

# Halbjahresbericht zum 31. Juli 2023. Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect:

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

# Bericht der Geschäftsführung.

31. Juli 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Umbrellafonds Naspas Nachhaltigkeit PortfolioSelect: bestehend aus den vier Teilfonds Naspas Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag, Naspas Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum, Naspas Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance und Naspas Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus für den Zeitraum vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Juli 2023.

Der Berichtszeitraum war von uneinheitlichen konjunkturellen Signalen geprägt, gleichzeitig rückte der Ukraine-Krieg an den Märkten sukzessive in den Hintergrund. Einerseits nahmen Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor angesichts des milden Winters spürbar ab. Die Teuerungsraten entfernten sich zudem im Verlauf von ihren Höchstständen. Demgegenüber hat sich zumindest in Deutschland 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 zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt war, 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 4,0 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen wies trotz zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren im Bankensektor sowie der Auswirkungen steigender Leitzinsen eine Aufwärtsbewegung aus. Insbesondere große Technologiekonzerne verbuchten starke Kurszuwächse. Der Euro bewegte sich im Verhältnis zum US-Dollar in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende Juli bei 1,10 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte unter Schwankungen seitwärts und beendete die Berichtsperiode bei 85,6 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 Anteilhaber im Internet unter [www.deka.de](http://www.deka.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung



Dirk Degenhardt (Vorsitzender)



Dirk Heuser



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag	5
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum	6
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance	7
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus	8
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023	
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag	9
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum	13
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance	17
Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus	21
Fondszusammensetzung	24
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	25

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

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, kann der Teilfonds in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) investieren, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% betragen muss. Die Investitionen in globale Aktien und Aktienfonds können 10%-40%, in Rentenfonds 0%-90%, in übrige Fonds (z.B. Mischfonds) 0%-30% und in Geldmarktfonds 0%-30% des Fondsvermögens betragen. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann die Gewichtung der Anlageklassen gegenüber dem neutralen Musterportfolio je nach Markteinschätzung variieren. Darüber hinaus sind Investitionen in Wertpapiere, Bankguthaben und Sonstige Anlageinstrumente zulässig.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die jeweilige Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens „BBB“ oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

## Wichtige Kennzahlen

### Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag

Performance*	6 Monate
	0,7%
ISIN	LU0104455588
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

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.

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, kann der Teilfonds in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) investieren, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% betragen muss. Die Investitionen in globale Aktien und Aktienfonds können 30%-70%, in Rentenfonds 0%-70%, in übrige Fonds (z.B. Mischfonds) 0%-30% und in Geldmarktfonds 0%-30% des Fondsvermögens betragen. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann die Gewichtung der Anlageklassen gegenüber dem neutralen Musterportfolio je nach Markteinschätzung variieren. Darüber hinaus sind Investitionen in Wertpapiere, Bankguthaben und Sonstige Anlageinstrumente zulässig.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die jeweilige Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens „BBB“ oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

## Wichtige Kennzahlen

### Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum

Performance*	6 Monate
	1,9%
ISIN	LU0104456800
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

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.

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, kann der Teilfonds in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) investieren, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% betragen muss. Die Investitionen in globale Aktien und Aktienfonds betragen mindestens 50%, in Rentenfonds 0%-50%, in übrige Fonds (z.B. Mischfonds) 0%-30% und in Geldmarktfonds 0%-30% des Fondsvermögens. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann die Gewichtung der Anlageklassen gegenüber dem neutralen Musterportfolio je nach Markteinschätzung variieren. Darüber hinaus sind Investitionen in Wertpapiere, Bankguthaben und Sonstige Anlageinstrumente zulässig.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die jeweilige Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens „BBB“ oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

## Wichtige Kennzahlen

### Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance

<b>Performance*</b>	<b>6 Monate</b>
	3,7%
ISIN	LU0104457105
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

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.

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Um dies zu erreichen, kann der Teilfonds in Wertpapiere und Investmentanteile (Zielfonds) investieren, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% betragen muss. Die Investition in globale Aktien und Aktienfonds betragen mindestens 60% des Fondsvermögens, wobei eine nahezu 100%ige Investition in Aktienfonds angestrebt wird. Daneben können Anlagen insbesondere in Rentenfonds (0-40%), übrige Fonds (z.B. Mischfonds 0%-30%) und Geldmarktfonds (0%-30%) erfolgen. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann die Gewichtung der Anlageklassen gegenüber dem neutralen Musterportfolio je nach Markteinschätzung variieren. Darüber hinaus sind Investitionen in Wertpapiere, Bankguthaben und Sonstige Anlageinstrumente zulässig.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die jeweilige Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens „BBB“ oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

## Wichtige Kennzahlen

### Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus

Performance*	6 Monate
	4,8%
ISIN	LU0202181771
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

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.

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>773.277,91</b>	<b>5,10</b>	
<b>Zertifikate</b>								<b>773.277,91</b>	<b>5,10</b>	
<b>EUR</b>								<b>773.277,91</b>	<b>5,10</b>	
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18		STK	10.939	448	508	EUR 70,690	773.277,91	5,10	
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>13.208.218,56</b>	<b>87,01</b>	
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>5.189.555,49</b>	<b>34,20</b>	
<b>EUR</b>								<b>5.189.555,49</b>	<b>34,20</b>	
LU0249486092	Deka-FlexZins Inhaber-Anteile CF		ANT	1.581	0	217	EUR 964,270	1.524.510,87	10,05	
DE000ETFL599	Deka MSCI EO C.CI.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	29.308	0	439	EUR 85,432	2.503.841,06	16,50	
DE000ETFL565	Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	41.611	0	9.718	EUR 14,620	608.352,82	4,01	
DE000ETFL318	Deka MSCI Jap.CI.Change ESG UE Inhaber-Anteile		ANT	13.405	0	10.759	EUR 8,533	114.384,87	0,75	
DE000ETFL573	Deka MSCI USA CI.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile		ANT	9.430	9.132	8.570	EUR 37,915	357.538,45	2,36	
LU0052859252	DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF		ANT	98	0	0	EUR 825,790	80.927,42	0,53	
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>8.018.663,07</b>	<b>52,81</b>	
<b>EUR</b>								<b>6.651.815,13</b>	<b>43,81</b>	
LU0272941112	Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Anteile I (C)		ANT	288	0	0	EUR 1.256,520	361.877,76	2,38	
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.		ANT	30.277	30.277	0	EUR 10,290	311.550,33	2,05	
LU1569900605	Helium Fd-Helium Performance Actions-Nom. E Cap		ANT	330	0	0	EUR 1.175,839	388.026,87	2,56	
IE00BH4G7D40	iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shs Hgd Dis.		ANT	318.182	9.270	0	EUR 4,079	1.297.928,01	8,55	
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.		ANT	160.839	160.839	0	EUR 4,859	781.516,70	5,15	
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares		ANT	18.694	0	14.876	EUR 6,068	113.435,19	0,75	
IE00BJ5JNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.		ANT	23.155	0	10.315	EUR 6,485	150.160,18	0,99	
IE00BYZTVT56	iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares		ANT	154.920	0	0	EUR 4,549	704.793,05	4,64	
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	2.409	0	0	EUR 109,860	264.664,71	1,74	
LU1829219390	MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.		ANT	784	784	0	EUR 122,864	96.325,38	0,63	
LU2016215001	Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.		ANT	53.123	0	0	EUR 11,061	587.572,25	3,87	
DE000A3DQ2Q1	Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X		ANT	3.737	3.737	0	EUR 101,580	379.604,46	2,50	
LU1974696418	UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE A. Nom.(hdg) A-acc.		ANT	86.940	0	0	EUR 10,416	905.567,04	5,97	
LU1669794551	UI-Aktia EM Local Ccy Bond+ Namens-Ant. IX Acc.		ANT	2.620	0	271	EUR 117,860	308.793,20	2,03	
<b>USD</b>								<b>1.366.847,94</b>	<b>9,00</b>	
IE00BFD2H405	First T.G.F.-CI.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A		ANT	2.392	2.392	0	USD 33,590	72.910,42	0,48	
IE00BF16M727	First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.		ANT	6.170	1.000	0	USD 29,765	166.651,59	1,10	
IE000R9FA4A0	iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	119.784	134.845	15.061	USD 5,697	619.268,06	4,08	
IE00B3VWM098	iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)		ANT	567	567	0	USD 467,140	240.352,43	1,58	
LU2146192534	Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.		ANT	170	266	96	USD 614,430	94.785,03	0,62	
LU2016064037	Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	567	0	0	USD 205,780	105.877,73	0,70	
LU2016067568	Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	475	0	200	USD 155,446	67.002,68	0,44	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>13.981.496,47</b>	<b>92,11</b>
<b>Derivate</b>										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl -2				-1.730,00	-0,01	
<b>Optionsrechte **)</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>										
S & P 500 Index (S500) Put Dez. 23 4000				Anzahl 1		USD	32,400	2.940,11	0,02	
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>1.210,11</b>	<b>0,01</b>
<b>Zins-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Zinsterminkontrakte</b>										
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 23		XCBT	USD	1.900.000				-38.594,61	-0,25	
									-25.975,51	-0,17

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 23	XCBT	USD	700.000				-12.619,10	-0,08
	<b>Summe der Zins-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-38.594,61</b>	<b>-0,25</b>
	<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								
	<b>Bankguthaben</b>								
	<b>EUR-Guthaben bei</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.105.947,67			% 100,000	1.105.947,67	7,29
	<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	4.721,94			% 100,000	5.509,04	0,04
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	1.735.960,00			% 100,000	11.079,65	0,07
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	52.008,65			% 100,000	47.194,78	0,31
	<b>Summe der Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>1.169.731,14</b>	<b>7,71</b>
	<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>						<b>EUR</b>	<b>1.169.731,14</b>	<b>7,71</b>
	<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	6.019,90				6.019,90	0,04
	Einschüsse (Initial Margins)		USD	51.100,00				46.370,24	0,31
	Forderungen aus Anteilschneidgeschäften		EUR	169,92				169,92	0,00
	Forderungen aus Bestandsprovisionen		EUR	1.503,42				1.503,42	0,01
	Forderungen aus Fondsausschüttungen		EUR	13.188,60				13.188,60	0,09
	<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>67.252,08</b>	<b>0,45</b>
	<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								
	Verwaltungsvergütung		EUR	-3.212,47				-3.212,47	-0,02
	Kostenpauschale		EUR	-1.284,99				-1.284,99	-0,01
	<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-4.497,46</b>	<b>-0,03</b>
	<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>15.176.597,73</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile</b>						<b>STK</b>	<b>357.897,000</b>	
	<b>Anteilwert</b>						<b>EUR</b>	<b>42,40</b>	
	<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>92,11</b>
	<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>-0,24</b>

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

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

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Zertifikate, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 28.07.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.07.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.07.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85713	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10200	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	156,68000	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.07.2023 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Finanztermingeschäfte		
- gekaufte Terminkontrakte auf Renten	EUR	2.708.966,65
- verkaufte Terminkontrakte auf Indices	EUR	89.280,00

## 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.

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag

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>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
DE000ETFL557	Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT	0	21.946
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU0438336264	BlackRock Str.F-Fxd Inc.Str.Fd Act. Nom. A	ANT	0	3.122
LU0957027591	Fidelity Fds-Eur.High Yield Fd Reg.Shares I Acc.	ANT	0	5.833
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	ANT	0	7.844
IE00BH4GPZ28	SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS Reg.Shs Acc	ANT	0	31.455
LU1495641794	Swisscanto(LU)Eq.-Sus.GI Water Nam.-Anteile DT	ANT	0	522

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag

Verwaltungsvergütung der in dem Teilfonds gehaltenen Investmentanteile per 31.07.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.

	Verwaltungsvergütung in % p.a. per 31.07.2023
Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Anteile I (C)	0,70
Deka MSCI EO C.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,18
Deka MSCI Europ.C.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,25
Deka MSCI Jap.Cl.Change ESG UE Inhaber-Anteile	0,50
Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	0,25
Deka-FlexZins Inhaber-Anteile CF	0,10
DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF	1,25
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R. Acc.	0,64
First T.G.F.-Cl.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A	0,60
First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.	0,60
Helium Fd-Helium Performance Actions-Nom. E Cap	1,25
JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.	0,85
MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.	0,30
Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.	0,80
Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.	0,20
Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X	0,27
UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE A. Nom.(hdg) A-acc.	0,50
UI-Aktia EM Local Ccy Bond+ Namens-Ant. IX Acc.	0,65
iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shs Hgd Dis.	0,17
iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.	0,07
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.	0,25
iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	0,20
iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.	0,25
iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)	0,42
iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares	0,15

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

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>1.537.860,95</b>	<b>4,92</b>
<b>Zertifikate</b>								<b>1.537.860,95</b>	<b>4,92</b>
<b>EUR</b>								<b>1.537.860,95</b>	<b>4,92</b>
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18		STK	21.755	0	0	EUR 70,690	1.537.860,95	4,92
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>26.222.848,35</b>	<b>83,85</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>7.891.308,96</b>	<b>25,23</b>
<b>EUR</b>								<b>7.891.308,96</b>	<b>25,23</b>
DE000ETFL599	Deka MSCI EO C.CI.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	38.556	948	0	EUR 85,432	3.293.916,19	10,53
DE000ETFL565	Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	170.654	0	27.333	EUR 14,620	2.494.961,48	7,98
DE000ETFL318	Deka MSCI Jap.CI.Change ESG UE Inhaber-Anteile		ANT	55.036	0	40.463	EUR 8,533	469.622,19	1,50
DE000ETFL573	Deka MSCI USA CI.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile		ANT	36.727	39.687	37.961	EUR 37,915	1.392.504,21	4,45
LU0052859252	DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF		ANT	291	0	0	EUR 825,790	240.304,89	0,77
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>18.331.539,39</b>	<b>58,62</b>
<b>EUR</b>								<b>12.917.818,75</b>	<b>41,31</b>
LU0272941112	Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Anteile I (C)		ANT	284	0	0	EUR 1.256,520	356.851,68	1,14
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.		ANT	124.306	124.306	0	EUR 10,290	1.279.108,74	4,09
LU1569900605	Helium Fd-Helium Performance Actions-Nom. E Cap		ANT	353	0	0	EUR 1.175,839	415.071,17	1,33
IE00BH4G7D40	iSh.2.plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shs Hgd Dis.		ANT	458.083	18.776	0	EUR 4,079	1.868.612,17	5,98
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.		ANT	321.884	321.884	0	EUR 4,859	1.564.034,36	5,00
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares		ANT	76.751	0	55.919	EUR 6,068	465.725,07	1,49
IE00BJ5JNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.		ANT	95.093	0	47.465	EUR 6,485	616.678,11	1,97
IE00BYZTVT56	iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares		ANT	311.457	15.426	0	EUR 4,549	1.416.942,48	4,53
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	10.791	601	0	EUR 109,860	1.185.454,22	3,79
LU1829219390	MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.		ANT	3.132	3.132	0	EUR 122,864	384.810,05	1,23
LU2016215001	Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.		ANT	39.218	0	0	EUR 11,061	433.774,61	1,39
DE000A3DQ2Q1	Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X		ANT	3.827	3.827	0	EUR 101,580	388.746,66	1,24
LU1974696418	UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE A. Nom.(hdg) A-acc.		ANT	179.178	6.266	0	EUR 10,416	1.866.318,05	5,97
LU1669794551	Ul-Aktia EM Local Ccy Bond+ Namens-Ant. IX Acc.		ANT	5.733	0	0	EUR 117,860	675.691,38	2,16
<b>USD</b>								<b>5.413.720,64</b>	<b>17,31</b>
IE00BFD2H405	First T.G.F.-CI.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A		ANT	9.810	9.810	0	USD 33,590	299.018,06	0,96
IE00BF16M727	First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.		ANT	21.976	1.500	2.612	USD 29,765	593.571,36	1,90
IE0009FA4A0	iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	486.320	538.883	52.563	USD 5,697	2.514.212,61	8,04
IE00B3VWM098	iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)		ANT	2.329	2.329	0	USD 467,140	987.267,75	3,16
LU2146192534	Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.		ANT	698	1.062	364	USD 614,430	389.176,17	1,24
LU2016064037	Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	1.895	0	0	USD 205,780	353.859,44	1,13
LU2016067568	Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	1.961	0	674	USD 155,446	276.615,25	0,88
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 27.760.709,30</b>	<b>88,77</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>-6.055,00</b>	<b>-0,02</b>
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl -7				-6.055,00	-0,02
<b>Optionsrechte**)</b>								<b>11.760,44</b>	<b>0,04</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>								<b>11.760,44</b>	<b>0,04</b>
S & P 500 Index (S500) Put Dez. 23 4000				Anzahl 4			USD 32,400	11.760,44	0,04
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR 5.705,44</b>	<b>0,02</b>
<b>Zins-Derivate</b>									
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>-83.506,82</b>	<b>-0,27</b>
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 23		XEUR	EUR	600.000				-12.060,00	-0,04
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 23		XCBT	USD	3.400.000				-41.061,72	-0,13

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 23	XCBT	USD	1.600.000				-30.385,10	-0,10
	<b>Summe der Zins-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-83.506,82</b>	<b>-0,27</b>
	<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								
	<b>Bankguthaben</b>								
	<b>EUR-Guthaben bei</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	3.353.031,73			% 100,000	3.353.031,73	10,72
	<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	6.173,50			% 100,000	7.202,57	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	96.411,37			% 100,000	87.487,63	0,28
	<b>Summe der Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>3.447.721,93</b>	<b>11,02</b>
	<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>						<b>EUR</b>	<b>3.447.721,93</b>	<b>11,02</b>
	<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	40.477,80				40.477,80	0,13
	Einschüsse (Initial Margins)		USD	103.600,00				94.010,89	0,30
	Forderungen aus Anteilschneidgeschäften		EUR	82,24				82,24	0,00
	Forderungen aus Bestandsprovisionen		EUR	1.919,52				1.919,52	0,01
	Forderungen aus Fondsausschüttungen		EUR	17.350,20				17.350,20	0,06
	<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>153.840,65</b>	<b>0,50</b>
	<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								
	Verwaltungsvergütung		EUR	-9.235,81				-9.235,81	-0,03
	Kostenpauschale		EUR	-2.638,81				-2.638,81	-0,01
	<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-11.874,62</b>	<b>-0,04</b>
	<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>31.272.595,88</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile</b>						<b>STK</b>	<b>762.240,000</b>	
	<b>Anteilwert</b>						<b>EUR</b>	<b>41,03</b>	
	<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>88,77</b>
	<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>-0,25</b>

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

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

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Zertifikate, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 28.07.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.07.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.07.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund (GBP) 0,85713 = 1 Euro (EUR)

Vereinigte Staaten, Dollar (USD) 1,10200 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)  
XCBO Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)  
XCBT Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.07.2023 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Finanztermingeschäfte

- gekaufte Terminkontrakte

auf Renten

EUR

6.036.800,85

- verkaufte Terminkontrakte

auf Indices

EUR

312.480,00

## 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.

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum

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>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
DE000ETFL557	Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT	0	86.653
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU0438336264	BlackRock Str.F-Fxd Inc.Str.Fd Act. Nom. A	ANT	0	3.294
LU0957027591	Fidelity Fds-Eur.High Yield Fd Reg.Shares I Acc.	ANT	0	11.572
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	ANT	3.477	34.435
IE00BH4GPZ28	SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS Reg.Shs Acc	ANT	0	124.209
LU1495641794	Swisscanto(LU)Eq.-Sus.GI Water Nam.-Anteile DT	ANT	0	1.780

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum

Verwaltungsvergütung der in dem Teilfonds gehaltenen Investmentanteile per 31.07.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.

	Verwaltungsvergütung in % p.a. per 31.07.2023
Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Anteile I (C)	0,70
Deka MSCI EO C.CI.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,18
Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,25
Deka MSCI Jap.CI.Change ESG UE Inhaber-Anteile	0,50
Deka MSCI USA CI.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	0,25
DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF	1,25
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.	0,64
First T.G.F.-CI.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A	0,60
First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.	0,60
Helium Fd-Helium Performance Actions-Nom. E Cap	1,25
JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.	0,85
MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.	0,30
Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.	0,80
Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.	0,20
Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X	0,27
UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE A. Nom.(hdg) A-acc.	0,50
UI-Aktia EM Local Ccy Bond+ Namens-Ant. IX Acc.	0,65
iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shs Hgd Dis.	0,17
iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.	0,07
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.	0,25
iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	0,20
iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.	0,25
iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)	0,42
iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares	0,15

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

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>2.195.702,09</b>	<b>5,01</b>	
<b>Zertifikate</b>								<b>2.195.702,09</b>	<b>5,01</b>	
<b>EUR</b>								<b>2.195.702,09</b>	<b>5,01</b>	
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18		STK	31.061	2.790	1.698	EUR 70,690	2.195.702,09	5,01	
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>36.944.500,34</b>	<b>84,34</b>	
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>9.907.091,82</b>	<b>22,61</b>	
<b>EUR</b>								<b>9.907.091,82</b>	<b>22,61</b>	
DE000ETFL599	Deka MSCI EO C.CI.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	25.616	1.031	0	EUR 85,432	2.188.426,11	4,99	
DE000ETFL565	Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	180.565	7.191	54.422	EUR 14,620	2.639.860,30	6,03	
DE000ETFL318	Deka MSCI Jap.CI.Change ESG UE Inhaber-Anteile		ANT	114.826	0	86.707	EUR 8,533	979.810,26	2,24	
DE000ETFL573	Deka MSCI USA CI.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile		ANT	96.240	68.201	64.947	EUR 37,915	3.648.939,60	8,32	
LU0052859252	DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF		ANT	545	0	0	EUR 825,790	450.055,55	1,03	
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>27.037.408,52</b>	<b>61,73</b>	
<b>EUR</b>								<b>15.335.451,54</b>	<b>35,03</b>	
LU0272941112	Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Anteile I (C)		ANT	504	504	0	EUR 1.256,520	633.286,08	1,45	
LU2608816471	FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.		ANT	126.858	126.858	0	EUR 10,460	1.326.934,68	3,03	
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.		ANT	216.125	216.125	0	EUR 10,290	2.223.926,25	5,08	
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares		ANT	160.132	0	119.843	EUR 6,068	971.680,98	2,22	
IE00BKVL7D31	iShs VI-iSh.Edg.MSCI Eur.M.V.E Reg.Shares (Acc)		ANT	393.813	409.141	15.328	EUR 6,748	2.657.450,12	6,07	
IE00BJ5JNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.		ANT	198.372	0	95.405	EUR 6,485	1.286.442,42	2,94	
IE00BYZTVT56	iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares		ANT	482.244	243.532	0	EUR 4,549	2.193.920,85	5,01	
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	14.918	882	0	EUR 109,860	1.638.914,44	3,74	
LU1829219390	MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.		ANT	5.670	6.462	792	EUR 122,864	696.638,88	1,59	
LU2196483163	Nordea 1-Emerging Stars Bd Fd Act. Nom. HBI Acc.		ANT	12.537	0	0	EUR 84,477	1.059.090,66	2,42	
DE000A3DQ2Q1	Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X		ANT	6.371	6.371	0	EUR 101,580	647.166,18	1,48	
<b>USD</b>								<b>11.701.956,98</b>	<b>26,70</b>	
LU1200235437	DPAM L-Bonds Em.Mkts. Sust. Actions au Port.F Acc.		ANT	9.753	0	0	USD 129,060	1.142.216,13	2,61	
IE00BFD2H405	First T.G.F.-CI.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A		ANT	20.434	20.434	0	USD 33,590	622.847,60	1,42	
IE00BF16M727	First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.		ANT	45.733	3.500	4.941	USD 29,765	1.235.247,50	2,82	
IE000R9FA4A0	iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	892.543	974.291	81.748	USD 5,697	4.614.333,92	10,52	
IE00B3VWM098	iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)		ANT	4.641	4.859	218	USD 467,140	1.967.329,17	4,49	
LU2146192534	Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.		ANT	1.454	2.192	738	USD 614,430	810.690,76	1,85	
LU2016064037	Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	3.925	0	0	USD 205,780	732.927,86	1,67	
LU2016067568	Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	4.086	0	1.261	USD 155,446	576.364,04	1,32	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>39.140.202,43</b>	<b>89,35</b>
<b>Derivate</b>										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl -15				-12.975,00	-0,03	
<b>Optionsrechte***)</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>										
S & P 500 Index (S500) Put Dez. 23 4000		XCBO		Anzahl 7			USD 32,400	20.580,76	0,05	
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>7.605,76</b>	<b>0,02</b>
<b>Zins-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Zinsterminkontrakte</b>										
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 23		XCBT	USD	1.700.000				11.328,83	0,03	
US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 23		XCBT	USD	2.500.000				-48.363,77	-0,11	
<b>Summe der Zins-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>-37.034,94</b>	<b>-0,08</b>

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	2.910.029,85			% 100,000	2.910.029,85	6,63
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	14.206,28			% 100,000	16.574,34	0,04
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	1.572,00			% 100,000	10,03	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	1.803.096,24			% 100,000	1.636.203,48	3,73
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>4.562.817,70</b>	<b>10,40</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>4.562.817,70</b>	<b>10,40</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	45.149,90				45.149,90	0,10
	Einschüsse (Initial Margins)		USD	111.300,00				100.998,19	0,23
	Forderungen aus Anteilschneidengeschäften		EUR	119,10				119,10	0,00
	Forderungen aus Bestandsprovisionen		EUR	1.292,70				1.292,70	0,00
	Forderungen aus Fondsausschüttungen		EUR	11.527,20				11.527,20	0,03
<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>159.087,09</b>	<b>0,36</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verwaltungsvergütung		EUR	-16.566,54				-16.566,54	-0,04
	Kostenpauschale		EUR	-3.681,44				-3.681,44	-0,01
<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-20.247,98</b>	<b>-0,05</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>43.812.430,06</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>737.404,000</b>	
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>59,41</b>	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>89,35</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>-0,06</b>

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

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

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Zertifikate, Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 28.07.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.07.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.07.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85713 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10200 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	156,68000 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.07.2023 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Finanztermingeschäfte		
- gekaufte Terminkontrakte auf Renten	EUR	4.536.382,72
- verkaufte Terminkontrakte auf Indices	EUR	669.600,00

## 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.

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance

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>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
DE000ETFL557	Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT	0	171.567
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU0957027591	Fidelity Fds-Eur.High Yield Fd Reg.Shares I Acc.	ANT	0	16.537
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	ANT	4.754	47.400
IE00B86MWN23	iShs VI-E.MSCI Eur.Min.Vol.U.E Reg.Shares (Acc)	ANT	0	49.514
IE00BH4GPZ28	SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS Reg.Shs Acc	ANT	0	231.609
LU1495641794	Swisscanto(LU)Eq.-Sus.GI Water Nam.-Anteile DT	ANT	0	3.838
<b>USD</b>				
LU1102506067	FF-Sustainable Em.Mkts Eq,Fd Reg.Acc.Shs I (INE)	ANT	5.832	86.474

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance

Verwaltungsvergütung der in dem Teilfonds gehaltenen Investmentanteile per 31.07.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.

	Verwaltungsvergütung in % p.a. per 31.07.2023
Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro Nam.-Anteile I (C)	0,70
DPAM L-Bonds Em.Mkts. Sust. Actions au Port.F Acc.	0,40
Deka MSCI EO C.CI.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,18
Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,25
Deka MSCI Jap.CI.Change ESG UE Inhaber-Anteile	0,50
Deka MSCI USA CI.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	0,25
DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF	1,25
FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.	0,64
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.	0,64
First T.G.F.-CI.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A	0,60
First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.	0,60
JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.	0,85
MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.	0,30
Nordea 1-Emerging Stars Bd Fd Act. Nom. HBI Acc.	0,50
Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.	0,80
Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
Systematic Dispersion Fund Inhaber-Anteile X	0,27
iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.	0,07
iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	0,20
iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.	0,25
iShs VI-iSh.Edg.MSCI Eur.M.V.E Reg.Shares (Acc)	0,25
iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)	0,42
iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares	0,15

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

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus

## Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>48.494.964,52</b>	<b>86,56</b>	
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>13.403.217,80</b>	<b>23,91</b>	
<b>EUR</b>								<b>13.403.217,80</b>	<b>23,91</b>	
LU0249486092	Deka-FlexZins Inhaber-Anteile CF		ANT	1.443	4.095	2.652	EUR 964,270	1.391.441,61	2,48	
DE000ETFL565	Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	187.929	0	0	EUR 14,620	2.747.521,98	4,90	
DE000ETFL318	Deka MSCI Jap.CI.Change ESG UE Inhaber-Anteile		ANT	193.761	0	200.660	EUR 8,533	1.653.362,61	2,95	
DE000ETFL573	Deka MSCI USA CI.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile		ANT	178.520	112.018	101.121	EUR 37,915	6.768.585,80	12,08	
LU0052859252	DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF		ANT	1.020	0	0	EUR 825,790	842.305,80	1,50	
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>35.091.746,72</b>	<b>62,65</b>	
<b>EUR</b>								<b>17.405.651,97</b>	<b>31,08</b>	
LU2608816471	FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.		ANT	173.841	173.841	0	EUR 10,460	1.818.376,86	3,25	
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.		ANT	328.225	328.225	0	EUR 10,290	3.377.435,25	6,03	
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares		ANT	225.176	0	100.554	EUR 6,068	1.366.367,97	2,44	
IE00BYVJRP78	iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares		ANT	245.379	19.830	0	EUR 6,664	1.635.205,66	2,92	
IE00BKVL7D31	iShs VI-iSh.Edg.MSCI Eur.M.V.E Reg.Shares (Acc)		ANT	409.779	409.779	0	EUR 6,748	2.765.188,69	4,94	
IE00BJ5JNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.		ANT	352.437	58.282	184.894	EUR 6,485	2.285.553,95	4,08	
IE00B1YZSC51	iShsII-Core MSCI Europe U.ETF Reg.Shares		ANT	57.496	0	36.884	EUR 29,530	1.697.856,88	3,03	
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	11.511	1.055	0	EUR 109,860	1.264.568,58	2,26	
LU1829219390	MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.		ANT	9.727	10.720	993	EUR 122,864	1.195.098,13	2,13	
<b>USD</b>								<b>17.686.094,75</b>	<b>31,57</b>	
IE00BFD2H405	First T.G.F.-CI.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A		ANT	34.440	34.440	0	USD 33,590	1.049.763,70	1,87	
IE00BF16M727	First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.		ANT	74.496	7.590	14.865	USD 29,765	2.012.135,61	3,59	
IE000R9FA4A0	iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	1.351.336	1.448.849	97.513	USD 5,697	6.986.235,44	12,48	
IE00B3VWM098	iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)		ANT	9.308	9.709	401	USD 467,140	3.945.679,78	7,04	
LU2146192534	Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.		ANT	2.451	3.627	1.176	USD 614,430	1.366.577,07	2,44	
LU2016064037	Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	7.253	625	0	USD 205,780	1.354.375,99	2,42	
LU2016067568	Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	6.886	787	2.540	USD 155,446	971.327,16	1,73	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>48.494.964,52</b>	<b>86,56</b>
<b>Derivate</b>										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep. 23		XEUR	EUR	Anzahl -13				-11.280,00	-0,02	
<b>Optionsrechte**)</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>										
S & P 500 Index (S500) Put Dez. 23 4000			XCBO	Anzahl 13			USD 32,400	38.221,42	0,07	
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>26.941,42</b>	<b>0,05</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei</b>										
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	5.392.912,08			% 100,000	5.392.912,08	9,63	
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	24.594,84			% 100,000	28.694,58	0,05	
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	11.461,00			% 100,000	73,15	0,00	
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	2.278.471,42			% 100,000	2.067.578,42	3,69	
<b>Summe der Bankguthaben</b>								<b>EUR</b>	<b>7.489.258,23</b>	<b>13,37</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR</b>	<b>7.489.258,23</b>	<b>13,37</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	39.129,80				39.129,80	0,07	
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	5.997,00				5.997,00	0,01	
Forderungen aus Bestandsprovisionen			EUR	2.486,59				2.486,59	0,00	
<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR</b>	<b>47.613,39</b>	<b>0,08</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
Verwaltungsvergütung			EUR	-25.737,59				-25.737,59	-0,05	
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-2.398,80				-2.398,80	0,00	

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Kostenpauschale		EUR	-4.679,58				-4.679,58	-0,01
	<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-32.815,97</b>	<b>-0,06</b>
	<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>56.025.961,59</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile</b>						<b>STK</b>	<b>468.312,000</b>	
	<b>Anteilwert</b>						<b>EUR</b>	<b>119,63</b>	
	<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>86,56</b>
	<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>0,05</b>

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

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

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In-/ ausländische Wertpapier-Investmentanteile und Derivate per: 28.07.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.07.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.07.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85713	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10200	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	156,68000	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)

## Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.07.2023 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Finanztermingeschäfte

- verkaufte Terminkontrakte

auf Indices

EUR

580.320,00

## 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.

## 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>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
DE000ETFL557	Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT	7.191	281.033
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU1953137681	BNP PE-MSCI EMU SRI SS CAP.5PC Nam.-Ant. UCITS ETF	ANT	0	134.426
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	ANT	6.043	58.991
IE00B86MWN23	iShs VI-E.MSCI Eur.Min.Vol.U.E Reg.Shares (Acc)	ANT	0	52.903
IE00BH4GPZ28	SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS Reg.Shs Acc	ANT	23.862	300.717
LU1495641794	Swisscanto(LU)Eq.-Sus.GI Water Nam.-Anteile DT	ANT	0	6.214
<b>USD</b>				
LU1102506067	FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Reg.Acc.Shs I (INE)	ANT	7.832	116.298

# Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus

Verwaltungsvergütung der in dem Teilfonds gehaltenen Investmentanteile per 31.07.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.

	Verwaltungsvergütung in % p.a. per 31.07.2023
Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,25
Deka MSCI Jap.CI.Change ESG UE Inhaber-Anteile	0,50
Deka MSCI USA CI.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	0,25
Deka-FlexZins Inhaber-Anteile CF	0,10
DekaLuxTeam-Aktien Asien Inhaber-Anteile CF	1,25
FF-Sustainable Em.Mkts Eq.Fd Act.Nom. R Acc.	0,64
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.	0,64
First T.G.F.-CI.Comput. UC.ETF Reg.Acc.Shs A	0,60
First Tr.GF-Nasdaq Cyber.ETF Reg.Shs A Acc.	0,60
JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.	0,85
MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.	0,30
Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I Acc.	0,80
Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
iShs 3-iShs S&P 500 ESG ETF Reg.Shs Acc.	0,07
iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares	0,35
iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	0,20
iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.	0,25
iShs VI-iSh.Edg.MSCI Eur.M.V.E Reg.Shares (Acc)	0,25
iShs VII-MUSSCEEH UC.ETF Reg.Shares (Acc)	0,42
iShsII-Core MSCI Europe U.ETF Reg.Shares	0,35

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

# Fondszusammensetzung.

	Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Ertrag in EUR	Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Wachstum in EUR	Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance in EUR	Naspa Nachhaltigkeit PortfolioSelect: Chance Plus in EUR
<b>Vermögensaufstellung</b>				
Wertpapiervermögen	13.981.496,47	27.760.709,30	39.140.202,43	48.494.964,52
Derivate	-37.384,50	-77.801,38	-29.429,18	26.941,42
Bankguthaben/Geldmarktfonds	1.169.731,14	3.447.721,93	4.562.817,70	7.489.258,23
Sonstige Vermögensgegenstände	67.252,08	153.840,65	159.087,09	47.613,39
Sonstige Verbindlichkeiten	-4.497,46	-11.874,62	-20.247,98	-32.815,97
<b>Fondsvermögen</b>	<b>15.176.597,73</b>	<b>31.272.595,88</b>	<b>43.812.430,06</b>	<b>56.025.961,59</b>
				<b>Gesamt in EUR</b>
<b>Vermögensaufstellung</b>				
Wertpapiervermögen				129.377.372,72
Derivate				-117.673,64
Bankguthaben/Geldmarktfonds				16.669.529,00
Sonstige Vermögensgegenstände				427.793,21
Sonstige Verbindlichkeiten				-69.436,03
<b>Fondsvermögen</b>				<b>146.287.585,26</b>

---

Luxemburg, den 1. August 2023  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## **Verwaltungsgesellschaft**

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

Zweigniederlassung

Deka Vermögensmanagement GmbH,  
Zweigniederlassung Luxemburg  
6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Luxembourg

## **Eigenmittel der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main**

**zum 31. Dezember 2022**

gezeichnet und eingezahlt  
haftend

EUR 10,2 Mio.

EUR 22,4 Mio.

## **Leitung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg**

Jörg Palms

## **Geschäftsführung der**

### **Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main**

Dirk Degenhardt (Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der bevestor GmbH,  
Frankfurt am Main

Dirk Heuser

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

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

## **Aufsichtsrat der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main**

### **Vorsitzender**

Dr. Matthias Danne  
Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der  
DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Investment 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 Investment GmbH, Frankfurt am Main

und der

S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;

Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,  
Wiesbaden

## **Mitglieder**

Serge Demolière, Berlin

Wolfgang Dürr, Trier

Carmen Lehr, Heilenbach

Victor Moflakhar, Bad Nauheim

## **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**

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

## **Vertrieb in der Bundesrepublik Deutschland**

Nassauische Sparkasse  
Rheinstraße 42-46  
65185 Wiesbaden  
Deutschland

Stand: 31. Juli 2023

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

**Überreicht durch:**

Nassauische Sparkasse  
Rheinstraße 42-46  
65185 Wiesbaden  
Deutschland

**Deka Vermögens-  
management GmbH**

Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 0523  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 85 00  
Telefax: (0 69) 71 47 - 86 50  
[www.deka.de](http://www.deka.de)



**Deka Vermögens-  
management GmbH,  
Zweigniederlassung  
Luxemburg**

6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel  
Postfach 504  
2015 Luxembourg  
Luxembourg

Telefon: (+3 52) 34 09 - 27 39  
Telefax: (+3 52) 34 09 - 22 90