000.000	1.600.000	600.000	% 99,844	923.925,42	0,08
US05964HAS40	5,2940 % Banco Santander S.A. Non-Preferred Nts 22/27		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 99,982	1.850.395,60	0,17
US06738ECC75	7,3250 % Barclays PLC FLR Notes 22/26		USD	5.000.000	10.000.000	5.000.000	% 104,880	4.852.634,99	0,44
US06738ECD58	7,3850 % Barclays PLC FLR Notes 22/28 <sup>1)</sup>		USD	4.000.000	4.900.000	900.000	% 108,014	3.998.130,75	0,37
US14913R2Y27	4,9000 % Caterpillar Fin.Services Corp. MTN 22/25		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 100,582	1.861.518,53	0,17
US126408HE65	2,6000 % CSX Corp. Notes 16/26		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 93,492	2.162.853,38	0,20
XS2532478190	6,3000 % EDP Finance B.V. Notes 22/27 Reg.5		USD	800.000	800.000	0	% 105,119	778.190,90	0,07
US31620MBV72	4,5000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 22/25		USD	1.000.000	2.924.000	1.924.000	% 98,910	915.282,47	0,08
US31620MBW55	4,7000 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 22/27		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 99,349	1.838.698,93	0,17
US42824CAW91	4,9000 % Hewlett Packard Enterprise Co. Notes 16/25		USD	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 99,840	1.847.786,05	0,17
USV4605MAA63	4,5000 % India Clean Energy Holdings Notes 22/27 Reg.5		USD	500.000	0	500.000	% 83,000	384.028,13	0,04
US50050HAM88	1,7500 % Kookmin Bank MT Bk Nts 20/25 Reg.5		USD	1.800.000	0	0	% 92,831	1.546.244,39	0,14
US53522KAA16	4,8000 % Linde Inc. Notes 22/24		USD	4.000.000	4.000.000	0	% 101,000	3.738.490,72	0,34
US53522KAB98	4,7000 % Linde Inc. Notes 22/25		USD	4.000.000	4.000.000	0	% 99,847	3.695.794,20	0,34
US62954WAJ45	4,2390 % NTT Finance Corp. Notes 22/25 144A		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 98,649	912.867,26	0,08
US68389XCF06	5,8000 % Oracle Corp. Notes 22/25		USD	4.000.000	4.900.000	900.000	% 102,475	3.793.068,99	0,35
US68389XCH61	6,1500 % Oracle Corp. Notes 22/29		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 106,655	1.973.904,59	0,18
US68389XCJ28	6,2500 % Oracle Corp. Notes 22/32		USD	3.000.000	5.000.000	2.000.000	% 108,425	3.009.993,99	0,28
XS1700429480	4,8750 % Prudential PLC MTN 17/Und. <sup>1)</sup>		USD	2.000.000	0	0	% 88,062	1.629.796,88	0,15

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
USG7420TAD84	2,7500 % Reckitt Benckiser Treas. Serv. Notes 17/24 Reg.S		USD	1.700.000	0	0	% 96,984	1.525.689,63	0,14
USG7420TAE67	3,0000 % Reckitt Benckiser Treas. Serv. Notes 17/27 Reg.S		USD	1.000.000	0	0	% 94,307	872.687,73	0,08
US465410CA47	1,2500 % Republik Italien Notes 20/26		USD	3.000.000	0	2.400.000	% 88,214	2.448.915,00	0,22
XS2571922884	6,6250 % Republik Rumänien MTN 23/28 Reg.S <sup>1)</sup>		USD	2.000.000	2.424.000	424.000	% 103,625	1.917.827,23	0,18
US80281LAT26	6,5340 % Santander UK Group Hldgs PLC FLR Notes 23/29		USD	4.000.000	5.000.000	1.000.000	% 104,003	3.849.646,05	0,35
US87938WAT09	4,1030 % Telefonica Emisiones S.A.U. Notes 17/27		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 96,688	1.789.450,79	0,16
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>295.116.314,42</b>	<b>27,02</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere EUR</b>								<b>295.116.314,42</b>	<b>27,02</b>
XS2575555938	3,2500 % ABB Finance B.V. MTN 23/27		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 100,111	1.501.657,50	0,14
XS2575556589	3,3750 % ABB Finance B.V. MTN 23/31 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.975.000	975.000	% 98,926	1.978.510,00	0,18
XS2249892535	2,6250 % Adevinata ASA Notes 20/25 Reg.S		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 95,250	952.500,00	0,09
XS2555178644	3,0000 % adidas AG Anl. 22/25		EUR	4.000.000	10.300.000	6.300.000	% 99,797	3.991.880,00	0,37
XS2555179378	3,1250 % adidas AG Anl. 22/29		EUR	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 99,842	1.996.830,00	0,18
XS2486839298	2,3750 % Alcon Finance B.V. Notes 22/28 <sup>1)</sup>		EUR	1.900.000	1.900.000	0	% 93,492	1.776.348,00	0,16
XS2388162385	2,1250 % Almirall S.A. Notes 21/26 Reg.S		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 93,050	930.500,00	0,09
XS2454766473	0,7500 % American Medical Syst.Eu. B.V. Notes 22/25		EUR	2.000.000	2.825.000	825.000	% 94,393	1.887.850,00	0,17
XS2452433910	1,3750 % American Medical Syst.Eu. B.V. Notes 22/28 <sup>1)</sup>		EUR	925.000	925.000	0	% 90,192	834.276,00	0,08
DE000A30VPL3	3,4500 % Amprion GmbH MTN 22/27		EUR	3.000.000	5.400.000	2.400.000	% 99,345	2.980.350,00	0,27
XS2310487074	2,0000 % Ardagh Metal Packaging Fin.PLC Notes 21/28 Reg.S		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 83,250	832.500,00	0,08
XS2103218538	2,0000 % Ashland Services B.V. Notes 20/28 Reg.S		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 88,125	881.250,00	0,08
XS1405780963	1,3750 % ASML Holding N.V. Notes 16/26 <sup>1)</sup>		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 94,547	2.363.675,00	0,22
XS1527556192	1,6250 % ASML Holding N.V. Notes 16/27 <sup>1)</sup>		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 94,077	1.411.147,50	0,13
XS2554581830	7,0000 % ASR Nederland N.V. FLR Bonds 22/43		EUR	2.500.000	4.375.000	1.875.000	% 106,337	2.658.425,00	0,24
XS2080318053	1,5000 % Ball Corp. Notes 19/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	0	0	% 89,000	1.780.000,00	0,16
XS2558591967	6,0000 % Banco BPM S.p.A. FLR Non-Pref. MTN 22/28		EUR	2.000.000	2.400.000	400.000	% 100,881	2.017.620,00	0,18
FR0012329845	4,0320 % BNP Paribas Cardif S.A. FLR Notes 14/Und.		EUR	1.500.000	0	0	% 97,490	1.462.350,00	0,13
XS1196503137	1,8000 % Booking Holdings Inc. Notes 15/27		EUR	2.000.000	0	1.000.000	% 94,227	1.884.530,00	0,17
XS2555218291	4,0000 % Booking Holdings Inc. Notes 22/26		EUR	5.000.000	7.000.000	2.000.000	% 102,234	5.111.700,00	0,47
XS2555220867	4,2500 % Booking Holdings Inc. Notes 22/29		EUR	4.000.000	7.475.000	3.475.000	% 102,761	4.110.420,00	0,38
XS1689523840	1,1250 % Brenntag Finance B.V. Notes 17/25		EUR	3.015.000	0	335.000	% 94,359	2.844.908,78	0,26
XS2521013909	3,6250 % Chorus Ltd. MTN 22/29		EUR	3.000.000	4.000.000	1.000.000	% 98,985	2.969.550,00	0,27
XS1907122656	1,5000 % Coca-Cola Europacific Pa. PLC Notes 18/27		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 91,829	1.836.570,00	0,17
XS2385397901	0,0000 % Comcast Corp. Notes 21/26		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 88,686	1.773.710,00	0,16
XS1758723883	2,8750 % Crown European Holdings S.A. Notes 18/26 Reg.S		EUR	2.000.000	0	0	% 95,750	1.915.000,00	0,18
XS2466171985	2,8700 % Daimler Truck Intl Finance FLR MTN 22/23		EUR	2.000.000	3.100.000	1.100.000	% 100,261	2.005.210,00	0,18
XS2466172280	1,2500 % Daimler Truck Intl Finance MTN 22/25		EUR	1.000.000	1.600.000	600.000	% 95,303	953.025,00	0,09
XS2466172363	1,6250 % Daimler Truck Intl Finance MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	900.000	900.000	0	% 92,031	828.279,00	0,08
XS2193734733	1,6250 % Dell Bank International DAC Notes 20/24		EUR	1.000.000	0	0	% 96,802	968.015,00	0,09
XS2351382473	2,2500 % Derichebourg S.A. Notes 21/28 Reg.S		EUR	2.000.000	1.000.000	0	% 85,500	1.710.000,00	0,16
XS1117298247	1,9000 % Discovery Communications LLC Notes 15/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 91,472	1.829.440,00	0,17
XS2526860965	2,6140 % East Japan Railway Co. MTN 22/25		EUR	2.375.000	2.375.000	0	% 98,170	2.331.525,63	0,21
XS1240751062	1,6250 % Eli Lilly and Company Notes 15/26 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 94,637	946.366,00	0,09
XS1621351045	1,3750 % Experian Finance PLC MTN 17/26		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 93,645	2.809.350,00	0,26
XS2405483301	2,7500 % Faurecia SE Notes 21/27		EUR	1.500.000	0	2.525.000	% 89,000	1.335.000,00	0,12
XS2553825949	7,2500 % Faurecia SE Notes 22/26		EUR	625.000	625.000	0	% 103,125	644.531,25	0,06

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2337285519	0,5000 % Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV Notes 21/28		EUR	3.000.000	0	2.000.000	% 84,000	2.520.000,00	0,23
XS2229875989	3,2500 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 20/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 96,350	963.500,00	0,09
XS2247623643	3,5000 % Getlink SE Notes 20/25 Reg.S		EUR	2.000.000	0	0	% 98,030	1.960.600,00	0,18
XS2076836555	1,6250 % Grifols S.A. Notes 19/25 Reg.S		EUR	2.000.000	0	0	% 94,438	1.888.750,00	0,17
XS2462324745	1,2500 % GSK Consumer Health.Cap.NL BV MTN 22/26		EUR	2.050.000	2.050.000	0	% 93,056	1.907.648,00	0,17
XS2406914346	0,3180 % Highland Holdings S.A.r.L. Notes 21/26		EUR	2.500.000	0	775.000	% 88,555	2.213.862,50	0,20
XS1843435253	0,2500 % Illinois Tool Works Inc. Notes 19/24		EUR	3.000.000	0	0	% 94,765	2.842.950,00	0,26
XS2240507801	2,1250 % Informa PLC MTN 20/25		EUR	2.000.000	1.000.000	0	% 95,748	1.914.960,00	0,18
XS2305742434	1,7500 % IQVIA Inc. Notes 21/26 Reg.S		EUR	1.500.000	0	500.000	% 93,160	1.397.392,50	0,13
XS1405784015	2,2500 % Kraft Heinz Foods Co. Notes 16/28		EUR	1.000.000	0	0	% 92,306	923.060,00	0,08
DE000HLB2H54	0,6000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ IHS 17/23		EUR	5.000.000	0	0	% 100,450	5.022.500,00	0,46
XS2561647368	4,6250 % Liberty Mutual Group Inc. Notes 22/30 Reg.S		EUR	3.000.000	7.125.000	4.125.000	% 99,386	2.981.565,00	0,27
XS2391860843	0,0000 % Linde PLC MTN 21/26		EUR	4.000.000	0	2.100.000	% 89,064	3.562.540,00	0,33
XS2463961321	1,0000 % Linde PLC MTN 22/27 <sup>1)</sup>		EUR	2.100.000	2.100.000	0	% 92,121	1.934.541,00	0,18
XS1327028459	2,1000 % Mastercard Inc. Notes 15/27 <sup>1)</sup>		EUR	4.000.000	4.500.000	500.000	% 95,212	3.808.480,00	0,35
XS2530031546	3,2730 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. FLR MTN 22/25 <sup>1)</sup>		EUR	2.000.000	2.825.000	825.000	% 99,092	1.981.840,00	0,18
XS2028899727	0,3390 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. MTN 19/24		EUR	1.000.000	0	0	% 95,586	955.860,00	0,09
XS2528323780	3,4900 % Mizuho Financial Group Inc. MTN 22/27		EUR	2.000.000	5.000.000	3.000.000	% 98,544	1.970.880,00	0,18
XS2337604479	2,2500 % Mytilineos S.A. Notes 21/26 <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	900.000	% 93,000	930.000,00	0,09
XS1821883102	3,6250 % Netflix Inc. Notes 17/27 Reg.S		EUR	3.000.000	3.000.000	0	% 98,199	2.945.970,00	0,27
XS2332589972	1,6250 % Nexi S.p.A. Nts 21/26 Reg.S <sup>1)</sup>		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 89,750	897.500,00	0,08
XS2259210677	0,0500 % Ontario Teachers Finance Trust Notes 20/30 Reg.S		EUR	225.000	0	0	% 77,229	173.765,25	0,02
XS2332250708	2,8750 % Organon/Org.For.De.Co-Issuer Notes 21/28 Reg.S		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 87,838	878.375,00	0,08
XS2559453431	3,2500 % Paccar Financial Europe B.V. MTN 22/25		EUR	2.000.000	2.750.000	750.000	% 99,517	1.990.330,00	0,18
XS1719267855	1,1250 % Parker-Hannifin Corp. Notes 17/25		EUR	2.000.000	0	1.550.000	% 95,454	1.909.070,00	0,17
XS2168625544	0,5000 % PepsiCo Inc. Notes 20/28		EUR	4.000.000	4.000.000	0	% 87,401	3.496.040,00	0,32
XS2582358789	5,6250 % Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski FLR Pref. MTN 23/26		EUR	1.175.000	1.175.000	0	% 100,950	1.186.162,50	0,11
XS2580271596	3,8750 % Prologis Euro Finance LLC Notes 23/30 <sup>1)</sup>		EUR	10.100.000	10.100.000	0	% 98,852	9.984.001,50	0,92
XS2065939469	0,0000 % Provinz Quebec MTN 19/29		EUR	650.000	0	0	% 81,298	528.433,75	0,05
XS2579606927	4,7500 % Raiffeisen Bank Intl AG FLR MTN 23/27		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 99,539	2.488.475,00	0,23
XS2552369469	4,6250 % Red Electrica Corporacion S.A. FLR Notes 23/Und.		EUR	2.500.000	2.500.000	0	% 99,375	2.484.375,00	0,23
XS2494945939	3,8750 % Rentokil Initial Finance B.V. MTN 22/27		EUR	2.000.000	2.650.000	650.000	% 100,971	2.019.420,00	0,18
XS1996441066	0,8750 % Rentokil Initial PLC MTN 19/26		EUR	3.000.000	0	1.000.000	% 91,905	2.757.150,00	0,25
XS2403428472	2,1250 % Rexel S.A. Notes 21/28		EUR	1.500.000	0	0	% 86,125	1.291.875,00	0,12
XS2189592889	1,8750 % SIG Combibloc PurchaseCo SARL Notes 20/23 Reg.S		EUR	1.000.000	0	1.000.000	% 99,530	995.300,00	0,09
XS1562623584	2,6250 % Sigma Alimentos S.A. Notes 17/24 Reg.S		EUR	2.000.000	0	3.000.000	% 98,587	1.971.740,00	0,18
XS1141969912	1,8750 % Sky PLC MTN 14/23		EUR	4.000.000	0	0	% 99,009	3.960.340,00	0,36
XS2532473555	4,5650 % Smith & Nephew PLC Notes 22/29		EUR	3.000.000	9.625.000	6.625.000	% 102,634	3.079.020,00	0,28
XS1849518276	2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. Notes 18/26 Reg.S		EUR	2.000.000	0	1.000.000	% 98,239	1.964.780,00	0,18
XS2582501925	5,6180 % TDC Net A/S MTN 23/30		EUR	1.600.000	1.600.000	0	% 100,050	1.600.800,00	0,15
XS2462605671	7,1250 % Telefónica Europe B.V. FLR Notes 22/Und.		EUR	5.000.000	5.000.000	0	% 104,250	5.212.500,00	0,48
XS2582389156	6,1350 % Telefónica Europe B.V. FLR Notes 23/Und.		EUR	9.000.000	9.000.000	0	% 98,500	8.865.000,00	0,82
XS2345035963	1,2500 % Wabtec Transportation NL B.V. Notes 21/27 <sup>1)</sup>		EUR	925.000	0	0	% 86,769	802.613,25	0,07
XS2193974701	2,7500 % WMG Acquisition Corp. Notes 20/28 Reg.S		EUR	2.000.000	2.000.000	0	% 89,750	1.795.000,00	0,16
XS2582404724	5,7500 % ZF Finance GmbH MTN 23/26		EUR	1.500.000	1.500.000	0	% 100,523	1.507.845,00	0,14
<b>GBP</b>								<b>2.442.355,46</b>	<b>0,22</b>
XS2523960719	5,1250 % Zurich Finance (Ireland) DAC FLR MTN 22/52 <sup>1)</sup>		GBP	2.275.000	2.275.000	0	% 94,225	2.442.355,46	0,22
<b>USD</b>								<b>113.162.349,05</b>	<b>10,34</b>
US025816CY33	3,9500 % American Express Co. Notes 22/25		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 98,199	908.703,10	0,08

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US06051GKH10	3,6950 % Bank of America Corp. FLR Notes 22/28		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 98,563	1.824.142,88	0,17
US06051GLE79	5,0800 % Bank of America Corp. FLR Notes 23/27		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 100,013	1.850.978,58	0,17
US06738EBZ79	5,3040 % Barclays PLC FLR Notes 22/26		USD	1.000.000	2.800.000	1.800.000	% 99,437	920.163,79	0,08
US110122DE50	3,9000 % Bristol-Myers Squibb Co. Notes 19/28		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 98,295	2.273.978,62	0,21
US110122DN59	0,7500 % Bristol-Myers Squibb Co. Notes 20/25		USD	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 90,524	1.675.362,05	0,15
US17327CAP86	4,6634 % Citigroup Inc. FLR Notes 22/26		USD	3.000.000	3.000.000	3.000.000	% 97,659	2.711.104,43	0,25
US20030NDZ15	5,2500 % Comcast Corp. Notes 22/25		USD	4.000.000	4.000.000	0	% 101,929	3.772.858,93	0,35
US251526CS67	6,7200 % Deutsche Bank AG FLR Notes 23/29 <sup>1)</sup>		USD	500.000	500.000	0	% 104,307	482.612,32	0,04
US25156PBB85	4,3750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. Notes 18/28 144A		USD	2.000.000	2.000.000	3.500.000	% 97,692	1.808.013,70	0,17
US278642AV58	1,9000 % eBay Inc. Notes 20/25		USD	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 94,187	1.743.154,58	0,16
US278642BC68	5,9000 % eBay Inc. Notes 22/25		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 102,869	1.903.835,65	0,17
US278642BA03	5,9500 % eBay Inc. Notes 22/27		USD	900.000	900.000	0	% 104,917	873.782,45	0,08
US532457BH00	2,7500 % Eli Lilly and Company Notes 15/25		USD	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 96,127	1.779.058,90	0,16
US37045VAY65	5,4000 % General Motors Co. Notes 22/29 <sup>1)</sup>		USD	1.000.000	1.775.000	775.000	% 98,405	910.604,73	0,08
US438127AA08	2,2710 % Honda Motor Co. Ltd. Notes 22/25		USD	2.000.000	5.000.000	3.000.000	% 95,000	1.758.201,08	0,16
US458140AS90	3,7000 % Intel Corp. Notes 15/25		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 97,763	904.663,86	0,08
US458140BY59	3,7500 % Intel Corp. Notes 22/27		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 97,330	900.661,64	0,08
US46115HBV87	8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR Pref. MTN 22/33 144A		USD	1.100.000	1.100.000	0	% 108,593	1.105.379,63	0,10
US46115HBU05	7,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 22/25 144A		USD	1.500.000	1.500.000	0	% 103,265	1.433.373,43	0,13
US459200KS93	4,0000 % Intl Business Machines Corp. Notes 22/25		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 98,587	912.298,15	0,08
US459200KT76	4,1500 % Intl Business Machines Corp. Notes 22/27		USD	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 98,540	1.823.717,21	0,17
US24422EWB19	2,1250 % John Deere Capital Corp. MTN 22/25		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 95,291	881.788,74	0,08
US24422EWJ45	4,0500 % John Deere Capital Corp. MTN 22/25		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 98,778	914.060,98	0,08
US24422EWK18	4,1500 % John Deere Capital Corp. MTN 22/27		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 99,489	920.644,98	0,08
US46647PCX24	3,8624 % JPMorgan Chase & Co. FLR Notes 22/26		USD	2.000.000	7.000.000	5.000.000	% 99,245	1.836.755,66	0,17
US46647PCY07	4,1224 % JPMorgan Chase & Co. FLR Notes 22/28		USD	2.000.000	4.000.000	2.000.000	% 99,010	1.832.415,68	0,17
USL5828LAB55	4,8750 % Klabin Austria GmbH Notes 17/27 Reg.S <sup>1)</sup>		USD	1.000.000	0	0	% 97,289	900.282,24	0,08
US548661EK91	4,4000 % Lowe's Companies Inc. Notes 22/25		USD	425.000	425.000	0	% 99,385	390.861,18	0,04
US548661EG89	3,3500 % Lowe's Companies Inc. Notes 22/27		USD	1.150.000	1.150.000	0	% 95,636	1.017.739,09	0,09
US55608JBF49	5,1080 % Macquarie Group Ltd. FLR MTN 22/26 144A		USD	3.000.000	4.000.000	1.000.000	% 100,105	2.779.021,88	0,25
US55903VAC72	3,4280 % Magallanes Inc. Notes 22/24 144A		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 97,574	902.919,54	0,08
US55903VAE39	3,6380 % Magallanes Inc. Notes 22/25 144A		USD	1.000.000	2.050.000	1.050.000	% 96,146	889.705,27	0,08
US571748BR21	5,7500 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Notes 22/32		USD	1.550.000	1.550.000	0	% 108,274	1.552.997,73	0,14
US233851DT84	4,3000 % Mercedes-Benz Fin.North.Am.LLC Notes 19/29 144A		USD	2.500.000	2.500.000	0	% 97,074	2.245.743,30	0,21
US609207BA22	2,6250 % Mondelez International Inc. Notes 22/27		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 93,002	1.721.232,59	0,16
US61747YEJ01	4,5803 % Morgan Stanley FLR MTN 22/25		USD	3.000.000	3.000.000	4.000.000	% 98,958	2.747.179,94	0,25
US61747YEZ43	5,0500 % Morgan Stanley FLR Notes 23/27		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 99,970	925.091,38	0,08
US61747YFA82	5,1230 % Morgan Stanley FLR Notes 23/29		USD	1.000.000	1.000.000	0	% 100,580	930.736,13	0,09
US654106AJ22	2,7500 % NIKE Inc. Notes 20/27		USD	4.000.000	4.000.000	0	% 94,952	3.514.625,46	0,32
US70450YAD58	2,6500 % PayPal Holdings Inc. Notes 19/26		USD	1.875.000	0	0	% 94,056	1.631.925,81	0,15
US713448FL73	3,6000 % PepsiCo Inc. Notes 22/28 <sup>1)</sup>		USD	2.000.000	2.000.000	0	% 97,437	1.803.303,57	0,17
US693475BL85	4,7580 % PNC Financial Services Group FLR Notes 23/27		USD	900.000	900.000	0	% 99,797	831.137,28	0,08
USU75000CA27	3,7689 % Roche Holdings Inc. FLR Notes 22/25 Reg.S		USD	3.000.000	4.000.000	1.000.000	% 99,168	2.753.009,76	0,25
USU75000BT27	2,1320 % Roche Holdings Inc. Notes 22/25 Reg.S		USD	1.500.000	3.000.000	1.500.000	% 95,248	1.322.100,12	0,12
USU75000BV72	2,3140 % Roche Holdings Inc. Notes 22/27 Reg.S		USD	1.500.000	3.000.000	1.500.000	% 92,658	1.286.142,60	0,12

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US78016FZR80	5,6600 % Royal Bank of Canada MTN 22/24 <sup>1)</sup>	MTN	USD	2.000.000	2.000.000	0	% 101,564	1.879.683,52	0,17
US78016FZU10	6,0000 % Royal Bank of Canada MTN 22/27	MTN	USD	3.000.000	3.000.000	0	% 105,098	2.917.619,03	0,27
USN82008AX66	1,2000 % Siemens Finan.maatschappij NV Notes 21/26 Reg.S	MTN	USD	4.000.000	4.000.000	0	% 90,435	3.347.429,79	0,31
USY8085FBJ85	6,2500 % SK Hynix Inc. Notes 23/26 Reg.S <sup>1)</sup>	MTN	USD	2.000.000	3.250.000	1.250.000	% 100,896	1.867.320,59	0,17
US83368RBR21	6,4460 % Société Générale S.A. FLR Non-Pref. MTN 23/29 144A	MTN	USD	3.000.000	3.500.000	500.000	% 103,317	2.868.204,32	0,26
US857477BX07	5,7510 % State Street Corp. FLR Notes 22/26	MTN	USD	2.000.000	2.000.000	0	% 102,598	1.898.820,15	0,17
US857477BY89	5,8200 % State Street Corp. FLR Notes 22/28	MTN	USD	2.000.000	2.000.000	0	% 104,481	1.933.669,55	0,18
US06418BAD01	4,1789 % The Bank of Nova Scotia FLR Notes 22/24	MTN	USD	3.000.000	3.000.000	0	% 100,411	2.787.530,65	0,26
US06406RBL06	5,8020 % The Bk of New York Mellon Corp FLR MTN 22/28	MTN	USD	900.000	900.000	0	% 104,686	871.858,60	0,08
US260543DG52	6,3000 % The Dow Chemical Co. Notes 22/33	MTN	USD	1.900.000	1.900.000	0	% 110,065	1.935.164,02	0,18
US38141GZL12	4,0624 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR Notes 22/28	MTN	USD	2.000.000	0	2.000.000	% 97,734	1.808.800,26	0,17
US437076CM21	2,7000 % The Home Depot Inc. Notes 22/25	MTN	USD	1.000.000	1.000.000	0	% 96,239	890.561,24	0,08
US89114TZS40	4,0953 % The Toronto-Dominion Bank FLR MTN 22/24	MTN	USD	1.500.000	1.500.000	0	% 100,414	1.393.800,03	0,13
US89115A2H42	4,6930 % The Toronto-Dominion Bank MTN 22/27	MTN	USD	3.000.000	5.000.000	2.000.000	% 99,749	2.769.152,82	0,25
US87264AAV70	4,7500 % T-Mobile USA Inc. Notes 18/28	MTN	USD	3.500.000	3.500.000	0	% 99,150	3.211.261,74	0,29
US89236TJZ93	3,0500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 22/27	MTN	USD	3.000.000	3.830.000	830.000	% 94,900	2.634.525,52	0,24
US91159HJH49	5,7270 % U.S. Bancorp FLR MTN 22/26	MTN	USD	5.000.000	5.000.000	0	% 102,349	4.735.529,54	0,43
US91159HJK77	4,6530 % U.S. Bancorp FLR MTN 23/29	MTN	USD	500.000	500.000	0	% 99,846	461.971,96	0,04
US91324PEN87	5,1500 % UnitedHealth Group Inc. Notes 22/25	MTN	USD	1.000.000	1.000.000	0	% 101,864	942.617,87	0,09
US91324PEP36	5,2500 % UnitedHealth Group Inc. Notes 22/28	MTN	USD	850.000	850.000	0	% 103,150	811.340,40	0,07
US91324PEQ19	5,3000 % UnitedHealth Group Inc. Notes 22/30	MTN	USD	400.000	400.000	0	% 104,665	387.416,83	0,04
<b>Neuemissionen</b>								<b>5.030.924,63</b>	<b>0,46</b>
<b>Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen</b>								<b>5.030.924,63</b>	<b>0,46</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>5.030.924,63</b>	<b>0,46</b>
<b>GBP</b>								<b>2.404.940,27</b>	<b>0,22</b>
XS2540612129	6,3750 % NatWest Markets PLC MTN 22/27	MTN	GBP	2.000.000	3.000.000	1.000.000	% 105,539	2.404.940,27	0,22
<b>USD</b>								<b>2.625.984,36</b>	<b>0,24</b>
USE2428RAA35	6,2080 % CaixaBank S.A. FLR-Non.-Pref.Nts 23/29	MTN	USD	800.000	800.000	0	% 101,155	748.845,60	0,07
USY8085FBK58	6,3750 % SK Hynix Inc. Notes 23/28 Reg.S <sup>1)</sup>	MTN	USD	2.000.000	3.250.000	1.250.000	% 101,427	1.877.138,76	0,17
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>								<b>10.883.867,94</b>	<b>0,99</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>10.883.867,94</b>	<b>0,99</b>
<b>USD</b>								<b>10.883.867,94</b>	<b>0,99</b>
US00206RFY36	5,5397 % AT & T Inc. FLR Notes 18/23	MTN	USD	3.000.000	0	5.000.000	% 100,033	2.777.023,09	0,25
US48241FAB04	5,7960 % KBC Groep N.V. FLR Notes 23/29 144A	MTN	USD	875.000	875.000	0	% 101,023	817.977,03	0,07
US63253QAA22	4,9660 % Natl Austr.Bank Ltd. (NY Br.) Notes 23/26	MTN	USD	3.000.000	3.000.000	0	% 101,059	2.805.505,95	0,26
US83368RAZ55	1,4880 % Société Générale S.A. FLR Non-Pref. MTN 20/26 144A	MTN	USD	2.000.000	0	1.000.000	% 88,934	1.645.944,57	0,15
US83368RBQ48	6,4470 % Société Générale S.A. FLR Non-Pref. MTN 23/27 144A	MTN	USD	3.000.000	3.000.000	0	% 102,209	2.837.417,30	0,26
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 1.018.862.801,04</b>	<b>93,29</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Zins-Derivate</b>									
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>									
EURO Bobl Future (FGBM) März 23		XEUR	EUR	-240.000.000				4.493.000,00	0,41
EURO Bund Future (FGBL) März 23		XEUR	EUR	-35.000.000				832.280,00	0,08
<b>Summe der Zins-Derivate</b>								<b>EUR 5.325.280,00</b>	<b>0,49</b>



# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Devisen-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>										
								<b>-670.193,42</b>	<b>-0,06</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
	GBP/EUR 19.500.000,00		OTC					-4.894,12	0,00	
	USD/EUR 216.150.000,00		OTC					-665.299,30	-0,06	
<b>Summe der Devisen-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>-670.193,42</b>	<b>-0,06</b>
<b>Swaps</b>										
<b>Zinsswaps (Erhalten / Zahlen)</b>										
								<b>-205.012,85</b>	<b>-0,02</b>	
	IRS EURIBORM03 EUR / 2.845% EUR / CITIGLMD_FRA 06.01.2029		OTC	EUR	15.000.000			-7.135,35	0,00	
	IRS EURIBORM03 EUR / 2.949% EUR / CITIGLMD_FRA 22.12.2027		OTC	EUR	50.000.000			-197.877,50	-0,02	
<b>Credit Default Swaps (CDS)</b>										
<b>Protection Seller</b>										
								<b>1.486.249,91</b>	<b>0,14</b>	
								<b>1.486.249,91</b>	<b>0,14</b>	
	CDS 11 W38RGI023J3WT1HWRP32 / GOLDMANS_FRA 20.06.2027		OTC	EUR	-1.500.000			40.911,08	0,00	
	CDS 213800TB53ELEUKM7Q61 / BNP_PAR 20.12.2026		OTC	EUR	-2.000.000			28.360,19	0,00	
	CDS 529900R27DL06UVNT076 / GOLDMANS_FRA 20.06.2027		OTC	EUR	-1.500.000			23.388,58	0,00	
	CDS 549300V9QSIG4WX4GJ96 / BNP_PAR 20.12.2026		OTC	EUR	-1.500.000			34.513,83	0,00	
	CDS 5QK37QC7NWOJ8D7WVQ45 / BNP_PAR 20.12.2026		OTC	EUR	-2.000.000			40.803,17	0,00	
	CDS ITRAXX EUROPE S32 V1 5Y / BNP_PAR 20.12.2024		OTC	EUR	-15.000.000			186.005,11	0,02	
	CDS ITRAXX EUROPE S32 V1 5Y / JPMORGAN_FRA 20.12.2024		OTC	EUR	-40.000.000			714.710,29	0,07	
	CDS ITRAXX EUROPE S37 V1 5Y / JPMORGAN_FRA 20.06.2027		OTC	EUR	-5.000.000			60.926,43	0,01	
	CDS ITRAXX EUROPE S37 V1 5Y / GOLDMANS_FRA 20.06.2027		OTC	EUR	-5.000.000			60.926,43	0,01	
	CDS ITRAXX EUROPE S37 V1 5Y / JPMORGAN_FRA 20.06.2027		OTC	EUR	-5.000.000			60.926,43	0,01	
	CDS ITRAXX EUROPE S37 V1 5Y / BNP_PAR 20.06.2027		OTC	EUR	-10.000.000			121.852,86	0,01	
	CDS ITRAXX EUROPE S37 V1 5Y / CITIGLMD_FRA 20.06.2027		OTC	EUR	-5.000.000			60.926,43	0,01	
	CDS TL2N6M87CW970S5SV098 / BOFASECEUR 20.12.2026		OTC	EUR	-2.000.000			24.577,54	0,00	
	CDS YEH5ZCD6E441RHVHD759 / CITIGLMD_FRA 20.12.2026		OTC	EUR	-1.500.000			27.421,54	0,00	
<b>Summe der Swaps</b>								<b>EUR</b>	<b>1.281.237,06</b>	<b>0,12</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	77.213.662,36			%	100,000	77.213.662,36	7,10
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CZK	2.632,94			%	100,000	110,45	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	768,56			%	100,000	103,31	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HUF	1.396,75			%	100,000	3,59	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		PLN	751.134,11			%	100,000	159.398,62	0,01
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	25.255,68			%	100,000	25.171,86	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		MXN	10,25			%	100,000	0,50	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	10.683.644,30			%	100,000	9.886.313,14	0,92
<b>Summe der Bankguthaben<sup>2)</sup></b>								<b>EUR</b>	<b>87.284.763,83</b>	<b>8,03</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR</b>	<b>87.284.763,83</b>	<b>8,03</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
	Zinsansprüche		EUR	8.651.267,89				8.651.267,89	0,80	
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	8.405.990,90				8.405.990,90	0,78	
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	831.052,27				831.052,27	0,08	
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	271.521,24				271.521,24	0,02	
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	14.282,42				14.282,42	0,00	
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	540.000,00				540.000,00	0,05	
<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR</b>	<b>18.714.114,72</b>	<b>1,73</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>										
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	-170.654,34			%	100,000	-194.436,89	-0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	-0,22			%	100,000	-0,13	0,00
<b>Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	-1,86			%	100,000	-0,17	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	-1,19			%	100,000	-0,11	0,00
<b>Summe der kurzfristigen Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR</b>	<b>-194.437,30</b>	<b>-0,02</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
	Verwaltungsvergütung		EUR	-432.430,18				-432.430,18	-0,04	

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-16.223.264,09				-16.223.264,09	-1,49
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneidengeschäften		EUR	-10.720.336,23				-10.720.336,23	-0,98
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-4.713,17				-4.713,17	0,00
	Kostenpauschale		EUR	-115.314,69				-115.314,69	-0,01
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-11.520.000,00				-11.520.000,00	-1,06
	Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-1.979,61				-1.979,61	0,00
	<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-39.018.037,97</b>	<b>-3,58</b>
	<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>1.091.585.527,96</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile Klasse CF</b>						<b>STK</b>	<b>6.594.320,000</b>	
	<b>Umlaufende Anteile Klasse TF (A)</b>						<b>STK</b>	<b>4.458.803,000</b>	
	<b>Anteilwert Klasse CF</b>						<b>EUR</b>	<b>101,46</b>	
	<b>Anteilwert Klasse TF (A)</b>						<b>EUR</b>	<b>94,77</b>	
	<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>93,29</b>
	<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>0,55</b>

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

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

2) In dieser Position enthalten sind die für sonstige Derivate hinterlegten Sicherheiten.

## Zusätzliche Angaben zu den Derivaten\*\*)

Instrumentenart	Kontrahent	Counterparty Exposure in EUR
Devisenterminkontrakte	BofA Securities Europe S.A.	-670.193,42
Zinsterminkontrakte	Eurex Deutschland	5.325.280,00
Zinsswaps	Citigroup Global Markets Europe AG	-205.012,85
Credit Default Swaps	BNP Paribas S.A.	411.535,16
Credit Default Swaps	BofA Securities Europe S.A.	24.577,54
Credit Default Swaps	Citigroup Global Markets Europe AG	88.347,97
Credit Default Swaps	Goldman Sachs Bank Europe SE	125.226,09
Credit Default Swaps	J.P. Morgan SE	836.563,15

## Gesamtbetrag der bei Derivaten hinterlegten Sicherheiten

Euro-Guthaben bei:	
Citigroup Global Markets Europe AG	540.000,00

## Gesamtbetrag der bei Derivaten hinterlegten Sicherheiten

Euro-Guthaben von:	
BNP Paribas S.A.	310.000,00
J.P. Morgan SE	930.000,00
NatWest Markets N.V.	10.280.000,00

\*\*\*) Bei den angegebenen Beträgen handelt es sich um Marktwerte. Der Anrechnungsbetrag der aufgeführten Derivate beläuft sich auf insgesamt 646.896.007,84 EUR.

## 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	
3,3750 % ABB Finance B.V. MTN 23/31	EUR 500.000		494.627,50	
0,3750 % Acciona Energia Fin. Fil. SA MTN 21/27	EUR 2.500.000		2.185.512,50	
3,8750 % ACEA S.p.A. MTN 23/31	EUR 2.000.000		1.988.700,00	
1,7500 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Notes 20/27	EUR 1.000.000		940.250,00	
2,3750 % Alcon Finance B.V. Notes 22/28	EUR 825.000		771.309,00	
4,0000 % ALD S.A. MTN 22/27	EUR 1.000.000		1.012.425,00	
0,0000 % Allianz Finance II B.V. Zero MTN 21/26	EUR 900.000		805.221,00	
1,3750 % American Medical Syst.Eu. B.V. Notes 22/28	EUR 866.000		781.062,72	
1,2500 % Andorra MTN 22/27	EUR 1.000.000		907.200,00	
1,3750 % ASML Holding N.V. Notes 16/26	EUR 2.500.000		2.363.675,00	
1,6250 % ASML Holding N.V. Notes 16/27	EUR 400.000		376.306,00	
1,1250 % Autoroutes du Sud de la France MTN 17/26	EUR 1.000.000		936.735,00	
1,5000 % Ball Corp. Notes 19/27	EUR 2.000.000		1.780.000,00	
4,6250 % Banco Bilbao Vizcaya Ar. FLR N.-Pref. MTN 23/31	EUR 1.200.000		1.220.166,00	
2,8380 % Banco Santander S.A. FLR Preferred MTN 23/25	EUR 1.000.000		1.001.540,00	
1,9490 % Bank of America Corp. FLR MTN 22/26	EUR 500.000		472.867,50	
6,7500 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 22/33	EUR 3.000.000		3.143.385,00	
4,8750 % Bank of Ireland Group PLC FLR MTN 23/28	EUR 1.775.000		1.799.992,00	
0,8750 % Bankinter S.A. Preferred Bonos 19/24	EUR 2.000.000		1.948.330,00	
2,7980 % Barclays PLC FLR MTN 21/26	EUR 600.000		591.834,00	
7,3850 % Barclays PLC FLR Notes 22/28	USD 1.404.000		1.403.343,89	
1,2500 % Bca Pop. di Sondrio S.c.p.A. FLR MTN 21/27	EUR 450.000		389.065,50	
0,0000 % BMW Finance N.V. MTN 21/26	EUR 1.000.000		915.575,00	
2,7250 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 17/24	EUR 1.500.000		1.511.902,50	
5,1250 % BPCE S.A. FLR MTN 23/35	EUR 2.000.000		1.990.550,00	
1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24	EUR 1.000.000		985.865,00	
0,0400 % Canadian Imperial Bk of Comm. MT Cov. Bonds 19/27	EUR 600.000		521.982,00	

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal	in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
			befristet	unbefristet	
1,6250 % Capgemini SE Notes 20/26	EUR	1.000.000		949.550,00	
2,5520 % Coloplast Finance B.V. FLR MTN 22/24	EUR	1.000.000		1.005.365,00	
4,0000 % Commerzbank AG T2 Nachr. MTN S.874 17/27	EUR	1.500.000		1.482.585,00	
2,1460 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 17/27	EUR	800.000		768.756,00	
1,6250 % Crédit Agricole S.A. FLR MTN 20/30	EUR	1.000.000		929.105,00	
1,6250 % Daimler Truck Intl Finance MTN 22/27	EUR	500.000		460.155,00	
1,3750 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/26	EUR	1.400.000		1.326.696,00	
6,7200 % Deutsche Bank AG FLR Notes 23/29	USD	500.000		482.612,32	
1,9000 % Discovery Communications LLC Notes 15/27	EUR	2.000.000		1.829.440,00	
1,2500 % Dover Corp. Notes 16/26	EUR	1.600.000		1.460.569,60	
1,8750 % Edenred SE Notes 17/27	EUR	1.500.000		1.427.932,50	
5,9430 % EDP - Energias de Portugal SA FLR MTN 23/83	EUR	2.200.000		2.196.700,00	
1,6250 % EDP Finance B.V. MTN 18/26	EUR	900.000		852.381,00	
3,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/30	EUR	2.000.000		2.020.400,00	
1,6250 % Eli Lilly and Company Notes 15/26	EUR	400.000		378.546,40	
6,6250 % ENEL S.p.A. FLR Nts 23/Und.	EUR	2.200.000		2.245.210,00	
6,3750 % ENEL S.p.A. FLR Nts. 23/Und.	EUR	4.000.000		4.087.500,01	
1,3750 % Engie S.A. MTN 20/25	EUR	500.000		478.762,50	
1,3820 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 20/26	EUR	2.500.000		2.322.312,50	
5,4000 % General Motors Co. Notes 22/29	USD	615.000		560.021,91	
0,8750 % GN Store Nord AS MTN 21/24	EUR	2.000.000		1.840.000,00	
3,0000 % GSK Capital B.V. MTN 22/27	EUR	1.900.000		1.884.990,00	
4,8750 % Iberdrola Finanzas S.A. FLR MTN 23/Und.	EUR	4.500.000		4.440.937,50	
0,0100 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfe.21/28	EUR	500.000		424.172,50	
0,6250 % International Bank Rec. Dev. MTN 18/27	EUR	500.000		449.750,00	
1,5000 % Iren S.p.A. MTN 17/27	EUR	2.000.000		1.816.030,00	
1,5000 % ISS Global A/S MTN 17/27	EUR	2.000.000		1.785.920,00	
0,8750 % ISS Global A/S MTN 19/26	EUR	1.632.000		1.462.345,45	
1,3750 % ITV PLC Notes 19/26	EUR	960.000		877.992,00	
3,0000 % KBC Groep N.V. MTN 22/30	EUR	500.000		472.915,00	
4,8750 % Klabin Austria GmbH Notes 17/27 Reg.S	USD	1.000.000		900.282,24	
0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25	EUR	7.000.000		6.707.260,00	
0,0000 % Königreich Niederlande Anl. 20/27	EUR	2.000.000		1.812.840,00	
2,7500 % Königreich Spanien Bonos 14/24	EUR	200.000		199.948,00	
2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25	EUR	2.000.000		1.965.700,00	
1,0000 % Linde PLC MTN 22/27	EUR	2.100.000		1.934.541,00	
4,5000 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 23/29	EUR	3.000.000		3.043.755,00	
2,1000 % Mastercard Inc. Notes 15/27	EUR	1.500.000		1.428.180,00	
3,0000 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 22/28	EUR	1.390.000		1.360.115,00	
3,2730 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. FLR MTN 22/25	EUR	630.000		624.279,60	
2,2500 % Mytilineos S.A. Notes 21/26	EUR	500.000		465.000,00	
4,2750 % National Grid PLC MTN 23/35	EUR	3.000.000		2.990.370,00	
7,4160 % NatWest Group PLC FLR MTN 22/33	GBP	3.000.000		3.584.133,26	
1,1250 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 20/26	EUR	745.000		710.145,18	
0,8750 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 22/27	EUR	2.000.000		1.853.560,00	
3,2500 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 22/31	EUR	832.000		836.688,32	
1,6250 % Nexi S.p.A. Nts 21/26 Reg.S	EUR	1.000.000		897.500,00	
1,6250 % Novartis Finance S.A. Notes 14/26	EUR	1.400.000		1.326.535,00	
1,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. MTN 22/27	EUR	2.000.000		1.838.370,00	
0,0000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. Notes 21/24	EUR	1.500.000		1.436.580,00	
3,6000 % PepsiCo Inc. Notes 22/28	USD	500.000		450.825,89	
4,2500 % Pirelli & C. S.p.A. MTN 23/28	EUR	500.000		498.967,50	
0,8750 % PPG Industries Inc. Notes 16/25	EUR	500.000		468.852,50	
3,8750 % Prologis Euro Finance LLC Notes 23/30	EUR	10.100.000		9.984.001,50	
4,8750 % Prudential PLC MTN 17/Und.	USD	2.000.000		1.629.796,89	
4,6250 % RCI Banque S.A. MTN 23/26	EUR	621.000		624.390,66	
1,0000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. MTN 16/26	EUR	1.800.000		1.679.950,80	
0,5000 % Republik Österreich Bundesanl. 17/27	EUR	1.300.000		1.191.372,00	
1,5000 % Republik Polen MTN 15/25	EUR	980.000		944.465,20	
1,3750 % Republik Polen MTN 17/27	EUR	2.000.000		1.839.280,00	
1,1250 % Republik Polen MTN 18/26	EUR	1.950.000		1.829.392,50	
6,6250 % Republik Rumänien MTN 23/28 Reg.S	USD	2.000.000		1.917.827,23	
1,2500 % Republik Slowenien Bonds 17/27	EUR	600.000		561.172,20	
5,6600 % Royal Bank of Canada MTN 22/24	USD	500.000		469.920,88	
0,3750 % Sandvik AB MTN 21/28	EUR	400.000		337.880,00	
7,0980 % Santander UK Group Hldgs PLC FLR MTN 22/27	GBP	2.500.000		2.977.135,87	
0,5000 % SBAB Bank AB (publ) Preferred MTN 22/27	EUR	1.000.000		881.285,00	
0,8750 % Schneider Electric SE MTN 15/25	EUR	500.000		477.305,00	
6,2500 % SK Hynix Inc. Notes 23/26 Reg.S	USD	1.000.000		933.660,30	
6,3750 % SK Hynix Inc. Notes 23/28 Reg.S	USD	1.000.000		938.569,38	
0,7500 % Snam S.p.A. MTN 22/29	EUR	500.000		413.770,00	
2,8750 % Statkraft AS MTN 22/29	EUR	225.000		219.979,13	
0,8290 % The Export-Import Bk of Korea MTN 20/25	EUR	2.000.000		1.892.830,00	
2,7320 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR MTN 22/25	EUR	753.000		754.995,45	
3,5000 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV MTN 23/28	EUR	750.000		751.785,00	
7,2500 % Unicaja Banco S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/27	EUR	300.000		306.874,50	
0,5000 % UniCredit S.p.A. Preferred MTN 19/25	EUR	900.000		839.241,00	
1,2500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 20/25	EUR	400.000		385.157,60	
0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 22/26	EUR	800.000		746.832,00	
1,0000 % United Parcel Service Inc. Notes 16/28	EUR	2.800.000		2.464.476,00	

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
3,0000 % Universal Music Group N.V. MTN 22/27	EUR 1.825.000		1.776.455,00	
3,2500 % Vodafone International Fin.DAC MTN 22/29	EUR 620.000		611.887,30	
1,2500 % Wabtec Transportation NL B.V. Notes 21/27	EUR 500.000		433.845,00	
0,2500 % Wolters Kluwer N.V. Notes 21/28	EUR 1.200.000		1.029.930,00	
5,1250 % Zurich Finance (Ireland) DAC FLR MTN 22/52	GBP 1.800.000		1.932.413,11	
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>			<b>157.071.380,29</b>	<b>157.071.380,29</b>

## Kontrahenten bei Wertpapier-Darlehen:

DekaBank Deutsche Girozentrale 157.071.380,29 EUR

## Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen empfangenen Sicherheiten:

Aktien und aktienähnliche Wertpapiere 26.688.644,51 EUR

Renten und rentenähnliche Wertpapiere 163.083.353,65 EUR

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Renten und Derivate per: 30./31.01.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.01.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.01.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund (GBP)	0,87769 = 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen (DKK)	7,43905 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen (NOK)	10,84175 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen (SEK)	11,28680 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken (CHF)	1,00333 = 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty (PLN)	4,71230 = 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen (CZK)	23,83800 = 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint (HUF)	388,83500 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar (USD)	1,08065 = 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso (MXN)	20,30960 = 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar (NZD)	1,68155 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

### OTC

Over-the-Counter

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.01.2023 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Devisentermingeschäfte (Verkauf)	GBP/EUR	19,5 Mio.	EUR	22.192.400,16
	USD/EUR	216,2 Mio.	EUR	199.677.081,28
			<b>EUR</b>	<b>221.869.481,44</b>
Finanztermingeschäfte - verkaufte Terminkontrakte auf Renten			<b>EUR</b>	<b>329.011.500,00</b>

## 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
	157.071.380,29	14,39

### 10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	157.071.380,29	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	157.071.380,29

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

## 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 Anleiherrating, 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 Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindex (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX 50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder des GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter [www.eurexrepo.com](http://www.eurexrepo.com) entnommen werden.

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

## Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

### Wertpapier-Darlehen

CHF  
EUR  
USD

## Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

### Wertpapier-Darlehen

unbefristet

### Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

189.771.998,17

## Ertrags- und Kostenanteile

### Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	171.629,39	100,00
Kostenanteil des Fonds	56.637,59	33,00
Ertragsanteil der KVG	56.637,59	33,00

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften 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 Wertpapierleihebesätzen 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

15,42% (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
Novo Banco S.A.	20.341.872,31
Kreditanstalt für Wiederaufbau	18.039.652,22
RELX Capital Inc.	17.511.154,71
Bausparkasse Schwäbisch Hall AG - Bausparkasse der Volksbanken und Raiffeisenbanken	14.638.996,27
Lonza Group AG	11.932.368,81
Naturgy Finance B.V.	11.752.609,59
Bayer US Finance LLC	9.797.108,95
Philip Morris International Inc.	9.482.607,25
BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse AG	7.997.875,07
Salesforce Inc.	6.347.073,89

## 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

Clearstream Banking Frankfurt	2	63.349.899,56 EUR
J.P.Morgan AG Frankfurt		126.422.098,61 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.

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

## Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten / Depots	0,00
Sammelkonten / Depots	0,00
andere Konten / Depots	0,00
Verwahrt bestimmt Empfänger	0,00

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

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

## 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>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS2410368042	0,7500 % A.P.Moeller-Maersk A/S MTN 21/31	EUR	0	1.000.000
XS1789699607	1,7500 % A.P.Møller-Mærsk A/S MTN 18/26	EUR	500.000	1.500.000
XS2491189408	2,5000 % A2A S.p.A. MTN 22/26	EUR	2.425.000	2.425.000
XS2534976886	4,5000 % A2A S.p.A. MTN 22/30	EUR	3.800.000	3.800.000
DE000AAR0264	0,5000 % Aareal Bank AG MTN IHS S.301 20/27	EUR	0	300.000
DE000A289LU4	0,2500 % Aareal Bank AG MTN IHS S.304 20/27	EUR	0	500.000
DE000AAR0298	0,0500 % Aareal Bank AG MTN IHS S.311 21/26	EUR	0	1.000.000
XS1767087940	2,1040 % ACEA S.p.A. FLR MTN 18/23	EUR	0	4.825.000
XS1180651587	4,2500 % Achmea B.V. FLR MTN 15/Und.	EUR	0	1.000.000
XS2386592484	0,1250 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. MTN 21/28	EUR	0	1.000.000
XS2080767010	1,8750 % AIB Group PLC FLR MTN 19/29	EUR	0	2.000.000
XS2491963638	3,6250 % AIB Group PLC FLR MTN 22/26	EUR	2.325.000	2.325.000
XS2464405229	2,2500 % AIB Group PLC FLR MTN 22/28	EUR	3.300.000	3.300.000
XS1799975765	1,5000 % AIB Group PLC MTN 18/23	EUR	0	925.000
XS2251233651	1,1250 % Akelius Resid.Ppty Fincng B.V. MTN 20/29	EUR	0	1.000.000
XS2341269970	1,1250 % Aker BP ASA MTN 21/29	EUR	0	200.000
XS1647404554	0,8750 % ALD S.A. MTN 17/22	EUR	0	2.500.000
FR001400D7M0	4,7500 % ALD S.A. MTN 22/25	EUR	1.900.000	1.900.000
XS2444281260	0,8750 % Alfa Laval Treasury Intl. AB MTN 22/26	EUR	875.000	875.000
DE000A1YQC29	4,7500 % Allianz SE FLR MTN 13/Und.	EUR	0	1.500.000
XS2206380573	1,5000 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 20/23	EUR	0	175.000
XS2206379567	2,2500 % AMCO - Asset Management Co.SpA MTN 20/27	EUR	0	150.000
XS2123371887	1,6000 % American Honda Finance Corp. MTN S.A 20/22	EUR	0	1.050.000
XS2393701284	0,4000 % American Tower Corp. Notes 21/27	EUR	750.000	2.300.000
XS2346207892	0,8750 % American Tower Corp. Notes 21/29	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2195511006	6,0000 % ams-OSRAM AG Anl. 20/25 Reg.S	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1645519031	1,6500 % Annington Funding PLC MTN 17/24	EUR	0	1.000.000
XS2346972263	3,0000 % Arcelik A.S. Notes 21/26 Reg.S	EUR	0	500.000
XS2412267358	1,0000 % ASTM S.p.A. MTN 21/26	EUR	0	1.575.000
XS1069439740	3,8750 % AXA S.A. FLR MTN 14/Und.	EUR	0	1.500.000
XS2081611993	1,6250 % Azimut Holding S.p.A. Bonds 19/24	EUR	0	1.000.000
XS2432565005	1,0000 % Balder Finland Oyj MTN 22/27	EUR	0	950.000
XS1594368539	0,0300 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. FLR MTN 17/22	EUR	0	6.000.000
XS1788584321	2,5770 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. FLR Non-Pr. MTN 18/23	EUR	0	6.000.000
XS1678372472	0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Non-Pref. MTN 17/22	EUR	0	4.000.000
XS2534785865	3,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/27	EUR	2.100.000	2.100.000
XS2353366268	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28	EUR	0	1.000.000
XS2528155893	5,3750 % Banco de Sabadell S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26	EUR	5.000.000	5.000.000
XS1991397545	1,7500 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	0	1.000.000
XS2055190172	1,1250 % Banco de Sabadell S.A. Non-Preferred MTN 19/25	EUR	0	1.000.000
XS2028816028	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. Preferred MTN 19/25	EUR	0	1.000.000
XS1557268221	1,3750 % Banco Santander S.A. 2nd Ranking Notes 17/22	EUR	0	4.000.000
XS1608362379	2,1850 % Banco Santander S.A. FLR 2nd Rank. MTN 17/23	EUR	0	10.000.000
XS1689234570	2,8910 % Banco Santander S.A. FLR Non-Pref. MTN 17/23	EUR	0	2.500.000
XS2014287937	0,2500 % Banco Santander S.A. Preferred MTN 19/24	EUR	0	1.000.000
XS2023633931	0,7500 % Bank of Ireland Group PLC FLR Preferred MTN 19/24	EUR	0	2.300.000
XS1872038218	1,3750 % Bank of Ireland Group PLC MTN 18/23	EUR	0	450.000
XS1640827843	0,5000 % Bank of Queensland Ltd. MT Mortg.Cov.Bds 17/22	EUR	0	725.000
XS2003420465	0,1250 % Bank of Queensland Ltd. MT Mortg.Cov.Bds 19/24	EUR	0	250.000
ES0213679HN2	0,8750 % Bankinter S.A. Non-Pref. Obl. 19/26	EUR	0	900.000
XS2150054026	3,3750 % Barclays Bank PLC FLR MTN 20/25	EUR	0	2.400.000
XS1716820029	0,6250 % Barclays PLC FLR MTN 17/23	EUR	0	5.000.000
XS1678970291	2,0000 % Barclays PLC FLR MTN 17/28	EUR	0	4.000.000
XS2082324364	0,7500 % Barclays PLC FLR MTN 19/25	EUR	0	4.000.000
XS2430951660	0,8770 % Barclays PLC FLR MTN 22/28	EUR	0	1.425.000
XS1531174388	1,8750 % Barclays PLC MTN 16/23	EUR	0	4.000.000
BE6303010472	1,6250 % Belfius Bank S.A. FLR MTN 18/28	EUR	0	1.700.000

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
BE6315719490	0,0000 % Belfius Bank S.A. Preferred MTN 19/26	EUR	0	200.000
XS1548436473	0,7500 % BMW Finance N.V. MTN 17/24	EUR	0	800.000
XS2447561403	0,5000 % BMW Finance N.V. MTN 22/25	EUR	4.175.000	4.175.000
FR0013465358	0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 19/26	EUR	0	1.600.000
FR0014006NI7	0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28	EUR	0	1.500.000
XS1637277572	1,0000 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 17/24	EUR	0	5.625.000
FR0013405537	1,1250 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	0	1.800.000
FR0014007VJ6	1,7500 % BPCE S.A. FLR MTN 22/34	EUR	0	1.100.000
FR0014007LL3	0,5000 % BPCE S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/28	EUR	1.100.000	3.000.000
FR0013323672	2,6020 % BPCE S.A. FLR Non-Preferred MTN 18/23	EUR	0	4.900.000
FR0013429073	0,6250 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	0	1.000.000
XS243828071	3,8750 % BPER Banca S.p.A. FLR MTN 22/32	EUR	0	1.000.000
FR0014003SA0	0,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Non-Pref. MTN 21/28	EUR	0	1.000.000
FR0014007PV3	0,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Non-Pref. MTN 22/27	EUR	1.800.000	3.000.000
FR0014006XE5	0,0100 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Preferred MTN 21/25	EUR	0	1.900.000
XS2051494222	0,5000 % British Telecommunications PLC MTN 19/25	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2579483319	4,5000 % Bulgarien Bonds 23/33 Reg.S	EUR	1.825.000	1.825.000
XS2536817211	4,1250 % Bulgarien MTN 22/29	EUR	2.575.000	2.575.000
FR0013255858	0,3750 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 17/24	EUR	0	900.000
PTCGDNOM0026	2,8750 % Caixa Geral de Depósitos S.A. FLR Pref. MTN 22/26	EUR	1.900.000	1.900.000
XS2258971071	0,3750 % Caixabank S.A. FLR Non-Pref. MTN 20/26	EUR	0	4.000.000
XS2468378059	1,6250 % Caixabank S.A. FLR Non-Pref. MTN 22/26	EUR	4.400.000	4.400.000
XS1752476538	0,7500 % Caixabank S.A. MTN 18/23	EUR	0	6.000.000
ES0313307219	1,0000 % Caixabank S.A. Non-Preferred Bonos 19/24	EUR	0	500.000
ES0313307201	0,8750 % Caixabank S.A. Preferred Bonos 19/24	EUR	0	3.200.000
XS1968846532	1,1250 % Caixabank S.A. Preferred MTN 19/26	EUR	0	1.000.000
XS2009011771	0,8000 % Capital One Financial Corp. Notes 19/24	EUR	0	2.900.000
FR0014009DZ6	1,8750 % Carrefour S.A. MTN 22/26	EUR	2.100.000	2.100.000
FR0014000DF9	4,1250 % Carrefour S.A. MTN 22/28	EUR	3.400.000	3.400.000
IT0005514390	5,8750 % CDP RETI S.p.A. Obbl. 22/27	EUR	3.100.000	3.100.000
XS1713474671	1,2500 % Celanese US Holdings LLC Notes 17/25	EUR	0	2.575.000
XS2497520705	4,7770 % Celanese US Holdings LLC Notes 22/26	EUR	2.025.000	2.025.000
XS2497520887	5,3370 % Celanese US Holdings LLC Notes 22/29	EUR	975.000	975.000
XS2300292617	0,7500 % Cellnex Finance Company S.A. MTN 21/26	EUR	0	2.000.000
XS2102934697	1,0000 % Cellnex Telecom S.A. MTN 20/27	EUR	0	100.000
XS1795253134	2,5630 % Citigroup Inc. FLR MTN 18/23	EUR	0	5.000.000
XS1823623878	1,8750 % CNH Industrial Finance Euro.SA MTN 18/26	EUR	0	1.000.000
DE000CZ45WX9	2,8630 % Commerzbank AG FLR MTN S.990 21/23	EUR	0	2.000.000
DE000CZ45W57	3,0000 % Commerzbank AG FLR MTN S.992 22/27	EUR	1.400.000	1.400.000
DE000CZ45V25	4,0000 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 20/30	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1962554785	0,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 19/24	EUR	0	6.900.000
XS2150053721	1,7500 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 20/23	EUR	0	2.200.000
XS2517103250	1,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 22/25	EUR	600.000	600.000
XS2517103334	2,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 22/32	EUR	600.000	600.000
ES0000101909	1,5710 % Comunidad Autónoma de Madrid Obl. 19/29	EUR	0	400.000
XS2178585423	2,1250 % Conti-Gummi Finance B.V. MTN 20/23	EUR	0	200.000
XS2051667181	0,0000 % Continental AG MTN 19/23 Reg.S	EUR	0	2.325.000
XS2182121827	1,6250 % Corporación Andina de Fomento MTN 20/25	EUR	0	5.000.000
XS2296027217	0,2500 % Corporación Andina de Fomento MTN 21/26	EUR	0	450.000
XS1716946717	0,6250 % Council Auckland MTN 17/24	EUR	0	750.000
XS2055663764	0,1250 % Council Auckland MTN 19/29	EUR	0	250.000
FR0013508512	1,0000 % Crédit Agricole S.A. FLR Non-Pref. MTN 20/26	EUR	0	1.000.000
XS1787278008	2,5750 % Crédit Agricole S.A. FLR NP.MTN 18/23	EUR	0	2.200.000
XS2067135421	0,3750 % Crédit Agricole S.A. Non-Preferred MTN 19/25	EUR	0	1.000.000
XS2381671671	0,2500 % Credit Suisse AG MTN 21/28	EUR	0	800.000
CH0343366842	1,2500 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 17/25	EUR	0	6.850.000
CH1214797172	7,7500 % Credit Suisse Group AG FLR MTN 22/29	EUR	5.800.000	5.800.000
IT0004955271	4,1500 % Credito Emiliano S.p.A. Mortg.Cov. Bds 13/28	EUR	0	500.000
XS2168478068	1,2500 % CRH SMW Finance DAC MTN 20/26	EUR	0	2.000.000
ES0305045009	1,3750 % Criteria Caixa S.A.U. MTN 19/24	EUR	0	4.200.000
XS2443438051	1,3750 % Danske Bank AS FLR Non-Pref. MTN 22/27	EUR	2.025.000	2.025.000
XS1760125283	0,1250 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN Öff.-Pfe. A.143 18/23	EUR	0	7.000.000
DE000DL19VR6	1,0000 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/25	EUR	0	2.400.000
DE000DL19VP0	1,3750 % Deutsche Bank AG FLR MTN 20/26	EUR	0	1.000.000
DE000DL19U23	1,6250 % Deutsche Bank AG MTN 20/27	EUR	0	1.000.000
DE000DL19VB0	5,6250 % Deutsche Bank AG Sub. FLR MTN 20/31	EUR	500.000	500.000
DE000DL19WN3	4,0000 % Deutsche Bank AG Sub. FLR MTN 22/32	EUR	2.600.000	2.600.000
ES0413320096	0,5000 % Deutsche Bank S.A.E. Cédulas Hipotec. 18/24	EUR	0	1.000.000
DE000A289N78	1,2500 % Deutsche Börse AG FLR Sub. Anl. 20/47	EUR	0	2.000.000
XS2265369657	3,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN 20/26	EUR	0	1.000.000
DE000A2NBKK3	0,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35325 19/24	EUR	0	700.000
DE000A3TOX97	0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35413 22/25	EUR	0	2.100.000
XS1382792197	0,6250 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 16/23	EUR	0	3.000.000
XS1557096267	0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/24	EUR	3.000.000	3.000.000
XS1617898363	1,1250 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 17/26	EUR	1.000.000	1.000.000
DE000A289NE4	1,0000 % Deutsche Wohnen SE Anl. 20/25	EUR	0	1.300.000
XS1395180802	2,6250 % Digital Euro Finco LLC Notes 16/24	EUR	0	1.500.000
XS1991114858	3,0000 % Dometic Group AB MTN 19/26	EUR	1.000.000	3.000.000
XS1652512457	1,3750 % DS Smith PLC MTN 17/24	EUR	0	3.000.000
XS0982019126	3,0000 % E.ON Intl Finance B.V. MTN 13/24	EUR	0	1.300.000

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2047500769	0,0000 % E.ON SE MTN 19/24	EUR	0	3.000.000
XS2463505581	0,8750 % E.ON SE MTN 22/25	EUR	2.100.000	2.100.000
XS2433244246	0,8750 % E.ON SE MTN 22/34	EUR	0	700.000
XS2306601746	1,8750 % easyJet FinCo B.V. MTN 21/28	EUR	0	500.000
PTEDPKOM0034	4,4960 % EDP - Energias de Portugal SA FLR Securities 19/79	EUR	0	3.000.000
PTEDPLOM0017	1,7000 % EDP - Energias de Portugal SA FLR Securities 20/80	EUR	0	1.000.000
XS1999902502	0,3750 % Emerson Electric Co. Notes 19/24	EUR	0	3.050.000
XS1207079499	1,7500 % Emirates NBD PJSC MTN 15/22	EUR	0	5.000.000
XS1937665955	1,5000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 19/25	EUR	0	3.000.000
XS2390400633	0,0000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 21/26	EUR	0	4.475.000
XS2390400716	0,3750 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 21/29	EUR	0	2.500.000
XS2432293673	0,2500 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 22/25	EUR	0	3.800.000
XS2531420656	3,8750 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 22/29	EUR	2.700.000	2.700.000
XS2312746345	1,8750 % ENEL S.p.A. FLR Nts 21/Und.	EUR	0	2.425.000
XS2312744217	1,3750 % ENEL S.p.A. FLR Nts 21/Und.	EUR	0	5.425.000
FR0013444775	0,0000 % Engie S.A. MTN 19/27	EUR	0	1.300.000
XS1982725159	0,3750 % Erste Group Bank AG Pref. MTN 19/24	EUR	0	1.000.000
XS1224953882	4,8750 % Eurofins Scientific S.E. FLR Notes 15/Und.	EUR	0	2.000.000
EU000A1G0DY0	0,8750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 17/27	EUR	0	250.000
EU000A3KWCF4	0,0000 % Europaeische Union MTN 21/28	EUR	0	225.000
EU000A1U9894	1,0000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) MTN 15/25	EUR	0	600.000
DE000A3ESWW4	1,3750 % Evonik Industries AG FLR Nachr.-Anl. 21/81	EUR	0	1.600.000
XS2485162163	2,2500 % Evonik Industries AG MTN 22/27	EUR	1.500.000	1.500.000
XS1573192058	1,1250 % Fastighets AB Balder Notes 17/22	EUR	0	3.000.000
XS2231792586	0,5000 % FCA Bank S.p.A. MTN 20/23	EUR	0	1.850.000
XS2332254015	0,0000 % FCA Bank S.p.A. MTN 21/24	EUR	0	1.000.000
ES0378641346	0,0500 % Fdo de Tit.D.Def.Sist.Elec.FTA MT Bonos 19/24	EUR	0	800.000
ES0205032016	0,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 16/22	EUR	0	2.400.000
XS1843436574	0,7500 % Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Notes 19/23	EUR	0	1.800.000
XS1979447064	0,3750 % Finnvera PLC MTN 19/29	EUR	0	300.000
XS2116728895	1,7440 % Ford Motor Credit Co. LLC MTN 20/24	EUR	0	1.000.000
XS2325562424	0,0000 % Fresenius Finance Ireland PLC MTN 21/25	EUR	0	2.150.000
XS2084497705	0,6250 % Fresenius Medical Care KGaA MTN 19/26	EUR	0	1.000.000
XS2178769076	1,0000 % Fresenius Medical Care KGaA MTN 20/26	EUR	0	1.000.000
XS2530444624	3,8750 % Fresenius Medical Care KGaA MTN 22/27	EUR	2.425.000	2.425.000
XS2559580548	4,2500 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 22/26	EUR	1.200.000	1.200.000
XS2559501429	5,0000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN 22/29	EUR	1.600.000	1.600.000
PTGALCOM0013	2,0000 % Galp Energia SGPS S.A. MTN 20/26	EUR	500.000	1.000.000
XS2444424639	1,0000 % General Motors Financial Co. MTN 22/25	EUR	1.425.000	1.425.000
XS2170609403	0,1250 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 20/23	EUR	0	2.775.000
GR0118017657	3,3750 % Griechenland Notes 18/25	EUR	0	1.000.000
GR0114032577	0,0000 % Griechenland Notes 21/26	EUR	0	900.000
XS2553817763	3,1250 % GSK Capital B.V. MTN 22/32	EUR	1.275.000	1.275.000
XS2303070911	0,2500 % H&M Finance B.V. MTN 21/29	EUR	0	1.575.000
XS1589806907	1,6250 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 17/26	EUR	0	1.225.000
XS1863994981	0,5000 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. MTN 18/22	EUR	0	2.000.000
DE000A255DH9	3,2500 % HORNBAACH Baumarkt AG Anl. 19/26	EUR	0	2.000.000
XS2386287762	0,0100 % HSBC Bank Canada Mortg. Cov. Bonds 21/26	EUR	0	1.000.000
XS2455983861	1,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. MTN 22/32	EUR	1.900.000	1.900.000
IT0005459067	0,0100 % ICCREA Banca - Ist.C.d.Cred.C. MT Cov. Bds 21/28	EUR	0	700.000
XS2413696761	0,1250 % ING Groep N.V. FLR MTN 21/25	EUR	0	2.800.000
XS1689540935	1,6250 % ING Groep N.V. FLR MTN 17/29	EUR	0	3.000.000
XS1882544205	2,8970 % ING Groep N.V. FLR MTN 18/23	EUR	0	6.000.000
XS2079079799	1,0000 % ING Groep N.V. FLR MTN 19/30	EUR	0	3.000.000
XS2390506546	0,3750 % ING Groep N.V. FLR MTN 21/28	EUR	0	3.100.000
XS2483607474	2,1250 % ING Groep N.V. FLR MTN 22/26	EUR	2.600.000	2.600.000
XS2443920249	1,2500 % ING Groep N.V. FLR MTN 22/27	EUR	2.400.000	2.400.000
XS1882544627	1,0000 % ING Groep N.V. MTN 18/23	EUR	0	1.000.000
XS1808395930	2,0000 % Inmobiliaria Colonial SOCIMI MTN 18/26	EUR	1.500.000	1.500.000
XS2240494471	1,6250 % InterContinental Hotels Group MTN 20/24	EUR	0	1.000.000
XS1599167589	0,3900 % Intesa Sanpaolo S.p.A. FLR MTN 17/22	EUR	0	5.000.000
XS2022425297	1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 19/24	EUR	115.000	965.000
XS1936100483	1,5000 % Israel MTN 19/29	EUR	0	500.000
FR001400FOH3	5,0000 % JCDecaux SE Bonds 23/29	EUR	2.200.000	2.200.000
XS2461234622	1,9630 % JPMorgan Chase & Co. FLR MTN 22/30	EUR	3.925.000	3.925.000
XS2382849888	0,0500 % Jyske Bank A/S FLR Non.-Pref. MTN 21/26	EUR	0	500.000
XS2544400786	4,6250 % Jyske Bank A/S FLR Non-Pref. MTN 22/26	EUR	1.650.000	1.650.000
XS2555918270	5,5000 % Jyske Bank A/S Non-Prefer. MTN 22/27	EUR	3.325.000	3.325.000
BE0974423569	2,8750 % KBC Groep N.V. FLR MTN 22/25	EUR	400.000	400.000
BE0002839208	0,7500 % KBC Groep N.V. FR MTN 22/28	EUR	0	3.400.000
XS2232027727	1,6250 % KION GROUP AG MTN 20/25	EUR	0	200.000
XS2534891978	3,2500 % Knorr-Bremse AG MTN 22/27	EUR	4.300.000	4.300.000
XS2239830222	1,3750 % Koenigreich Marokko Notes 20/26 Reg.S	EUR	0	1.000.000
XS1617533275	0,8750 % Kommunalbanken AS MTN 17/27	EUR	0	250.000
AT000A2R9G1	0,2500 % Kommunalkredit Austria AG Pref. MTN 21/24	EUR	0	600.000
ES00000123U9	5,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23	EUR	0	2.000.000
ES00000123X3	4,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23	EUR	0	2.000.000
ES00000128H5	1,3000 % Königreich Spanien Obligaciones 16/26	EUR	0	800.000
XS2149368529	1,3750 % Koninklijke Philips N.V. MTN 20/25	EUR	0	1.225.000
DE000A2GSKL9	0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 17/22	EUR	0	5.400.000



# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
FR00140009W6	0,8750 % La Banque Postale FLR MTN 20/31	EUR	0	2.800.000
XS1069776232	1,2500 % Landwirtschaftliche Rentenbank MTN S.1101 14/22	EUR	0	3.500.000
XS1820748538	1,1250 % LANXESS AG MTN 18/25	EUR	2.000.000	2.000.000
DE000A254P51	0,8750 % LEG Immobilien SE MTN 19/27	EUR	0	1.500.000
DE000A3MQNN9	0,3750 % LEG Immobilien SE MTN 22/26	EUR	0	1.200.000
XS1799641045	4,1250 % LKQ European Holdings B.V. Notes 18/28 Reg.S	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1633845158	2,8430 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 17/24	EUR	0	6.450.000
XS2148623106	3,5000 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 20/26	EUR	0	1.500.000
XS2576365188	7,2500 % Luminor Bank AS FLR Preferred MTN 23/26	EUR	725.000	725.000
XS1784246701	1,2500 % Macquarie Group Ltd. FLR MTN 18/25	EUR	3.000.000	3.000.000
XS1876097715	1,0580 % mBank S.A. MTN 18/22	EUR	0	325.000
XS1689739347	0,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA MTN 17/22	EUR	0	1.900.000
XS1960678099	0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 19/23	EUR	0	3.675.000
DE000A169G15	1,4000 % Mercedes-Benz Group AG MTN 16/24	EUR	0	800.000
DE000A289RN6	2,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. MTN 20/25	EUR	1.000.000	4.000.000
XS2102916793	0,1250 % Merck Financial Services GmbH MTN 20/25	EUR	1.300.000	1.300.000
XS2218405772	1,6250 % Merck KGaA FLR Sub.Anl. 20/80	EUR	0	500.000
XS1512827095	1,8750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. MTN 16/26	EUR	0	2.000.000
XS2010030752	1,3750 % MFB Magyar Fejlesztési Bk Zrt. Notes 20/25	EUR	0	575.000
XS2348280707	0,3750 % MFB Magyar Fejlesztési Bk Zrt. Notes 21/26	EUR	0	525.000
XS1401114811	2,6250 % MOL Magyar Olaj-és Gázipar.Nyrt Notes 16/23	EUR	0	3.000.000
XS2232045463	1,5000 % MOL Magyar Olaj-és Gázipar.Nyrt Notes 20/27	EUR	5.000.000	7.425.000
XS2381261424	1,0000 % Muenchener Rueckvers.-Gs. AG FLR Nachr. Anl. 21/42	EUR	0	2.500.000
XS2528341766	3,9490 % Nat.Gr.Elec.Distr.(East M.)PLC MTN 22/32	EUR	1.600.000	1.600.000
XS2390837495	0,0100 % National Bank of Canada MT Mortg. Cov. Bds 21/26	EUR	0	1.000.000
XS1645494375	1,0000 % National Grid North Amer. Inc. MTN 17/24	EUR	0	2.000.000
XS1864037541	0,7500 % National Grid North Amer. Inc. MTN 18/23	EUR	0	4.375.000
XS2434710799	0,4100 % National Grid North Amer. Inc. MTN 22/26	EUR	3.000.000	3.000.000
XS2385790667	0,2500 % Nationwide Building Society MTN 21/28	EUR	0	1.000.000
XS2525246901	3,2500 % Nationwide Building Society MTN 22/29	EUR	3.450.000	3.450.000
XS1590568132	1,1250 % Naturgy Capital Markets S.A. MTN 17/24	EUR	0	3.000.000
XS1788515861	0,6250 % NatWest Markets PLC MTN 18/22	EUR	0	6.950.000
XS2150006646	2,7500 % NatWest Markets PLC MTN 20/25	EUR	0	1.000.000
XS2407357768	0,1250 % NatWest Markets PLC MTN 21/25	EUR	0	2.250.000
XS2449911143	1,3750 % NatWest Markets PLC MTN 22/27	EUR	3.425.000	3.425.000
XS2443893255	1,1250 % Nordea Bank Abp Non Preferred MTN 22/27	EUR	1.500.000	1.500.000
XS2224439971	2,8750 % OMV AG FLR Notes 20/Und.	EUR	0	1.500.000
XS2224439385	2,5000 % OMV AG FLR Notes 20/Und.	EUR	0	2.000.000
XS2185867673	1,6250 % OP Yrityspankki Oyj FLR MTN 20/30	EUR	0	2.000.000
XS2436853035	0,6250 % OP Yrityspankki Oyj Non-Preferred MTN 22/27	EUR	0	2.400.000
XS1115498260	5,0000 % Orange S.A. FLR MTN 14/Und.	EUR	0	1.500.000
FR0013444676	0,0000 % Orange S.A. MTN 19/26	EUR	0	600.000
XS2346125573	1,1250 % Polski Koncern Naftowy Orlen MTN 21/28	EUR	0	125.000
XS2103230152	0,5000 % POSCO Holdings Inc. Notes 20/24 Reg.S	EUR	0	4.000.000
XS2439004339	1,9340 % Prologis Euro Finance LLC FLR Notes 22/24	EUR	1.500.000	1.500.000
XS2049582625	0,2500 % Prologis Euro Finance LLC Notes 19/27	EUR	2.500.000	2.500.000
XS2439004412	1,0000 % Prologis Euro Finance LLC Notes 22/29	EUR	750.000	750.000
XS2211183244	1,5390 % Prosus N.V. MTN 20/28 Reg.S	EUR	0	2.600.000
FR0013292687	2,2960 % RCI Banque S.A. FLR Pref. MTN 17/24	EUR	0	3.000.000
FR0013201597	0,5000 % RCI Banque S.A. MTN 16/23	EUR	0	2.000.000
FR0013412699	0,7500 % RCI Banque S.A. MTN 19/23	EUR	0	3.275.000
FR001400E904	4,1250 % RCI Banque S.A. MTN 22/25	EUR	4.025.000	4.025.000
FR001400B1L7	4,7500 % RCI Banque S.A. MTN 22/27	EUR	1.475.000	1.475.000
FR0014007KL5	0,5000 % RCI Banque S.A. Senior MTN 22/25	EUR	0	525.000
XS2107451069	2,5000 % RCS & RDS SA Bonds 20/25 Reg.S	EUR	1.000.000	1.000.000
PTRAAGOM0001	0,6030 % Região Autónoma Acores Notes 20/26	EUR	0	200.000
FR0014000N24	2,3750 % Renault S.A. MTN 20/26	EUR	0	2.300.000
FR0014006W65	2,5000 % Renault S.A. MTN 21/27	EUR	0	1.000.000
XS1207058733	4,5000 % Repsol Intl Finance B.V. FLR Securit. 15/75	EUR	0	1.000.000
IT0005135840	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 15/22	EUR	0	2.800.000
IT0005215246	0,6500 % Republik Italien B.T.P. 16/23	EUR	0	1.000.000
IT0005344335	2,4500 % Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	0	3.000.000
IT0005386245	0,3500 % Republik Italien B.T.P. 19/25	EUR	0	3.500.000
XS1501554874	0,3750 % Republik Lettland MTN 16/26	EUR	0	300.000
PTOTVLOE0001	1,1000 % Republik Portugal FLR Obr. 17/22	EUR	0	1.000.000
XS2262211076	1,3750 % Republik Rumänien MTN 20/29 Reg.S	EUR	0	100.000
XS2434895558	2,1250 % Republik Rumänien MTN 22/28 Reg.S	EUR	3.550.000	3.550.000
XS1934867547	2,0000 % Republik Rumänien MTN 19/26 Reg.S	EUR	0	2.675.000
XS2178857285	2,7500 % Republik Rumänien MTN 20/26 Reg.S	EUR	3.000.000	6.000.000
XS1457553367	3,7500 % Republik Zypern MTN 16/23	EUR	0	600.000
XS2049823680	1,1250 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB MTN 19/26	EUR	0	1.000.000
FR0013505104	1,0000 % Sanofi S.A. MTN 20/25	EUR	0	600.000
FR0014009K56	0,8750 % Sanofi S.A. MTN 22/25	EUR	1.900.000	1.900.000
XS1888206627	1,1250 % Santander Consumer Finance SA MTN 18/23	EUR	0	300.000
XS1799039976	2,9910 % Santander UK Group Hldgs PLC FLR MTN 18/24	EUR	0	6.450.000
XS2525226622	3,5300 % Santander UK Group Hldgs PLC FLR MTN 22/28	EUR	4.250.000	4.250.000
XS2102283814	0,0500 % Santander UK PLC MT Cov. Bds. 20/27	EUR	0	250.000
DE000A289Q91	2,7500 % Schaeffler AG MTN 20/25	EUR	0	1.000.000
XS2455401328	1,2500 % SEGRO Capital S.a.r.l. Notes 22/26	EUR	3.275.000	3.275.000
XS2455401757	1,8750 % SEGRO Capital S.a.r.l. Notes 22/30	EUR	1.075.000	1.075.000

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS1508586150	1,2500 % SELP Finance S.a.r.l. Notes 16/23	EUR	0	2.500.000
XS2511906310	3,7500 % SELP Finance S.a.r.l. Notes 22/27	EUR	1.800.000	1.800.000
XS1405765659	5,6250 % SES S.A. FLR Notes 16/Und.	EUR	0	1.500.000
XS2010028343	2,8750 % SES S.A. FLR Notes 21/Und.	EUR	1.000.000	1.000.000
XS2075811781	0,8750 % SES S.A. MTN 19/27	EUR	1.000.000	1.000.000
XS2182054887	0,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 20/26	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2442768227	0,7500 % Skandinaviska Enskilda Banken Non-Pref. MTN 22/27	EUR	1.175.000	1.175.000
XS1570260460	2,0000 % Smiths Group PLC MTN 17/27	EUR	0	2.300.000
FR0014000OZ2	1,0000 % Soci�t� G�n�rale S.A. FLR MTN 20/30	EUR	0	2.000.000
FR0014006IU2	0,1250 % Soci�t� G�n�rale S.A. FLR MTN 21/26	EUR	0	3.400.000
FR0014002QE8	1,1250 % Soci�t� G�n�rale S.A. FLR MTN 21/31	EUR	0	600.000
FR0014006XA3	0,6250 % Soci�t� G�n�rale S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/27	EUR	2.600.000	4.000.000
FR0013403441	1,2500 % Soci�t� G�n�rale S.A. Non-Preferred MTN 19/24	EUR	0	5.200.000
XS1323897725	5,8690 % Solvay Finance S.A. FLR Notes 15/Und.	EUR	0	2.000.000
XS2183818637	2,5000 % Standard Chartered PLC FLR MTN 20/30	EUR	0	2.000.000
XS2178832379	3,3750 % Stellantis N.V. MTN 20/23	EUR	0	200.000
XS2325733413	0,6250 % Stellantis N.V. MTN 21/27	EUR	0	425.000
XS0909773268	6,8750 % Storebrand Livsforsikring AS FLR Notes 13/43	EUR	0	3.000.000
XS2405390043	0,5000 % Sydbank AS FLR Non-Pref. MTN 21/26	EUR	0	825.000
XS1843449809	1,4910 % Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. FLR Nts 18/22 Reg.S	EUR	0	5.025.000
XS2347284742	1,1250 % Technip Energies N.V. Notes 21/28	EUR	0	1.000.000
XS1571293684	1,8750 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. MTN 17/24	EUR	0	2.000.000
FR0013346822	1,8750 % T�l�performance SE Obl. 18/25	EUR	2.500.000	2.500.000
XS1591694481	2,9950 % TenneT Holding B.V. FLR Securit. 17/Und.	EUR	0	2.736.000
XS2437854487	2,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA FLR Nts 22/Und.	EUR	1.325.000	1.325.000
XS1955024713	0,7500 % The Coca-Cola Co. Notes 19/26	EUR	1.000.000	1.000.000
XS1265805090	2,0000 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 15/23	EUR	0	1.300.000
XS1458408561	1,6250 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 16/26	EUR	0	1.000.000
XS2022179159	0,0000 % The Korea Development Bank MTN 19/24	EUR	0	300.000
XS21511301322	2,5510 % The Toronto-Dominion Bank MTN 22/27	EUR	3.325.000	3.325.000
XS2058556296	0,1250 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 19/25	EUR	0	1.900.000
XS2430284930	0,4400 % Toyota Finance Australia Ltd. MTN 22/28	EUR	0	1.075.000
XS2149270477	0,7500 % UBS AG MTN 20/23	EUR	0	3.525.000
CH1142231682	0,2500 % UBS Group AG FLR MTN 21/26	EUR	0	2.200.000
CH0409606354	1,2500 % UBS Group AG FLR Notes 18/25	EUR	0	5.000.000
CH0595205524	0,2500 % UBS Group AG MTN 21/28	EUR	0	6.850.000
XS2161992198	1,1250 % Ungarn Bonds 20/26	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2259191273	0,5000 % Ungarn Bonds 20/30	EUR	0	500.000
FR0014000UC8	0,6250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 20/27	EUR	0	2.500.000
ES0468675030	0,2500 % Unicaja Banco S.A. C�dulas Hipot. 19/29	EUR	0	300.000
XS2055089457	2,0000 % UniCredit S.p.A. FLR MTN 19/29	EUR	1.000.000	1.000.000
FR0013252061	2,8750 % Veolia Environnement S.A. FLR Notes 17/Und.	EUR	1.000.000	1.000.000
FR00140007K5	2,2500 % Veolia Environnement S.A. FLR Notes 20/Und.	EUR	0	1.500.000
XS2449928543	1,5000 % Vestas Wind Systems Finance BV MTN 22/29	EUR	1.200.000	1.200.000
XS2535725159	4,6250 % Vier Gas Transport GmbH MTN 22/32	EUR	2.000.000	2.000.000
XS1652855815	1,5000 % Vodafone Group PLC MTN 17/27	EUR	0	8.000.000
XS1150695192	4,8500 % Volvo Treasury AB FLR Capit. Secs 14/78	EUR	0	3.000.000
XS2115085230	0,0000 % Volvo Treasury AB MTN 20/23	EUR	0	1.000.000
XS2230884657	0,1250 % Volvo Treasury AB MTN 20/24	EUR	0	410.000
XS2440678915	0,6250 % Volvo Treasury AB MTN 22/25	EUR	1.650.000	1.650.000
XS2521820048	2,0000 % Volvo Treasury AB MTN 22/27	EUR	1.075.000	1.075.000
DE000A3E5MFO	0,0000 % Vonovia SE MTN 21/24	EUR	0	1.000.000
DE000A3MP4T1	0,0000 % Vonovia SE MTN 21/25	EUR	0	1.500.000
DE000A3MP4U9	0,2500 % Vonovia SE MTN 21/28	EUR	0	2.000.000
DE000A30VQA4	4,7500 % Vonovia SE MTN 22/27	EUR	5.700.000	5.700.000
DE000A30VQB2	5,0000 % Vonovia SE MTN 22/30	EUR	4.400.000	4.400.000
AT0000A2GLA0	2,7500 % Wienerberger AG Schuldv. 20/25	EUR	0	2.400.000
XS1575992596	1,5000 % Wolters Kluwer N.V. Notes 17/27	EUR	1.000.000	2.000.000
XS2231267829	0,6250 % Yorkshire Building Society Pref. MTN 20/25	EUR	0	2.000.000
XS2010040124	1,2500 % ZF Europe Finance B.V. Notes 19/23	EUR	0	100.000
XS2262961076	2,7500 % ZF Finance GmbH MTN 20/27	EUR	0	300.000
XS2338564870	2,0000 % ZF Finance GmbH MTN 21/27	EUR	0	2.200.000
<b>GBP</b>				
XS2513869862	4,7500 % Annington Funding PLC MTN 22/33	GBP	900.000	900.000
XS2553549903	8,2010 % HSBC Holdings PLC FLR MTN 22/34	GBP	1.825.000	1.825.000
XS2563787287	5,1250 % Segro PLC MTN 22/41	GBP	1.000.000	1.000.000
XS0241945582	5,3750 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 06/26	GBP	2.000.000	2.000.000
XS0181816652	5,6250 % Vodafone Group PLC MTN 03/25	GBP	0	3.200.000
<b>USD</b>				
XS1598047550	3,8750 % Africa Finance Corp. MTN 17/24 Reg.S	USD	0	375.000
US056752AS75	1,7200 % Baidu Inc. Notes 20/26	USD	0	1.000.000
US05964HAE53	3,1250 % Banco Santander S.A. Non-Preferred Nts 17/23	USD	0	3.000.000
USP15383CD50	4,2500 % Banistmo S.A. Notes 20/27 Reg.S	USD	0	2.850.000
USY0889VAC47	3,2500 % Bharti Airtel Ltd. Notes 21/31 Reg.S	USD	0	1.000.000
XS2230306537	2,0000 % CBQ Finance Ltd. MTN 20/25	USD	0	2.750.000
XS2265238639	0,8940 % Central Nippon Expr. Co. Ltd. MTN 20/25	USD	0	200.000
US172967LH22	1,2177 % Citigroup Inc. FLR Notes 17/22	USD	0	5.000.000
USP3146DAA11	3,6250 % Corp.Inmobil.Vesta SAB de CV Notes 21/31 Reg.S	USD	0	1.000.000
US219868CC84	2,3750 % Corporaci�n Andina de Fomento Notes 20/23	USD	0	2.000.000
US225401BB38	9,0160 % Credit Suisse Group AG FLR Notes 22/33 144A	USD	1.000.000	1.000.000

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US31572UAF30	5,5000 % Fibria Overseas Finance Ltd. Notes 17/27	USD	0	1.000.000
US345397C437	6,9500 % Ford Motor Credit Co. LLC Notes 23/26	USD	725.000	725.000
XS2126300479	3,0000 % Geely Finance (Hong Kong) Ltd. Notes 20/25	USD	0	1.000.000
XS2198897121	3,0000 % Goodman HK Finance MTN 20/30	USD	0	950.000
XS2207544722	1,6250 % GS Caltex Corp. Notes 20/25	USD	0	1.575.000
USU2479QAA59	1,3750 % HCL America Inc. Notes 21/26 Reg.S	USD	0	4.000.000
US42824CAN92	4,4000 % Hewlett Packard Enterprise Co. Notes 16/22	USD	0	5.000.000
XS2264054706	2,1000 % Hongkong Airport Authority FLR Notes 20/Und.	USD	0	1.050.000
XS2202751249	1,7000 % Horse Gallop Finance Ltd. MTN 20/25	USD	0	2.000.000
US404280DB25	4,5710 % HSBC Holdings PLC FLR Notes 22/26	USD	300.000	300.000
XS2178221490	2,8750 % Hysan (MTN) Ltd. MTN 20/27	USD	0	1.000.000
US49374JAC71	2,3750 % Kia Corp. Notes 22/25 144A	USD	1.675.000	1.675.000
USY4760JAC72	2,3750 % Kia Corp. Notes 22/25 Reg.S	USD	325.000	325.000
USY5257YAL12	5,8310 % Lenovo Group Ltd. Notes 22/28 Reg.S	USD	4.000.000	4.000.000
USY5257YAM94	6,5360 % Lenovo Group Ltd. Notes 22/32 Reg.S	USD	1.450.000	1.450.000
XS2225422869	2,2100 % MAR Sukuk Ltd. MTN 20/25	USD	0	2.000.000
USG6382GYW60	4,9001 % NatWest Markets PLC FLR Notes 22/25 Reg.S	USD	3.000.000	3.000.000
USG6382GYX44	3,4790 % NatWest Markets PLC Notes 22/25 Reg.S	USD	3.000.000	3.000.000
US62954WAH88	4,1420 % NTT Finance Corp. Notes 22/24 144A	USD	350.000	350.000
US62954WAK18	4,3720 % NTT Finance Corp. Notes 22/27 144A	USD	500.000	500.000
XS2162033729	2,6250 % QNB Finance Ltd. MTN 20/25	USD	0	2.500.000
XS2115122538	6,3750 % Republic of Ghana MTN 20/27 Reg.S	USD	0	500.000
XS2571923007	7,1250 % Republik Rumänien MTN 23/33 Reg.S	USD	2.000.000	2.000.000
XS2571924070	7,6250 % Republik Rumänien MTN 23/53 Reg.S	USD	676.000	676.000
US78355HKD07	2,8000 % Ryder System Inc. MTN 17/22	USD	0	3.275.000
USY7758EEH00	4,1500 % Shriram Finance Ltd. MTN 22/25 Reg.S	USD	0	1.200.000
US86964WAJ18	3,7500 % Suzano Austria GmbH Notes 20/31	USD	0	1.000.000
USH42097DL81	4,9880 % UBS Group AG FLR MTN 22/33 Reg.S	USD	1.000.000	1.000.000
USH42097DK09	4,7030 % UBS Group AG FLR MTN Nts 22/27 Reg.S	USD	1.550.000	1.550.000
US911312AY27	2,4000 % United Parcel Service Inc. Notes 16/26	USD	4.000.000	4.000.000
XS2122900330	3,1330 % Vena Energy Capital Pte. Ltd. MTN 20/25	USD	0	4.000.000
US92857WBK53	4,3750 % Vodafone Group PLC Notes 18/28	USD	4.000.000	4.000.000
XS2231799243	1,6250 % Yili Holding Investment Ltd. Notes 20/25	USD	0	1.500.000
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS2463975628	2,9020 % AABF Finance B.V. FLR MTN 22/24	EUR	2.475.000	2.475.000
XS2463974571	0,6250 % ABB Finance B.V. MTN 22/24	EUR	1.325.000	1.325.000
XS2351301499	0,7500 % ACEF Holding S.C.A. MTN 21/28	EUR	0	2.325.000
XS2056490423	4,6250 % Achmea B.V. FLR Notes 19/Und.	EUR	0	357.000
XS2331921390	1,5000 % Anima Holding S.p.A. Notes 21/28	EUR	0	300.000
XS1200679071	1,1250 % Berkshire Hathaway Inc. Notes 15/27	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2356316872	1,7500 % CECONOMY AG Anl. 21/26	EUR	0	1.000.000
XS1964617879	3,1250 % Cemex S.A.B. de C.V. Notes 19/26 Reg.S	EUR	0	1.000.000
XS2134245138	1,7500 % Coca-Cola Europacific Pa. PLC Notes 20/26	EUR	0	2.000.000
XS1633248148	0,3750 % CPPIB Capital Inc. MTN 17/24 Reg.S	EUR	0	500.000
XS1945965611	0,8750 % CPPIB Capital Inc. MTN 19/29	EUR	0	250.000
XS2264194205	0,6250 % CTP N.V. MTN 20/23	EUR	0	4.625.000
XS2238342484	2,1250 % CTP N.V. MTN 20/25	EUR	0	1.000.000
XS2434791690	0,8750 % CTP N.V. MTN 22/26	EUR	0	1.550.000
XS2545259876	4,5000 % Dell Bank International DAC MTN 22/27	EUR	7.000.000	7.000.000
XS1890084061	0,8750 % Development Bank of Japan MTN 18/25	EUR	0	500.000
XS2100663579	0,6250 % Digital Dutch Finco B.V. Notes 20/25	EUR	0	1.500.000
XS2063495811	1,1250 % Digital Euro Finco LLC Notes 19/28 Reg.S	EUR	1.500.000	3.000.000
XS2247614063	2,6250 % Drax Finco PLC Notes 20/25 Reg.S	EUR	1.000.000	3.000.000
XS2304340263	0,2500 % Equinix Inc. Notes 21/27	EUR	0	1.000.000
XS1959338630	0,2500 % Export Development Canada MTN 19/26	EUR	0	200.000
XS2081491727	0,8150 % FCC Serv.Medio Ambiente Hld.SA Notes 19/23	EUR	0	325.000
DE000A3E5QW6	0,1250 % GEWOBAW Wohnungsbau-AG Berlin MTN 21/27	EUR	0	2.000.000
XS1419661118	3,5000 % Hanesbrands Finance LU SCA Notes 16/24 Reg.S	EUR	0	2.000.000
XS2154335363	3,8750 % Harley Davidson Finl Serv.Inc. Notes 20/23	EUR	0	500.000
XS2385389551	0,1250 % Hldg d'Infra.Métiers Environ. Notes 21/25	EUR	0	375.000
XS1725734872	1,6250 % Huarong Universe Inv.Hldg.Ltd. Notes 17/22	EUR	0	1.400.000
XS1721244371	1,8750 % Iberdrola International B.V. FLR Notes 17/Und.	EUR	0	2.000.000
DE000A126C06	2,1250 % JAB Holdings B.V. Notes 15/22	EUR	0	3.000.000
DE000A25BDE0	1,0000 % JAB Holdings B.V. Notes 19/27	EUR	0	200.000
XS2354444023	0,0000 % JDE Peet's N.V. MTN 21/26	EUR	0	650.000
XS2486270858	6,0000 % Kon. KPN N.V. FLR Notes 22/Und.	EUR	1.575.000	1.575.000
XS1602130947	3,3750 % Levi Strauss & Co. Notes 17/27	EUR	1.000.000	1.000.000
FR0014003Y09	0,6250 % MACIF Notes 21/27	EUR	0	200.000
XS2489981485	2,2640 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. FLR MTN 22/25	EUR	2.225.000	2.225.000
XS2132337697	0,9780 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. MTN 20/24	EUR	0	2.000.000
XS1197270819	1,6250 % Mondelez International Inc. Notes 15/27	EUR	1.500.000	1.500.000
XS2390849318	0,9930 % MPT Operating Partnership L.P. Notes 21/26	EUR	0	2.000.000
XS2406737036	2,3740 % Naturgy Finance B.V. FLR Sec. 21/Und. Reg.S	EUR	0	4.000.000
XS2166217278	3,0000 % Netflix Inc. Notes 20/25 Reg.S	EUR	0	2.000.000
XS2323295563	0,0460 % Nidec Corp. Bonds 21/26	EUR	0	175.000
XS2436807866	0,8750 % P3 Group S.a.r.l. MTN 22/26	EUR	0	2.500.000
XS1958214964	0,1250 % Paccar Financial Europe B.V. MTN 19/22	EUR	0	1.600.000

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS2168625460	0,2500 % PepsiCo Inc. Notes 20/24	EUR	0	2.825.000
XS2580271752	4,2500 % Prologis Euro Finance LLC Notes 23/43	EUR	4.200.000	4.200.000
XS1789176846	1,7500 % ProLogis Intl Funding II S.A. MTN 18/28	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2529520715	3,6250 % ProLogis Intl Funding II S.A. MTN 22/30	EUR	1.925.000	1.925.000
XS2430287529	1,2070 % Prosus N.V. MTN 22/26 Reg.S	EUR	0	475.000
XS2050910418	1,0000 % Pterosaur Capital Co. Ltd. Notes 19/24	EUR	0	4.725.000
XS1151586945	1,6250 % Republik Chile Bonds 14/25	EUR	0	2.000.000
XS1843433639	0,8300 % Republik Chile Bonds 19/31	EUR	0	225.000
XS2369244087	0,1000 % Republik Chile Notes 21/27	EUR	0	400.000
XS2325696628	3,1250 % Saipem Finance Intl B.V. MTN 21/28	EUR	0	100.000
XS1635870923	1,8000 % Samvard.Moth.Automot.Sys.Gr.BV Notes 17/24 Reg.S	EUR	0	2.500.000
FR0012383982	4,1250 % Sogecap S.A. FLR Notes 14/Und.	EUR	0	1.000.000
XS2345317510	0,0500 % Svenska Handelsbanken AB Pref. MTN 21/28 Reg.S	EUR	0	425.000
XS2199268470	2,7500 % Titan Global Finance PLC Notes 20/27	EUR	0	2.000.000
DE000A3H3J22	0,3750 % Vantage Towers AG MTN 21/27	EUR	0	200.000
BE6332786449	1,6250 % VGP N.V. Notes 22/27	EUR	0	500.000
BE6332787454	2,2500 % VGP N.V. Notes 22/30	EUR	0	600.000
XS2071382662	1,1250 % Vicinity Centres Re Ltd. MTN 19/29	EUR	0	2.000.000
XS2240978085	2,5000 % Volvo Car AB MTN 20/27	EUR	0	350.000
XS1724626699	2,0000 % Volvo Car AB MTN S.1 17/25	EUR	0	2.000.000
XS1794084068	1,3750 % WPP Finance 2016 MTN 18/25	EUR	2.000.000	2.000.000
XS2176562812	2,3750 % WPP Finance S.A. MTN 20/27	EUR	2.000.000	2.000.000
<b>GBP</b>				
XS2552367687	8,4100 % Barclays PLC FLR MTN 22/32	GBP	2.350.000	2.350.000
XS2456883698	2,3750 % Paccar Financial Europe B.V. MTN 22/25	GBP	3.000.000	3.000.000
<b>USD</b>				
US00507VAM19	3,4000 % Activision Blizzard Inc. Notes 17/27	USD	3.000.000	3.000.000
US00724PAB58	1,9000 % Adobe Inc. Notes 20/25	USD	1.000.000	1.000.000
XS2343006958	2,6340 % African Export-Import Bank MTN 21/26 Reg.S	USD	0	2.000.000
US01609WAQ50	3,6000 % Alibaba Group Holding Ltd. Notes 15/24	USD	0	1.500.000
USP01703AD22	3,2500 % Alpek S.A.B. de C.V. Notes 21/31 Reg.S	USD	0	350.000
US025816CR81	4,0758 % American Express Co. FLR Notes 22/25	USD	500.000	500.000
USP1393HAC27	2,3750 % Banco Latinoamer.d.Come.Ext.SA Notes 20/25 Reg.S	USD	0	1.000.000
USP1507SAH06	5,3750 % Banco Santander (Mexico) S.A. Notes 20/25 Reg.S	USD	0	1.000.000
US06051GKF53	4,4480 % Bank of America Corp. FLR Notes 22/25	USD	3.000.000	3.000.000
US06051GLA57	4,8270 % Bank of America Corp. FLR Notes 22/26	USD	4.000.000	4.000.000
US06738ECA10	5,7460 % Barclays PLC FLR Notes 22/33	USD	300.000	300.000
USU09513JH30	4,4441 % BMW US Capital LLC FLR Notes 22/25 Reg.S	USD	1.000.000	1.000.000
US20030NEA54	5,3500 % Comcast Corp. Notes 22/27	USD	625.000	625.000
US251526BN89	4,8750 % Deutsche Bank AG FLR Sub. Anl. 17/32	USD	0	1.000.000
US278642AS20	2,7500 % eBay Inc. Notes 17/23	USD	0	7.500.000
US26835PAF71	3,6250 % EDP Finance B.V. Notes 17/24 144A	USD	2.000.000	2.000.000
US29278GAV05	4,2500 % ENEL Finance Intl N.V. Notes 22/25 144A	USD	800.000	800.000
US29278GAW87	4,6250 % ENEL Finance Intl N.V. Notes 22/27 144A	USD	2.000.000	2.000.000
US29444UBD72	2,9000 % Equinix Inc. Notes 19/26	USD	0	1.750.000
US29444UBF21	1,2500 % Equinix Inc. Notes 20/25	USD	0	2.000.000
US29444UBG04	1,8000 % Equinix Inc. Notes 20/27	USD	0	625.000
US30212PAP09	3,8000 % Expedia Group Inc. Notes 17/28	USD	0	2.375.000
US37045XBX30	2,3063 % General Motors Financial Co. FLR Notes 17/22	USD	0	2.000.000
US37045XCE40	4,7383 % General Motors Financial Co. FLR Notes 18/23	USD	0	3.000.000
US38869AAB35	3,5000 % Graphic Packaging Intl LLC Notes 20/28 144A	USD	0	2.000.000
US438127AB80	2,5340 % Honda Motor Co. Ltd. Notes 22/27	USD	400.000	400.000
US46115HAZ01	3,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Receipts 17/22 Cl.X 144A	USD	0	3.025.000
US459200KM24	2,2000 % Intl Business Machines Corp. Notes 22/27	USD	4.000.000	4.000.000
US24422EWC91	3,6357 % John Deere Capital Corp. FLR MTN 22/25	USD	500.000	500.000
US24422EWD74	2,3500 % John Deere Capital Corp. MTN 22/27	USD	500.000	500.000
USA35155AE99	3,2000 % Klabin Austria GmbH Notes 21/31 Reg.S	USD	0	1.000.000
US55903VAG86	3,7550 % Magallanes Inc. Notes 22/27 144A	USD	3.325.000	3.325.000
US571748BP64	2,3750 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Notes 21/31	USD	0	400.000
USU2339CDX30	2,1250 % Mercedes-Benz Fin.North.Am.LLC Notes 20/25 Reg.S	USD	1.500.000	1.500.000
US58769JAB35	5,3750 % Mercedes-Benz Fin.North.Am.LLC Notes 22/25 144A	USD	500.000	500.000
US58769JAC18	5,2500 % Mercedes-Benz Fin.North.Am.LLC Notes 22/27 144A	USD	500.000	500.000
US609207AZ81	2,1250 % Mondelez International Inc. Notes 22/24	USD	1.150.000	1.150.000
USN6000LAR61	4,2500 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV Notes 22/25 Reg.S	USD	500.000	500.000
US61747YEK73	2,4750 % Morgan Stanley FLR MTN 22/28	USD	0	2.000.000
US61747YET82	4,6790 % Morgan Stanley FLR Notes 22/26	USD	1.900.000	1.900.000
US61747YFB65	5,9480 % Morgan Stanley FLR Notes 23/38	USD	450.000	450.000
USG6594TAB96	3,9330 % National Australia Bank Ltd. FLR Notes 19/34 Reg.S	USD	0	2.000.000
USU63768AA01	7,0000 % NBM US Holdings Inc. Notes 19/26 Reg.S	USD	0	1.000.000
US68389XBU81	2,8000 % Oracle Corp. Notes 20/27	USD	2.000.000	2.000.000
US713448CY22	3,5000 % PepsiCo Inc. Notes 15/25	USD	1.000.000	1.000.000
US168863DX33	2,7500 % Republik Chile Notes 22/27	USD	0	2.100.000
US168863DY16	4,3400 % Republik Chile Notes 22/42	USD	900.000	900.000
USY8085FBL32	6,5000 % SK Hynix Inc. Notes 23/33 Reg.S	USD	725.000	725.000
US83368RBT86	7,3670 % Soci�t� G�n�rale S.A. MTN 23/53 144A	USD	1.400.000	1.400.000
USU85861AD15	5,6250 % Stellantis Finance US Inc. Notes 22/28 Reg.S	USD	5.000.000	5.000.000
US38141GWN05	2,1600 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR Notes 17/23	USD	0	3.000.000
US38141GZJ65	4,5992 % The Goldman Sachs Group Inc. FLR Notes 22/25	USD	4.000.000	7.000.000
US38141GZV93	5,7000 % The Goldman Sachs Group Inc. Notes 22/24	USD	3.000.000	3.000.000
US87264ACA16	2,0500 % T-Mobile USA Inc. Notes 20/28	USD	4.000.000	4.000.000

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
FR0013378445	0,7500 % Atos SE Obl. 18/22	EUR	0	2.000.000
DE000BHY0BH3	0,0000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. S.210 18/22	EUR	0	6.150.000
FR0013241130	0,4850 % BPCE S.A. Non-Pref. MTN 17/22	EUR	0	5.000.000
FR0013231743	1,1250 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 17/23	EUR	0	1.000.000
XS2066776274	0,0500 % China Constr.Bk Corp.(Lux.Br.) MTN 19/22	EUR	0	2.000.000
XS1685589027	0,6250 % Hypo Vorarlberg Bank AG MT Bonds 17/22	EUR	0	700.000
DE000A2E4D67	0,3130 % Land Berlin FLR Landessch. Ausg.501 18/22	EUR	0	4.000.000
DE000A1RQBC0	1,7500 % Land Hessen Schatzanw. S.1304 13/23	EUR	0	7.000.000
DE000A2E4HV1	0,0500 % Land Niedersachsen Landessch. Ausg.876 17/22	EUR	0	7.000.000
DE000NRWOKS7	0,0000 % Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1449 17/22	EUR	0	7.500.000
DE000LB00CM1	0,7500 % Ldsbk Baden-Württemb. MTN Hyp.-Pfe. 14/22	EUR	0	3.800.000
DE000NWB2JE3	2,3080 % NRW.BANK FLR MTN IHS Ausg.2JE 18/23	EUR	0	2.000.000
DE000NWB17T4	0,0000 % NRW.BANK IHS Ausg.17T 17/22	EUR	0	5.000.000
XS1586146851	0,2770 % Société Générale S.A. FLR MTN 17/22	EUR	0	7.500.000
XS1705553417	0,4150 % Stedin Holding N.V. FLR Notes 17/22	EUR	0	1.925.000
XS1418774706	2,1250 % Trinity Acquisition PLC Notes 16/22	EUR	0	1.000.000
<b>USD</b>				
US87264ACR41	2,4000 % T-Mobile USA Inc. Notes 21/29 144A	USD	0	400.000

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

## Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Geschäftsjahres		EUR	1.310.756.209,48
Mittelzuflüsse	84.110.209,32		
Mittelrückflüsse	-287.562.770,33		
Mittelzuflüsse /-rückflüsse (netto)			-203.452.561,01
Ertragsausschüttung			-6.725.398,80
Ertragsausgleich			320.125,25
Ordentlicher Ertragsüberschuss			13.135.053,34
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)*			9.072.945,76
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses*)			-31.520.846,06
<b>Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>			<b>1.091.585.527,96</b>

## Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse CF am Beginn des Geschäftsjahres	8.004.527,000
Anzahl der ausgegebenen Anteile der Klasse CF	572.779,000
Anzahl der zurückgezahlten Anteile der Klasse CF	1.982.986,000
<b>Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse CF am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>6.594.320,000</b>

Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse TF (A) am Beginn des Geschäftsjahres	5.118.972,000
Anzahl der ausgegebenen Anteile der Klasse TF (A)	282.262,000
Anzahl der zurückgezahlten Anteile der Klasse TF (A)	942.431,000
<b>Anzahl des Anteilumlaufs der Klasse TF (A) am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>4.458.803,000</b>

## Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich

### Anteilklasse CF

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende	Anteilwert	Anteilumlauf
	des Geschäftsjahres		
	EUR	EUR	Stück
2020	1.115.728.080,64	104,79	10.647.227,000
2021	858.199.898,64	104,11	8.243.513,000
2022	820.691.938,38	102,53	8.004.527,000
2023	669.042.804,81	101,46	6.594.320,000

Vergangenheitsbezogene Werte gewähren keine Rückschlüsse für die Zukunft.

## Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich

### Anteilklasse TF (A)

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende	Anteilwert	Anteilumlauf
	des Geschäftsjahres		
	EUR	EUR	Stück
2020	506.976.939,96	97,88	5.179.629,000
2021	438.494.598,15	97,24	4.509.312,000
2022	490.064.271,10	95,73	5.118.972,000
2023	422.542.723,15	94,77	4.458.803,000

Vergangenheitsbezogene Werte gewähren keine Rückschlüsse für die Zukunft.

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

für den Zeitraum vom 01.02.2022 bis 31.01.2023 (inkl. Ertragsausgleich)

EUR

<b>Erträge</b>	
Dividenden	150.707,80
Wertpapierzinsen	19.775.404,52
davon Gewinne und Verluste aus Markttrenditepapieren	-44.377,45
Zinsen aus Liquiditätsanlagen	201.466,03
davon aus negativen Einlagezinsen	-369.528,79
davon aus positiven Einlagezinsen	570.994,82
Erträge aus Wertpapierleihe	171.629,39
Bestandsprovisionen	-2.706,22
Sonstige Erträge <sup>***</sup> )	1.377.828,65
Ordentlicher Ertragsausgleich	-1.081.773,34
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>20.592.556,83</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsvergütung	5.175.926,99
Vertriebsprovision	674.085,82
Taxe d' Abonnement	568.617,44
Zinsen aus Kreditaufnahmen	87.764,72
Aufwendungen aus Wertpapierleihe	56.637,59
Kostenpauschale <sup>**</sup> )	1.380.247,31
Sonstige Aufwendungen <sup>****</sup> )	23.601,95
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	23.601,95
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-509.378,33
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>7.457.503,49</b>
<b>Ordentlicher Ertragsüberschuss</b>	<b>13.135.053,34</b>
Netto realisiertes Ergebnis <sup>*) *****</sup> )	8.820.676,00
Außerordentlicher Ertragsausgleich	252.269,76
<b>Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)</b>	<b>9.072.945,76</b>
<b>Ertragsüberschuss</b>	<b>22.207.999,10</b>
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses <sup>*)</sup>	-31.520.846,06
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>-9.312.846,96</b>

Gemäß Art. 15 Grundreglement in Verbindung mit Art. 5 Sonderreglement beträgt die Ausschüttung für die Anteilklasse CF EUR 1,79 je Anteil und für die Anteilklasse TF (A) EUR 1,67 je Anteil. Die Ausschüttungen werden per 24. März 2023 mit Beschlussfassung vom 16. März 2023 vorgenommen.

Die vorgenannten Aufwendungen der Anteilklasse CF betragen bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen (Gesamtkostenquote/ laufende Kosten (Ongoing Charges)) 0,63%.

Die vorgenannten Aufwendungen der Anteilklasse TF (A) betragen bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen (Gesamtkostenquote/ laufende Kosten (Ongoing Charges)) 0,78%.

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt: 367.064,22 EUR

- davon aus EMIR-Kosten: 13.327,95 EUR

Die Ausgabe von Anteilen der Anteilklasse CF erfolgt zum Anteilwert zuzüglich eines Ausgabeaufschlages.

Die Ausgabe von Anteilen der Anteilklasse TF (A) erfolgt zum Anteilwert. Ein Ausgabeaufschlag wird nicht erhoben. Die Vertriebsstellen erhalten aus dem Fondsvermögen der Anteilklasse TF (A) eine Vertriebsprovision.

\*) Ergebnis-Zusammensetzung:  
Netto realisiertes Ergebnis aus: Wertpapier-, Devisen-, Devisentermin-, Finanztermin- und Swapeschäften  
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses aus: Wertpapier-, Devisen-, Devisentermin-, Finanztermin- und Swapeschäften

\*\*\*) Für das Sondervermögen ist gemäß den Vertragsbedingungen eine an die Verwaltungsgesellschaft abzuführende Kostenpauschale von 0,12 % p.a. vereinbart. Davon entfallen bis zu 0,06 % p.a. auf die Verwahrstelle und bis zu 0,08 % p.a. auf Dritte (Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten sowie Sonstige).

\*\*\*\*) In dieser Position enthalten sind ausschließlich Ersatzleistungen aus Zinsen.

\*\*\*\*\*) In dieser Position enthalten sind ausschließlich Researchkosten.

\*\*\*\*\*) In diesem Betrag enthalten sind Schadensersatzzahlungen (abzüglich einer marktüblichen Gebühr) aus dem Class-Action-Verfahren gegen FX-Benchmark Rates.

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

## Absoluter VaR

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Verwaltungsgesellschaft den **absoluten Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an. Die Limitauslastung berechnet sich als Verhältnis des VaR des Fonds zum Nettofondsvermögen.

**Maximalgrenze:** 20,00%

## Limitauslastung für das Marktrisiko

minimale Auslastung:	0,33%
maximale Auslastung:	1,69%
durchschnittliche Auslastung:	0,94%

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 01.02.2022 bis 31.01.2023 anhand des parametrischen Ansatzes berechnet. Der VaR wird mit einem Konfidenzintervall von 99%, einer Haltedauer von 20 Tagen sowie einer Zeitreihe von einem Jahr berechnet.

Die Verwaltungsgesellschaft berechnet die Hebelwirkung in Übereinstimmung mit der Pressemitteilung 12/29 der CSSF v. 31.07.2012 sowohl nach dem Ansatz der Summe der Nominalen („Bruttomethode“) als auch auf Grundlage des Commitment-Ansatzes („Nettomethode“). Anteilhaber sollten beachten, dass Derivate für verschiedene Zwecke eingesetzt werden können, insbesondere für Absicherungs- und Investmentzwecke. Die Berechnung der Hebelwirkung nach der Bruttomethode unterscheidet nicht zwischen den unterschiedlichen Zielsetzungen des Derivateinsatzes und liefert daher keine Indikation über den Risikogehalt des Fonds. Eine Indikation des Risikogehaltes des Fonds wird dagegen durch die Nettomethode gegeben, da sie auch den Einsatz von Derivaten zu Absicherungszwecken angemessen berücksichtigt.

## Hebelwirkung im Geschäftsjahr

<b>(Nettomethode)</b>	<b>(Bruttomethode)</b>
0,4	0,6



# Anhang.

## Angaben zu Bewertungsverfahren

### **Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen**

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

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

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

### **Investmentanteile**

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

### **Derivate**

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

### **Bankguthaben**

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

### **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.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen für die Tätigkeit als Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf die Hauptverwaltung und die Anlagenverwaltung ein Entgelt („Verwaltungsvergütung“), das anteilig monatlich nachträglich auf das durchschnittliche Netto-Fondsvermögen während des betreffenden Monats zu berechnen und auszuzahlen ist.

Die Verwaltungsgesellschaft kann dem Fondsvermögen bis zur Höhe von jährlich 0,10% des durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens die an Dritte gezahlten Vergütungen und Entgelte belasten für

- die Verwaltung von Sicherheiten für Derivate-Geschäfte (sog. Collateral-Management), sowie
- Leistungen im Rahmen der Erfüllung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (europäische Marktinfrastrukturverordnung – sog. EMIR), unter anderem für das zentrale Clearing von OTC-Derivaten und Meldungen an Transaktionsregister einschließlich Kosten für Rechtsträger-Kennungen.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen eine jährliche Kostenpauschale, die anteilig auf das durchschnittliche Netto-Fondsvermögen des betreffenden Monats zu berechnen und zum betreffenden Monatsende auszuzahlen ist. Für die Berechnung werden die Tageswerte zugrunde gelegt. Die Kostenpauschale umfasst die folgenden Vergütungen und Kosten, die dem Fonds nicht separat belastet werden:

- Vergütung der Verwahrstelle;
- Kosten von Artikel 17 Absatz 1 Buchstabe b) bis i) des Grundreglements;
- Kosten, die im Zusammenhang mit der Verwendung eines Vergleichsmaßstabes entstehen können;
- Kosten und Auslagen, die der Verwahrstelle aufgrund einer zulässigen und marktüblichen Beauftragung Dritter gemäß Artikel 4 Absatz 3 des Grundreglements mit der Verwahrung von Vermögenswerten des Fonds entstehen.

Die Verwahrstelle erhält aus dem Fondsvermögen:

- eine bankübliche Bearbeitungsgebühr für Geschäfte für Rechnung des Fonds.

Die Steuer auf das Fondsvermögen („Taxe d’abonnement“, derzeit 0,05% p.a.) ist vierteljährlich nachträglich auf das Fonds-

vermögen (soweit es nicht in Luxemburger Investmentfonds, die der „Taxe d’abonnement“ unterliegen, angelegt ist) zu berechnen und auszuzahlen.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen des jeweiligen Fonds eine Vergütung zugunsten der Vertriebsstellen („Vertriebsprovision“), die anteilig monatlich nachträglich auf das Netto-Fondsvermögen zu berechnen und auszuzahlen ist.

Die Verwaltungsgesellschaft kann dem Fondsvermögen die Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte in Bezug auf ein oder mehrere Finanzinstrumente oder sonstige Vermögenswerte oder in Bezug auf die Emittenten oder potenziellen Emittenten von Finanzinstrumenten oder in engem Zusammenhang mit einer bestimmten Branche oder einen bestimmten Markt bis zu einer Höhe von 0,10 % p.a. des jährlichen durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens, der aus den Tageswerten errechnet wird, belasten.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für die Anbahnung, Vorbereitung und Durchführung von Wertpapierdarlehensgeschäften, Wertpapierpensions-geschäften und diesen vergleichbaren zulässigen Geschäften für Rechnung des Fonds eine pauschale Vergütung in Höhe von bis zu 33 Prozent der Erträge aus diesen Geschäften.

Die Ertragsverwendung sowie weitere Modalitäten entnehmen Sie bitte der nachfolgenden Tabelle.

## Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

	Verwaltungsvergütung	Vertriebsprovision	Kostenpauschale	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	bis zu 1,20% p.a., derzeit 0,45% p.a.	keine	bis zu 0,18% p.a., derzeit 0,12% p.a.	Ausschüttung
Anteilklasse TF (A)	bis zu 1,20% p.a., derzeit 0,45% p.a.	bis zu 0,48% p.a., derzeit 0,15% p.a.	bis zu 0,18% p.a., derzeit 0,12% p.a.	Ausschüttung

## Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka International S.A. unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme. Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung“ (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft.

## Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka International S.A. umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter und den Vorstand der Deka International S.A. findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlageerfolgsprämien, werden bei der Deka International S.A. nicht gewährt.

## Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka International S.A. - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Deka International S.A. bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeiters werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt. Für Mitarbeiter im Unternehmenserfolgsmodell wird zur Bemessung der variablen Vergütung ausschließlich der Unterneh-

menserfolg der Deka-Gruppe (ohne individuelle Zielvorgaben) herangezogen.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeiter erfolgt durch den Vorstand. Die Vergütung des Vorstands wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

## Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

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

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für den Vorstand der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitern unterhalb der Vorstandsebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
- Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 100 TEUR

nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka International S.A. war im Geschäftsjahr 2022 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

## Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2022 fand im

<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka International S.A.* gezahlten</b>	
<b>Mitarbeitervergütung</b>	<b>2.164.770,73 EUR</b>
davon feste Vergütung	1.840.811,25 EUR
davon variable Vergütung	323.959,48 EUR
Zahl der Mitarbeiter der KVG	26
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka International S.A.* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**</b>	<b>&lt; 550.000,00 EUR</b>
davon Vorstand	< 550.000,00 EUR
davon weitere Risktaker	0 EUR
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktion	0 EUR
davon Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Vorstand und Risktaker	0 EUR
* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt	
** weitere Risktaker: alle sonstigen Risktaker, die nicht Vorstand oder Risktaker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risktaker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risktaker oder Vorstand befinden	

## Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall

**Das Auslagerungsunternehmen (Deka Investment GmbH) hat folgende Informationen veröffentlicht:**

<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten</b>	
<b>Mitarbeitervergütung</b>	<b>57.636.189,51 EUR</b>
davon feste Vergütung	43.854.381,97 EUR
davon variable Vergütung	13.781.807,54 EUR
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens	461

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

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

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

**Name des Produkts:** Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten  
**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 5299009G98B04SLKS542

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

**Ja**
  **Nein**

<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 19,52% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>



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

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

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

- sofern Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen getätigt werden, nur in Unternehmen zu investieren, die verantwortungsvolle Geschäftspraktiken anwenden und keine Umsätze bzw. nur einen geringen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschaften. Als kontrovers werden Geschäftsfelder erachtet, die mit hohen negativen Auswir-

kungen auf Umwelt und/ oder soziale Belange verbunden sind, da zum Beispiel die Produktion zum Klimawandel, zur sozialen Ungleichheit oder zu Konflikten beiträgt

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

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

- Umsätze aus der Herstellung oder dem Vertrieb gemäß internationalen Konventionen (z.B. Chemiewaffenkonventionen) verbotener geächteter Waffen und/oder Atom- und/oder Handfeuerwaffen generierten
- Umsätze aus der unkonventionellen Förderung von Erdöl und/oder Erdgas (inklusive Fracking) generierten
- Umsätze aus der Förderung von Kohle generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung oder dem Vertrieb in den Geschäftsfeldern Rüstungsgüter generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung in den Geschäftsfeldern Tabak und/oder Alkohol generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% in den Geschäftsfeldern Glücksspiel generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% in den Geschäftsfeldern Pornografie generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Energiegewinnung durch Kernspaltung (Atomenergie) generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus der Verstromung von Kohle generierten
- gegen den UN Global Compact verstießen
- eine ESG-Bewertung von schlechter als „B“ von MSCI ESG Research LLC oder alternativ einer vergleichbaren ESG-Bewertung von einem anderen Anbieter aufwiesen.

Zudem wurden seit dem 01.01.2023 im Rahmen der ESG-Strategie Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen zusätzlich ausgeschlossen, die

- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus der Förderung von Erdöl generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus dem Abbau, der Exploration und aus Dienstleistungen für Ölsand und Ölschiefer generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz von/aus fossiler Brennstoffe (exklusive Erdgas) generierten

Seit dem 01.01.2023 erfolgte kein Ausschluss mehr von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Unternehmen die genveränderte Agrarprodukte herstellten.

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

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

Im Rahmen der ESG-Strategie wurden Zielfonds ausgeschlossen,

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

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

Darüber hinaus tätigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungs-Verordnung ((EU) 2019/2088). Mit den nachhaltigen Investitionen wurde angestrebt einen Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen bis 2030 (UN Sustainable Development Goals, SDGs) zu leisten. Die SDGs umfassen 17 Zielsetzungen, die darauf ausgerichtet sind durch eine wirtschaftlich nachhaltige Entwicklung weltweit Armut zu reduzieren und Wohlstand zu fördern. Dabei werden gleichzeitig soziale Bedürfnisse wie Bildung, Gesundheit und Beschäftigung wie auch Klimawandel und Umweltschutz berücksichtigt. Dies erfolgte durch direkte Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente oder indirekte Investitionen über Zielfonds in Unternehmen und Staaten, die mit ihren (Geschäfts-) Tätigkeiten zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs beitragen. Weitere Details zu den Zielen der nachhaltigen Investitionen sind im Abschnitt "Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?" zu finden.

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

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

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

#### 1. Einhaltung der in der Anlagestrategie vereinbarten Ausschlusskriterien

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

#### 2. Ökologische Wirkung

Der Indikator „ökologische Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 33,99 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

Der Indikator berechnet sich aus der Summe der Umsätze der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen in den Geschäftsfeldern alternative Energien, Energieeffizienz, nachhaltiges Bauen, nachhaltige Landwirtschaft, nachhaltige Wasserwirtschaft und Vermeidung von Umweltverschmutzung durch eine Minimierung der Abfallerzeugung, jeweils gewichtet mit dem Anteil der Investition am Fondsvermögen. Dabei handelt es sich um Geschäftsfelder, in

denen Produkte oder Dienstleistungen angeboten werden, die zur Erreichung von Umweltzielen (basierend auf den SDGs) beitragen. Es werden sowohl direkte Investitionen in Unternehmen über Aktien und Anleihen als auch indirekte Investitionen über Zielfonds berücksichtigt. Die Gesamtsumme wird mit 1.000 Euro investiertem Kapital ins Verhältnis gesetzt. Die Berechnung des Indikators basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt den Durchschnitt der Datenlage an den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum wider.

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

### 3. Soziale Wirkung

Der Indikator „soziale Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 44,80 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

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

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

### 4. Durchschnittlicher MSCI Government ESG Score

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

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

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

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

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

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

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

- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck der Unternehmen (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle

1)

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

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

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts in Staaten, hielten die Staaten einen definierten Schwellenwert bei der CO<sub>2</sub>-Intensität ein. Zudem verstießen die Staaten bei den nachhaltigen Investitionen nicht gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen und waren deshalb von der EU sanktioniert.

Bei allen nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, überstieg der durchschnittliche CO<sub>2</sub>-Fußabdruck der Unternehmen bzw. die CO<sub>2</sub>-Intensität der Staaten im Zielfonds einen festgelegten Schwellenwert nicht. Zudem überstieg der Anteil des Sondervermögens im Zielfonds, das in Unternehmen investiert wurde, die gegen den UN Global Compact verstießen, einen definierten Schwellenwert nicht. Die nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, enthielten zudem keine Unternehmen, die an der Herstellung oder dem Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

Das Finanzprodukt berücksichtigte im Berichtszeitraum bei Anlageentscheidungen in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Zielfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts oder PAI). PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-)Tätigkeiten von Unternehmen und Staaten in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Im Rahmen der PAI-Berücksichtigung wurden im Berichtsjahr systematische Verfahrensweisen zur Messung und Bewertung, sowie Maßnahmen zum Umgang mit den PAI im Investitionsprozess angewendet.

Die Messung und Bewertung der PAI der Unternehmen, Staaten und Zielfonds im Anlageuniversum erfolgte unter Verwendung von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research

LLC. Die PAI-Informationen für Unternehmen und Staaten wurden dem Portfoliomanagement des Finanzprodukts zur Berücksichtigung im Investitionsprozess zur Verfügung gestellt.

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

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

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

Für Unternehmen waren seit dem 01.06.2022 für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

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

Für Staaten waren seit dem 01.06.2022 für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

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

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen und Staaten, die die festgelegten Schwellenwerte überschritten bzw. Ausprägungen nicht einhielten, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger bis 31.08.2022 veräußert.

Seit dem 01.09.2022 wurde dann nicht mehr in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen investiert, deren CO<sub>2</sub>-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und/ oder Energieverbrauchsintensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt. Zudem wurde seit dem 01.09.2022 nicht in Unternehmen investiert, die gegen den UN Global Compact verstießen, denen in den letzten drei Jahren Menschenrechtsverletzungen vorgeworfen wurden und/oder die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren. Darüber hinaus wurde seit dem 01.09.2022 nicht in Staaten investiert, deren CO<sub>2</sub>-Intensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt und/ oder die gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen verstießen und deshalb von der EU sanktioniert waren.

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

Für weitere PAI-Indikatoren erfolgte die Bewertung der Unternehmen und Staaten im Anlageuniversum seit dem 01.09.2022 auf kontinuierlicher Basis durch Nachhaltigkeitsanalysten. Auf Basis dieser Bewertung wurden gegebenenfalls weitere Unternehmen und Staaten aus dem Anlageuniversum des Finanzprodukts ausgeschlossen. Folgende PAI-Indikatoren für Unternehmen wurden im Rahmen dieser Maßnahme betrachtet:

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

Für Zielfonds waren seit dem 01.12.2022 für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

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

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2022 - 31.01.2023

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

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

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25 (BE0000334434)	Staatsanleihen	0,61%	Belgien
Land Nordrhein-Westfalen MT Landessch.R.1449 17/22 (DE000NRWOKS7)	Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,50%	Deutschland
Sparebank 1 SR-Bank ASA Preferred MTN 19/24 (XS1967582831)	Banken	0,49%	Norwegen
BNP Paribas S.A. FLR MTN 17/24 (XS1626933102)	Banken	0,49%	Frankreich
AT & T Inc. FLR Notes 18/23 (US00206RFY36)	Telekommunikationsdienste	0,47%	Vereinigte Staaten
Land Niedersachsen Landessch. Ausg.876 17/22 (DE000A2E4HV1)	Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,46%	Deutschland
Lb.Hessen-Thüringen GZ IHS 17/23 (DE000HLB2H54)	Banken	0,45%	Deutschland
Morgan Stanley FLR MTN 22/25 (US61747YEJ01)	Diversifizierte Finanzdienste	0,44%	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase & Co. FLR Notes 22/26 (US46647PCX24)	Banken	0,44%	Vereinigte Staaten
Citigroup Inc. FLR Notes 22/26 (US17327CAP86)	Banken	0,44%	Vereinigte Staaten
Land Hessen Schatzanw. S.1304 13/23 (DE000A1RQBC0)	Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,42%	Deutschland
Barclays PLC FLR MTN 21/26 (XS2342059784)	Banken	0,40%	Vereinigtes Königreich
Linde PLC MTN 21/26 (XS2391860843)	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0,36%	Irland
Iren S.p.A. MTN 18/25 (XS1881533563)	Versorgungsbetriebe	0,36%	Italien
Sky PLC MTN 14/23 (XS1141969912)	Medien & Unterhaltung	0,36%	Vereinigtes Königreich



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

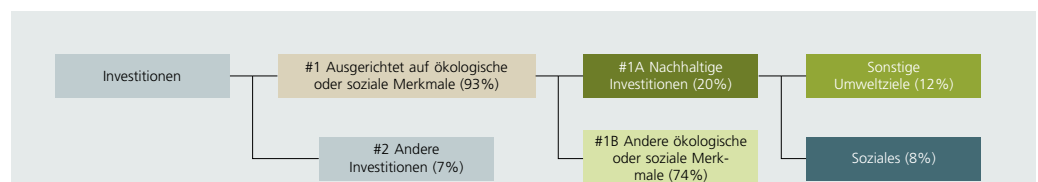
Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale beitrugen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale) betrug im Berichtszeitraum 93%. Darunter fallen alle Investitionen, die die im Rahmen der verbindlichen Elemente der ESG-Anlagestrategie definierten Ausschlusskriterien des Fonds einhielten.

Nachhaltige Investitionen (#2 nachhaltige Investitionen) im Sinne des Artikel 2 Nr.17 der Offenlegungsverordnung ((EU) 2019/2088) sind alle Investitionen des Finanzprodukts in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beitragen, vorausgesetzt, dass diese Investitionen keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Der Anteil nachhaltiger Investitionen betrug im Berichtszeitraum 20%. Dabei wurden sowohl nachhaltige Investitionen mit Umweltziel als auch nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel getätigt.

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

Eine Beschreibung der Investitionen, die nicht auf die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds ausgerichtet waren, findet sich im Abschnitt „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“.

Die Angaben in der Grafik stellen den Durchschnitt der Vermögensallokation aus den letzten drei Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums dar und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Geringfügige Abweichungen in der prozentualen Gewichtung der Investitionen resultieren aus rundungsbedingten Differenzen. Aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit, konnte der erste Quartalsstichtag des Berichtszeitraums bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst die Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

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



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

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

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

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 6,64% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilspektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC zurückgegriffen. Der Anteil beinhaltet Unternehmen, die Umsätze im Bereich der fossilen Brennstoffe, einschließlich der Förderung, Verarbeitung, Lagerung und dem Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie thermischer und metallurgischer Kohle erwirtschaften.

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

<b>Sektor</b>	<b>Anteil</b>
<b>Basiskonsumgüter</b>	<b>4,24%</b>
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	1,51%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	2,66%
Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	0,07%
<b>Energie</b>	<b>0,39%</b>
Energie	0,39%
<b>Finanzwesen</b>	<b>33,90%</b>
Banken	24,84%
Diversifizierte Finanzdienste	6,10%
Versicherungen	2,96%
<b>Gesundheitswesen</b>	<b>6,08%</b>
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	2,28%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	3,80%
<b>Immobilien</b>	<b>0,49%</b>
Immobilien	0,49%
<b>Industrie</b>	<b>8,42%</b>
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	1,03%
Investitionsgüter	5,24%
Transportwesen	2,15%
<b>Informationstechnologie</b>	<b>5,09%</b>
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	0,88%
Hardware & Ausrüstung	0,82%
Software & Dienste	3,39%
<b>Kommunikationsdienste</b>	<b>7,39%</b>
Medien & Unterhaltung	2,51%
Telekommunikationsdienste	4,88%
<b>Nicht-Basiskonsumgüter</b>	<b>5,73%</b>
Automobile & Komponenten	3,56%
Dienstleistungsunternehmen	0,90%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	0,67%
Groß- und Einzelhandel	0,60%
<b>Quasi- &amp; Fremdwährungs-Staatsanleihen</b>	<b>3,53%</b>
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	3,53%
<b>Roh-, Hilfs- &amp; Betriebsstoffe</b>	<b>3,53%</b>
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	3,53%
<b>Sonstige</b>	<b>8,41%</b>
Sonstige	8,41%
<b>Staatsanleihen</b>	<b>5,57%</b>
Staatsanleihen	5,57%
<b>Versorgungsbetriebe</b>	<b>7,24%</b>
Versorgungsbetriebe	7,24%

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

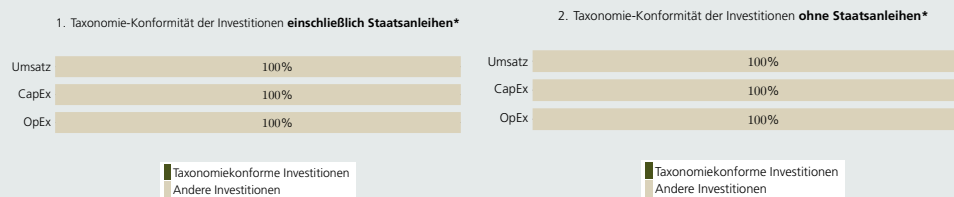
Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht nachweisbar in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu keinem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug demnach 0% (gemessen an den drei Leistungsindikatoren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

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

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

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

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




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

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

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

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



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

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

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel betrug 11,85%.

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



**Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 7,67%.

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



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

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

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

Bei diesen Investitionen wurde ein ökologischer und sozialer Mindestschutz angewendet, in der Form, dass auch mit diesen Investitionen nicht in Hersteller geächteter und kontroverser Waffen investiert wurde. Zudem wurde im Rahmen dieser Investitionen nicht in Produkte investiert, die die Preisentwicklung von Grundnahrungsmitteln abbilden.



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

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

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

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

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

# Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten

---

Luxemburg, den 26. Mai 2023  
Deka International S.A.  
Der Vorstand

---

# BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE.

An die Anteilhaber des  
**Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten**

## BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE

### Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten (der "Fonds") - bestehend aus der Aufstellung des Vermögensaufstellung, der Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Vermögenswerte zum 31. Januar 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen zum Jahresabschluss, mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Deka-Nachhaltigkeit BasisStrategie Renten zum 31. Januar 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISA) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt „Verantwortung des „réviseur d'entreprises agréé“ für die Jahresabschlussprüfung“ weitergehend beschrieben. Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ (IESBA Code) und für Luxemburg von der CSSF angenommen, zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

### Sonstige Informationen

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

### Verantwortung des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft des Fonds für den Jahresabschluss

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und - sofern einschlägig - Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

## Verantwortung des "réviseur d'entreprises agréé" für die Jahresabschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des "réviseur d'entreprises agréé", welcher unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentlich falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.

- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und der entsprechenden Erläuterungen.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Vorstand der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des "réviseur d'entreprises agréé" auf die dazugehörigen Erläuterungen zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des "réviseur d'entreprises agréé" erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Erläuterungen, und beurteilen ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Luxemburg, 30. Mai 2023

### **Deloitte Audit, Société à responsabilité limitée**

Cabinet de revision agréé  
20, Boulevard de Kockelscheuer  
1821 Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

Rainer Mahnkopf, Réviseur d'entreprises agréé  
Managing Director



# 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: 31. Januar 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**