

Halbjahresbericht
zum 31. August 2023.

Deka-Nachhaltigkeit StrategieInvest

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Nachhaltigkeit Strategieinvest für den Zeitraum vom 1. März 2023 bis zum 31. August 2023.

Im Berichtszeitraum entfernten sich die Teuerungsraten sukzessive von ihren Höchstständen und sorgten damit für eine gewisse Entlastung an den Finanzmärkten. Demgegenüber hat sich in Deutschland und im Euroraum die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,25 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 4,1 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen wies trotz zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren im Bankensektor sowie der Auswirkungen steigender Leitzinsen eine Aufwärtsbewegung aus. Insbesondere in den USA und Japan konnten die Indizes starke Zuwächse verbuchen. Der Euro bewegte sich im Verhältnis zum US-Dollar in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende August bei 1,09 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte unter Schwankungen seitwärts und beendete die Berichtsperiode bei 86,9 US-Dollar je Barrel (Brent).

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Anteilklassen im Überblick	6
Vermögensübersicht zum 31. August 2023	7
Vermögensaufstellung zum 31. August 2023	8
Anhang	14
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

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

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest Anlagepolitik.

Anlageziel dieses Fonds ist es, durch die Nutzung von Chancen und die Vermeidung von Risiken, die sich aus ökonomischen, ökologischen und sozialen Entwicklungen ergeben, ein mittel- bis langfristiges Kapitalwachstum zu erwirtschaften.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds global in Aktien von Unternehmen an. Darüber hinaus können verzinsliche Wertpapiere und Geldmarktinstrumente erworben werden. Der Aktienanteil wird in Abhängigkeit der Schwankungsintensität der lokalen Aktienmärkte gesteuert und kann zwischen 25-100% variieren. Das Währungsrisiko wird nahezu vollständig gesichert. Bei der Zusammenstellung des Portfolios ist ein attraktives Chance-/Risikoverhältnis wichtig, was vor allem durch die Auswahl von Aktien erreicht wird, die niedrige Kursschwankungen erwarten lassen. Die Maximierung der Rendite im Vergleich zum breiten Aktienmarkt steht nicht im Vordergrund.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen finanzmathematischer Analysen, die durch wissenschaftliche Studien fundiert sind. Als Folge orientiert sich der Investitionsprozess an definierten Faktoren, welche eine umfangreiche Risikobewertung ermöglichen. Im Fonds wird die Low-Risk-Kapitalmarktanomalie ausgenutzt. Kern dieser Anomalie ist es, dass risikoarme Aktien attraktive Renditen erwarten lassen. Eine weitere Risikoreduktion wird mit Hilfe der Investitionsgradsteuerung angestrebt. Diese sieht eine Verringerung des Investitionsgrades in besonders schwankungsintensiven Marktphasen vor. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmensführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden die Emittenten nach Kriterien für Umwelt (z.B. Klimaschutz), soziale Verantwortung (z.B. Menschenrechte, Standards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Transparenz und Berichterstattung,

Bestechung und Korruption) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Die Ausschlusskriterien orientieren sich beispielsweise 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 z.B. den Schutz der internationalen Menschenrechte achten und sicherstellen.

Wichtige Kennzahlen

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

Performance*	6 Monate
Anteilklasse CF	2,4%
Anteilklasse TF	2,0%
ISIN	
Anteilklasse CF	DE000DK2EAD4
Anteilklasse TF	DE000DK2EAE2

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

Sie sollen unter anderem 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.

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

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

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35 % des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland investieren.

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds DekaNachhaltigkeit StrategieInvest können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung*, der Vertriebsvergütung**, der erfolgsabhängigen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von zwei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags und der Verwaltungsvergütung sowie der Vertriebsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung CF und TF.

Weitere Details zu den Merkmalen der jeweiligen Anteilklasse entnehmen Sie bitte der untenstehenden Tabelle. Näheres ist im Verkaufsprospekt geregelt.

Der Erwerb von Vermögensgegenständen ist nur einheitlich für den gesamten Fonds und nicht für eine einzelne Anteilklasse oder eine Gruppe von Anteilklassen zulässig. Die Bildung neuer Anteilklassen ist zulässig, sie liegt im Ermessen der Gesellschaft. Es ist weder notwendig, dass Anteile einer Anteilklasse im Umlauf sind, noch dass Anteile einer neu gebildeten Anteilklasse umgehend auszugeben sind. Bei erstmaliger Ausgabe von Anteilen einer Anteilklasse ist deren Wert auf der Grundlage des für den gesamten Fonds nach § 168 Absatz 1 Satz 1 KAGB ermittelten Wertes zu berechnen.

Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	1,25% p.a.	3,75%	Ausschüttung
Anteilklasse TF**	1,97% p.a.	keiner	Ausschüttung

* Der Verwaltungsvergütungssatz wird auf das durchschnittliche Fondsvermögen berechnet, das sich aus den Tageswerten zusammensetzt.

** Die Vertriebsvergütung wird durch die Verwaltungsvergütung abgedeckt und wird dem Sondervermögen nicht gesondert belastet.

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	697.943.922,71	88,39
Australien	8.773.442,81	1,11
Dänemark	7.795.383,60	0,99
Deutschland	31.892.490,51	4,03
Finnland	9.729.089,54	1,23
Frankreich	22.295.463,33	2,82
Großbritannien	39.629.855,11	5,01
Irland	10.582.268,55	1,35
Israel	8.191.710,31	1,04
Japan	33.461.791,86	4,23
Kanada	72.646.558,14	9,22
Niederlande	23.611.022,90	3,00
Norwegen	11.166.496,63	1,42
Portugal	710.110,88	0,09
Schweden	6.457.188,00	0,81
Schweiz	42.600.154,14	5,39
Singapur	1.503.634,63	0,19
Spanien	10.665.726,37	1,35
USA	356.231.535,40	45,11
2. Sonstige Wertpapiere	6.663.077,82	0,84
Schweiz	6.663.077,82	0,84
3. Derivate	5.573.943,10	0,71
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	76.105.329,43	9,63
5. Sonstige Vermögensgegenstände	7.455.119,99	0,94
II. Verbindlichkeiten	-4.010.853,30	-0,51
III. Fondsvermögen	789.730.539,75	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	697.943.922,71	88,39
AUD	8.773.442,81	1,11
CAD	72.646.558,14	9,22
CHF	39.827.852,47	5,04
DKK	7.795.383,60	0,99
EUR	100.360.405,33	12,70
GBP	39.629.855,11	5,01
JPY	33.461.791,86	4,23
NOK	11.166.496,63	1,42
SEK	6.457.188,00	0,81
SGD	1.503.634,63	0,19
USD	376.321.314,13	47,67
2. Sonstige Wertpapiere	6.663.077,82	0,84
CHF	6.663.077,82	0,84
3. Derivate	5.573.943,10	0,71
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	76.105.329,43	9,63
5. Sonstige Vermögensgegenstände	7.455.119,99	0,94
II. Verbindlichkeiten	-4.010.853,30	-0,51
III. Fondsvermögen	789.730.539,75	100,00

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

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

Vermögensaufstellung zum 31. August 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								704.607.000,53	89,23
Aktien								697.943.922,71	88,39
EUR								100.360.405,33	12,70
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder		STK	287.823	74.364	0	EUR 30,345	8.733.988,94	1,11
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur		STK	106.267	106.267	0	EUR 27,970	2.972.287,99	0,38
FR0006174348	Bureau Veritas SA Actions au Porteur		STK	54.092	0	0	EUR 24,850	1.344.186,20	0,17
FR001400AJ45	Cie Génle Étés Michelin SCpA Actions Nom.		STK	25.449	0	0	EUR 29,110	740.820,39	0,09
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port.		STK	100.635	0	46.395	EUR 53,970	5.431.270,95	0,69
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien		STK	177.433	0	0	EUR 19,790	3.511.399,07	0,44
FI0009007884	Elisa Oyj Reg.Shares Cl.A		STK	129.395	0	0	EUR 45,450	5.881.002,75	0,74
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien		STK	58.507	58.507	0	EUR 36,690	2.146.621,83	0,27
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien		STK	27.689	0	0	EUR 196,650	5.445.041,85	0,69
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien		STK	110.283	31.424	0	EUR 71,120	7.843.326,96	0,99
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.		STK	542.998	226.434	0	EUR 11,070	6.010.987,86	0,76
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins SGPS, S.A. Açções Nominativas		STK	29.912	0	0	EUR 23,740	710.110,88	0,09
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares CLB		STK	213.842	0	0	EUR 17,995	3.848.086,79	0,49
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder		STK	1.483.972	865.846	0	EUR 3,233	4.797.681,48	0,61
IE00059YS762	Linde plc Reg.Shares		STK	4.089	4.089	0	EUR 356,200	1.456.501,80	0,18
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien		STK	17.390	0	23.346	EUR 166,500	2.895.435,00	0,37
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien		STK	14.837	14.837	0	EUR 358,700	5.322.031,90	0,67
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.		STK	19.509	19.509	0	EUR 72,580	1.415.963,22	0,18
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder		STK	89.566	0	0	EUR 54,480	4.879.555,68	0,62
ES0173093024	Redeia Corporacion S.A. Acciones Port.		STK	308.977	61.936	0	EUR 15,065	4.654.738,51	0,59
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.		STK	104.442	0	10.439	EUR 99,490	10.390.934,58	1,31
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien		STK	36.605	0	0	EUR 129,180	4.728.633,90	0,60
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam		STK	46.344	0	0	EUR 112,200	5.199.796,80	0,66
AUD								8.773.442,81	1,11
AU0000030678	Coles Group Ltd. Reg.Shares		STK	250.536	135.197	0	AUD 16,270	2.425.563,87	0,31
AU000000MPL3	Medibank Private Ltd. Reg.Shares		STK	577.212	0	479.520	AUD 3,660	1.257.104,73	0,16
AU000000NAB4	National Australia Bank Ltd. Reg.Shares		STK	56.891	0	0	AUD 28,960	980.386,11	0,12
AU000000TL52	Telstra Group Ltd. Reg.Shares		STK	1.722.596	0	0	AUD 4,010	4.110.388,10	0,52
CAD								72.646.558,14	9,22
CA05534B7604	BCE Inc. Reg.Shares new		STK	77.728	0	0	CAD 57,660	3.038.804,82	0,38
CA1363751027	Canadian National Railway Co. Reg.Shares		STK	9.800	9.800	0	CAD 154,320	1.025.413,35	0,13
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)		STK	92.500	0	0	CAD 140,510	8.812.510,38	1,12
CA9611485090	George Weston Ltd. Reg.Shares		STK	50.400	0	0	CAD 152,120	5.198.374,08	0,66
CA4488112083	Hydro One Ltd. Reg.Shares		STK	236.600	0	0	CAD 36,190	5.805.692,08	0,74
CA45823T1066	Intact Financial Corp. Reg.Shares		STK	47.600	7.700	0	CAD 193,590	6.247.993,19	0,79
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares		STK	100.000	25.800	0	CAD 119,430	8.097.745,20	1,03
CA59162N1096	Metro Inc. Reg.Shares		STK	135.700	0	0	CAD 69,750	6.417.630,89	0,81
CA6330671034	National Bank of Canada Reg.Shares		STK	17.500	0	0	CAD 96,540	1.145.502,44	0,15
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares CLB (Sub.Vtg)		STK	167.100	0	0	CAD 31,100	3.523.607,41	0,45
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares		STK	62.600	0	0	CAD 122,980	5.219.867,72	0,66
CA85472N1096	Stantec Inc. Reg.Shares		STK	51.400	0	0	CAD 90,630	3.158.535,58	0,40
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares		STK	98.700	0	0	CAD 65,450	4.380.033,97	0,55
CA87971M1032	TELUS Corp. Reg.Shares		STK	145.000	0	63.800	CAD 23,940	2.353.655,11	0,30
CA0641491075	The Bank of Nova Scotia Reg.Shares		STK	42.800	0	0	CAD 64,480	1.871.196,83	0,24
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares		STK	44.300	0	0	CAD 83,430	2.505.974,49	0,32
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares		STK	43.800	0	23.900	CAD 110,820	3.291.114,04	0,42
CA97535P1045	Winpak Ltd. Reg.Shares		STK	20.100	0	0	CAD 40,570	552.906,56	0,07
CHF								39.827.852,47	5,04
CH0531751755	Banque Cantonale Vaudois Namens-Aktien		STK	14.607	0	0	CHF 96,150	1.464.920,31	0,19
CH0360674466	Galenica AG Namens-Aktien		STK	62.975	0	0	CHF 70,000	4.598.009,87	0,58
CH0025238863	Kuehne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien		STK	8.834	0	0	CHF 275,500	2.538.532,22	0,32
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien		STK	31.735	0	0	CHF 106,280	3.517.982,96	0,45
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien		STK	115.694	0	0	CHF 89,610	10.813.617,33	1,36
CH0018294154	PSP Swiss Property AG Namens-Aktien		STK	12.046	0	0	CHF 106,700	1.340.636,26	0,17
CH0239229302	SFS Group AG Nam.-Aktien		STK	17.911	0	7.314	CHF 101,600	1.898.091,85	0,24
CH1256740924	SGS S.A. Namen-Aktien		STK	18.750	18.750	0	CHF 80,360	1.571.610,36	0,20
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien		STK	12.815	0	0	CHF 539,400	7.209.966,31	0,91
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien		STK	11.261	0	0	CHF 415,000	4.874.485,00	0,62
DKK								7.795.383,60	0,99
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B		STK	45.227	0	0	DKK 1284,600	7.795.383,60	0,99
GBP								39.629.855,11	5,01
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares		STK	250.371	0	117.097	GBP 19,900	5.812.935,06	0,74
GB00BD6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares		STK	213.997	0	0	GBP 20,190	5.040.833,76	0,64
JE00BJVNS543	Ferguson PLC Reg.Shares		STK	5.350	0	0	GBP 126,800	791.464,44	0,10
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares		STK	295.883	0	0	GBP 14,018	4.839.098,25	0,61
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares		STK	185.700	0	0	GBP 25,860	5.602.718,41	0,71
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC Reg.Shares		STK	286.117	54.687	0	GBP 16,495	5.506.230,07	0,70
GB00BP92CJ43	Tate & Lyle PLC Reg.Shares		STK	225.282	0	0	GBP 7,130	1.874.020,74	0,24
GB00BLGZ9862	Tesco PLC Reg.Shs		STK	264.692	0	0	GBP 2,664	822.684,68	0,10
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares		STK	196.983	0	0	GBP 40,640	9.339.869,70	1,17
JPY								33.461.791,86	4,23
JP3219000001	Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares		STK	157.600	0	0	JPY 3.282,000	3.254.227,56	0,41
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares		STK	144.200	0	0	JPY 4.325,000	3.923.778,67	0,50

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares		STK	85.000	0	0	JPY 6.267,000	3.351.442,32	0,42
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares		STK	6.350.025	6.125.724	0	JPY 168,300	6.723.767,39	0,85
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares		STK	380.200	0	25.900	JPY 2.970,500	7.105.502,53	0,90
JP3732000009	SoftBank Corp. Reg.Shares		STK	866.400	409.800	0	JPY 1.670,000	9.103.073,39	1,15
NOK								11.166.496,63	1,42
NO0010161896	DNB Bank ASA Navne-Aksjer		STK	147.033	64.328	0	NOK 210,200	2.674.102,14	0,34
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer		STK	283.819	0	0	NOK 166,100	4.078.885,92	0,52
NO0003733800	Orkla ASA Navne-Aksjer		STK	632.405	0	0	NOK 80,660	4.413.508,57	0,56
SEK								6.457.188,00	0,81
SE0007100581	Assa-Abloy AB Namn-Aktier B		STK	107.581	0	0	SEK 246,500	2.237.639,77	0,28
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A		STK	249.113	0	0	SEK 91,680	1.927.119,60	0,24
SE0000115420	Volvo (publ), AB Namn-Aktier A (fria)		STK	120.319	0	0	SEK 225,800	2.292.428,63	0,29
SGD								1.503.634,63	0,19
SG1L01001701	DBS Group Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	66.400	66.400	0	SGD 33,320	1.503.634,63	0,19
USD								376.321.314,13	47,67
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares		STK	26.933	0	0	USD 104,410	2.581.305,79	0,33
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	38.720	0	0	USD 148,320	5.271.663,67	0,67
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A		STK	12.691	0	0	USD 323,250	3.765.711,17	0,48
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares		STK	31.033	0	0	USD 122,680	3.494.702,07	0,44
US00971T1016	Akamai Technologies Inc. Reg.Shares		STK	21.856	0	18.201	USD 104,640	2.099.331,60	0,27
IE00BFRT3W74	Allegion PLC Reg.Shares		STK	14.089	0	0	USD 113,570	1.468.778,90	0,19
US031621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	31.163	0	0	USD 257,880	7.376.826,18	0,93
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	31.282	0	0	USD 254,930	7.320.286,63	0,93
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares		STK	13.283	0	0	USD 280,300	3.417.683,95	0,43
US1046741062	Brady Corp. Reg.N.Vot.Shs Cl.A		STK	49.438	0	0	USD 50,560	2.294.460,51	0,29
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	104.932	0	0	USD 62,380	6.008.498,40	0,76
US1152361010	Brown & Brown Inc. Reg.Shares		STK	17.618	0	0	USD 74,120	1.198.683,83	0,15
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)		STK	22.800	0	0	USD 94,630	1.980.506,70	0,25
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	3.839	0	0	USD 239,880	845.327,08	0,11
US1344291091	Campbell Soup Co. Reg.Shares		STK	42.838	42.838	0	USD 41,960	1.649.974,74	0,21
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares		STK	68.390	14.371	0	USD 149,960	9.414.140,26	1,18
US03073E1055	Cencora Inc. Reg.Shares		STK	28.492	8.825	0	USD 178,900	4.678.923,08	0,59
IL0010824113	Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares		STK	66.513	18.132	0	USD 134,170	8.191.710,31	1,04
US16359R1032	Chemed Corp. Reg.Shares		STK	13.241	5.250	0	USD 514,140	6.249.061,63	0,79
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares		STK	14.969	0	0	USD 201,760	2.772.301,67	0,35
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	174.502	51.676	0	USD 56,810	9.099.925,30	1,14
US1924461023	Cognizant Technology Sol.Corp. Reg.Shs Cl.A		STK	38.390	0	0	USD 71,490	2.519.277,68	0,32
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares		STK	92.640	16.276	0	USD 73,850	6.280.029,37	0,80
US2058871029	ConAgra Brands Inc. Reg.Shares		STK	35.857	0	0	USD 30,110	991.054,04	0,13
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares		STK	23.029	0	0	USD 232,030	4.904.919,10	0,62
US2358511028	Danaher Corp. Reg.Shares		STK	5.986	0	0	USD 264,170	1.451.552,80	0,18
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	133.909	0	0	USD 27,570	3.388.903,19	0,43
US2855121099	Electronic Arts Inc. Reg.Shares		STK	50.801	0	0	USD 120,550	5.621.498,58	0,71
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	19.361	0	0	USD 459,570	8.167.555,32	1,03
US2910111044	Emerson Electric Co. Reg.Shares		STK	32.156	0	0	USD 98,290	2.901.242,19	0,37
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares		STK	57.024	0	0	USD 117,780	6.165.124,58	0,78
US3119001044	Fastenal Co. Reg.Shares		STK	48.014	0	0	USD 57,780	2.546.584,28	0,32
US3434981011	Flowers Foods Inc. Reg.Shares		STK	130.133	0	58.635	USD 23,610	2.820.304,87	0,36
US3535141028	Franklin Electric Co. Inc. Reg.Shares		STK	32.419	0	0	USD 97,730	2.908.306,29	0,37
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	7.758	7.758	0	USD 351,640	2.504.151,94	0,32
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares		STK	98.709	13.351	0	USD 68,280	6.186.754,65	0,78
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	108.384	0	0	USD 77,660	7.726.364,46	0,98
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares		STK	73.646	0	0	USD 77,500	5.239.182,12	0,66
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	121.165	0	0	USD 76,340	8.490.670,19	1,08
US4435106079	Hubbell Inc. Reg.Shares		STK	9.708	0	0	USD 326,760	2.911.865,32	0,37
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares		STK	10.260	10.260	0	USD 475,260	4.476.012,12	0,57
US4523081093	Illinois Tool Works Inc. Reg.Shares		STK	9.320	0	0	USD 248,270	2.123.991,55	0,27
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares		STK	117.721	0	0	USD 32,920	3.557.348,38	0,45
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares		STK	27.953	0	0	USD 146,860	3.768.292,25	0,48
US8326964058	J.M. Smucker Co. Reg.Shares		STK	54.124	23.218	0	USD 143,880	7.148.302,85	0,91
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	4.395	0	0	USD 148,160	597.726,45	0,08
US4878361082	Kellogg Co. Reg.Shares		STK	79.639	0	0	USD 61,710	4.511.219,65	0,57
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares		STK	41.015	15.595	0	USD 129,460	4.874.060,86	0,62
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares		STK	15.512	0	0	USD 212,360	3.023.800,55	0,38
US5150981018	Landstar System Inc. Reg.Shares		STK	35.637	0	2.916	USD 191,100	6.251.359,19	0,79
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	28.679	0	0	USD 196,150	5.163.746,88	0,65
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares		STK	25.932	0	0	USD 58,220	1.400.147,09	0,18
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	3.516	0	0	USD 421,600	1.360.699,10	0,17
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	90.886	18.838	0	USD 110,210	9.194.553,02	1,15
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	831	0	0	USD 1.217,570	928.768,74	0,12
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	19.102	0	13.750	USD 328,790	5.765.142,81	0,73
US6092071058	Mondelez International Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	30.184	0	0	USD 71,570	1.982.989,61	0,25
US6200763075	Motorola Solutions Inc. Reg.Shares		STK	4.633	0	0	USD 283,190	1.204.350,35	0,15
IE00BDVJQJ56	nVent Electric PLC Reg.Shares		STK	22.829	0	0	USD 55,340	1.159.681,35	0,15
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	54.451	0	11.696	USD 142,210	7.108.019,74	0,90

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares		STK	68.221	18.921	0	USD 82,720	5.180.136,88	0,66
US6951561090	Packaging Corp. of America Reg.Shares		STK	13.870	0	0	USD 149,400	1.902.127,78	0,24
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares		STK	34.684	0	0	USD 122,530	3.901.074,46	0,49
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares		STK	32.246	6.259	0	USD 181,080	5.359.928,11	0,68
US74051N1028	Premier Inc. Reg.Shares		STK	106.642	0	53.024	USD 22,260	2.179.044,35	0,28
US7433121008	Progress Software Corp. Reg.Shares		STK	127.099	0	0	USD 60,970	7.113.297,26	0,90
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares		STK	55.798	0	0	USD 134,680	6.898.177,57	0,87
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	8.392	1.298	0	USD 834,950	6.431.889,48	0,81
US7607591002	Republic Services Inc. Reg.Shares		STK	10.309	0	0	USD 145,900	1.380.652,74	0,17
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares		STK	32.803	0	4.349	USD 268,880	8.096.264,59	1,03
US87901J1051	TEGNA Inc. Reg.Shares		STK	54.975	0	0	USD 16,590	837.190,43	0,11
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares		STK	29.042	0	0	USD 169,230	4.511.453,70	0,57
US912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares		STK	119.140	0	0	USD 60,470	6.613.177,71	0,84
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares		STK	24.118	0	0	USD 217,310	4.810.980,89	0,61
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	4.660	0	0	USD 330,630	1.414.297,60	0,18
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares		STK	123.192	89.245	0	USD 46,520	5.260.594,68	0,67
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	40.001	7.851	0	USD 154,040	5.656.098,81	0,72
US89417E1091	The Travelers Companies Inc. Reg.Shares		STK	10.991	0	0	USD 161,320	1.627.563,91	0,21
US8725401090	TJX Companies Inc. Reg.Shares		STK	18.516	18.516	0	USD 92,140	1.566.058,60	0,20
US90384S3031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares		STK	14.830	3.187	0	USD 422,900	5.756.936,85	0,73
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares CLB		STK	7.290	0	0	USD 172,010	1.151.049,11	0,15
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	13.405	0	0	USD 491,530	6.048.246,42	0,77
US92343E1029	Verisign Inc. Reg.Shares		STK	5.202	5.202	0	USD 209,120	998.570,08	0,13
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	23.551	3.971	0	USD 350,760	7.582.842,63	0,96
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares CL.A		STK	2.961	0	0	USD 246,230	669.255,58	0,08
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	10.250	0	1.202	USD 725,310	6.824.332,20	0,86
US94106L1098	Waste Management Inc. Reg.Shares		STK	9.933	0	0	USD 158,620	1.446.275,44	0,18
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares		STK	8.554	0	0	USD 287,190	2.255.024,11	0,29
US9507551086	Werner Enterprises Inc. Reg.Shares		STK	96.676	0	0	USD 43,240	3.837.222,54	0,49
IE00DBB6Q211	Willis Towers Watson PLC Reg.Shares		STK	14.269	0	0	USD 208,550	2.731.595,33	0,35
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	30.500	0	0	USD 130,100	3.642.417,84	0,46
US98956P1021	Zimmer Biomet Holdings Inc. Reg.Shares		STK	19.318	19.318	0	USD 120,240	2.132.179,47	0,27
Sonstige Beteiligungswertpapiere								6.663.077,82	0,84
CHF								6.663.077,82	0,84
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	24.396	0	0	CHF 261,850	6.663.077,82	0,84
Summe Wertpapiervermögen								EUR 704.607.000,53	89,23
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl 345				1.419.719,69	0,18
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 23		XCME	USD	Anzahl 228				-57.750,00	-0,01
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 23		IFEU	GBP	Anzahl 57				1309.583,80	0,17
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 23		XMOD	CAD	Anzahl 55				-54.178,07	-0,01
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 23		XSFE	AUD	Anzahl 10				120.551,80	0,02
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 23		XEUR	CHF	Anzahl 50				21.659,90	0,00
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (ITI) Sep. 23		XOSE	JPY	Anzahl 29				-95.397,04	-0,01
Summe Aktienindex-Derivate								EUR 1.419.719,69	0,18
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)									
Offene Positionen									
AUD/EUR 400.000,00			OTC					2.624,89	0,00
CAD/EUR 7.500.000,00			OTC					-10.961,64	0,00
CHF/EUR 4.500.000,00			OTC					62.518,05	0,01
DKK/EUR 3.000.000,00			OTC					-303,87	0,00
GBP/EUR 3.000.000,00			OTC					-7.134,07	0,00
JPY/EUR 310.000.000,00			OTC					-7.906,46	0,00
NOK/EUR 8.000.000,00			OTC					-4.982,72	0,00
SEK/EUR 59.500.000,00			OTC					8.994,73	0,00
USD/EUR 3.000.000,00			OTC					-1.936,31	0,00
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								4.113.310,81	0,52
Offene Positionen									
AUD/EUR 14.500.000,00			OTC					446.927,33	0,06
CAD/EUR 113.000.000,00			OTC					1.451.006,57	0,18
CHF/EUR 53.000.000,00			OTC					-833.412,10	-0,11
DKK/EUR 54.500.000,00			OTC					7.079,82	0,00
GBP/EUR 36.000.000,00			OTC					-269.746,19	-0,03
HKD/EUR 1.600.000,00			OTC					1.291,29	0,00
JPY/EUR 5.400.000.000,00			OTC					2.149.567,62	0,27
NOK/EUR 135.000.000,00			OTC					-111.136,26	-0,01
SEK/EUR 138.000.000,00			OTC					223.010,80	0,03
SGD/EUR 2.340.000,00			OTC					22.951,63	0,00
USD/EUR 401.000.000,00			OTC					1.025.770,30	0,13
Summe Devisen-Derivate								EUR 4.154.223,41	0,53
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	24.719.668,00			% 100,000	24.719.668,00	3,12
EUR-Guthaben bei									
	Bayerische Landesbank		EUR	42.714,79			% 100,000	42.714,79	0,01
	Landesbank Saar		EUR	34.416.087,72			% 100,000	34.416.087,72	4,35
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	6.513.787,63			% 100,000	873.987,83	0,11
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	5.601.616,40			% 100,000	484.667,42	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	5.112.202,48			% 100,000	431.365,81	0,05
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	1.517.971,01			% 100,000	903.271,90	0,11
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	1.850.388,15			% 100,000	1.254.623,78	0,16
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	6.187.491,93			% 100,000	6.453.841,99	0,82
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	1.012.310,46			% 100,000	1.181.060,36	0,15
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	1.729.917,63			% 100,000	202.447,94	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	70.631.737,00			% 100,000	444.378,48	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SGD	434.114,76			% 100,000	295.035,18	0,04
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	4.795.732,96			% 100,000	4.402.178,23	0,56
Summe Bankguthaben							EUR	76.105.329,43	9,63
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	76.105.329,43	9,63
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Dividendenansprüche		EUR	820.261,69				820.261,69	0,10
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	4.995.520,20				4.995.520,20	0,63
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	154.284,00				154.284,00	0,02
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	335.054,10				335.054,10	0,04
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	1.150.000,00				1.150.000,00	0,15
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	7.455.119,99	0,94
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-153.207,60				-153.207,60	-0,02
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-1.107.645,70				-1.107.645,70	-0,14
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-2.750.000,00				-2.750.000,00	-0,35
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-4.010.853,30	-0,51
Fondsvermögen							EUR	789.730.539,75	100,00
Umlaufende Anteile Klasse CF							STK	4.018.258,000	
Umlaufende Anteile Klasse TF							STK	1.958.593,000	
Anteilwert Klasse CF							EUR	133,64	
Anteilwert Klasse TF							EUR	129,03	

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

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.08.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85712 = 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45295 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,55765 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,85120 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,95873 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08940 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,47486 = 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,47140 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	158,94500 = 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,54500 = 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,68053 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options

OTC

Over-the-Counter

Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
AUD				
AU000000DXS1	DEXUS Reg.Stapled Secs (Units)	STK	0	135.331
CAD				
CA19239C1068	Cogeco Communications Inc. Reg.Shares (Sub. Vtg.)	STK	0	29.000
CA6665111002	Northland Power Inc. Reg.Shares	STK	0	115.600
CHF				
CH0009002962	Barry Callebaut AG Namens-Aktien	STK	0	934
DKK				
DK0060636678	Tryg AS Navne-Aktier	STK	0	25.350
EUR				
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder	STK	1.879	120.685
FI0009014377	Orion Corp. Reg.Shares Cl.B	STK	0	82.223
FI0009005987	UPM Kymmene Corp. Reg.Shares	STK	0	86.194
FR0000127771	Vivendi SE Actions Porteur	STK	0	435.851
JPY				
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares	STK	0	86.500
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	71.700
SEK				
SE0006993770	Axfood AB Namn-Aktier	STK	0	90.108
SE0000190126	Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria)	STK	0	3.832
SE0005190238	Tele2 AB Namn-Aktier B	STK	0	327.101
USD				
US2244081046	Crane Co. Reg.Shares	STK	8.620	8.620
US2244411052	Crane NXT Co. Reg.Shares	STK	0	8.620
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares	STK	0	12.282
US34965K1079	Fortrea Holdings Inc. Reg.Shares	STK	15.512	15.512
US3029411093	FTI Consulting Inc. Reg.Shares	STK	0	19.040
US4404521001	Hormel Foods Corp. Reg.Shares	STK	0	12.421
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc. Reg.Shares	STK	32.399	32.399
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares	STK	0	55.124
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
CAD				
CA82028K2002	Shaw Communications Inc. Reg.N-Vtg Part.Shs Cl.B	STK	0	45.500
CHF				
CH0002497458	SGS S.A. Namens-Aktien	STK	0	750
EUR				
IE00BZ12WP82	Linde PLC Reg.Shares	STK	0	4.089
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06445809Q1	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	528.709	528.709

Gattungsbezeichnung

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY)

Devisentermingeschäfte

Devisentermingeschäfte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
AUD/EUR	EUR	10.702
CAD/EUR	EUR	79.929
CHF/EUR	EUR	55.052
DKK/EUR	EUR	7.122
GBP/EUR	EUR	41.545
HKD/EUR	EUR	196
JPY/EUR	EUR	36.745
NOK/EUR	EUR	11.939
SEK/EUR	EUR	12.745
SGD/EUR	EUR	1.603
USD/EUR	EUR	363.688

Devisentermingeschäfte (Kauf)

Kauf von Devisen auf Termin:

AUD/EUR	EUR	21.008
CAD/EUR	EUR	160.428
CHF/EUR	EUR	106.657
DKK/EUR	EUR	13.643
GBP/EUR	EUR	81.553
HKD/EUR	EUR	388
JPY/EUR	EUR	67.277

Deka-Nachhaltigkeit StrategieInvest

Gattungsbezeichnung

NOK/EUR
SEK/EUR
SGD/EUR
USD/EUR

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

EUR
EUR
EUR
EUR

Volumen in 1.000

23.093
24.349
3.192
707.324

Deka-Nachhaltigkeit StrategieInvest

Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF	STK	4.018,258
Umlaufende Anteile Klasse TF	STK	1.958,593
Anteilwert Klasse CF	EUR	133,64
Anteilwert Klasse TF	EUR	129,03

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

Investmentanteile

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

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

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

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

Frankfurt am Main, den 1. September 2023
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

17. Mai 1995; die Gesellschaft übernahm das Investmentgeschäft der am 17. August 1956 gegründeten Deka Deutsche Kapitalanlagegesellschaft mbH.

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. August 2023

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



Deka Investment GmbH

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

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

