

Jahresbericht
zum 31. Dezember 2022.
**Deka-Nachhaltigkeit Multi
Asset**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. Dezember 2022

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022.

An den internationalen Finanzmärkten bildete bis in das erste Quartal 2022 hinein die Corona-Pandemie und ihre Auswirkungen den primären Einflussfaktor. Die von Impffortschritten und hoher Liquidität am Markt getriebene Erholung der globalen Wirtschaft sowie die starke Nachfrage an den Aktienmärkten fand im Februar mit dem Einmarsch Russlands in die Ukraine eine abrupte Zäsur. Die als Reaktion hierauf initiierten Sanktionsmaßnahmen des Westens gegen den russischen Aggressor setzten eine Vergeltungsspirale in Gang, in deren Folge Russland u.a. einen Lieferstopp bzw. reduzierte Liefermengen von Gas an verschiedene europäische Länder veranlasste. Exorbitante Preissteigerungen sowie wachsende Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im Winter sorgten für große Verunsicherung, insbesondere in Europa.

In der Geld- und Fiskalpolitik rückte im Laufe des Berichtszeitraums die sprunghafte Inflationsentwicklung in den Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu einer scharfen Zinswende zwang. Während die Fed zum Stichtag mittlerweile bei einem Leitzinsintervall von 4,25 bis 4,50 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen seit Juli 2022 bislang erst auf 2,50 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in den kommenden Monaten in Aussicht gestellt, wobei die Zinsschritte zuletzt gemäßiger ausfielen. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo merklich an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,6 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,9 Prozent.

Angesichts zahlreicher Belastungsfaktoren und Unsicherheiten wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode starke Schwankungen auf. Zwischen Februar und September kam es zu einer ausgeprägten Korrekturphase, ehe in den letzten Monaten eine Gegenbewegung einsetzte. Stark unter Druck geriet der Euro, der zeitweise unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, ehe zum Ende des Berichtszeitraums eine deutliche Erholung festzustellen war. Explodierte der Ölpreis im ersten und zweiten Quartal noch regelrecht, so befand er sich im letzten Halbjahr 2022 hingegen auf Talfahrt und lag zuletzt deutlich unter 100 US-Dollar pro Barrel (Brent).

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

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

Tätigkeitsbericht	5
Anteilklassen im Überblick	8
Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022	9
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022	11
Anhang	28
Ökologische und/oder soziale Merkmale	33
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	50
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	52

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

Jahresbericht 01.01.2022 bis 31.12.2022

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Tätigkeitsbericht.

Das Anlageziel des Investmentfonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset ist ein mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und die positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte.

Der fundamental und aktiv gemanagte Fonds kann weltweit in unterschiedliche Anlageklassen investieren. Im Rahmen des Wertpapierauswahlprozesses werden neben wirtschaftlichen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien (Ökologie, Soziales und Governance) berücksichtigt. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Aktien, Aktienfonds und Aktienderivate investiert werden darf, beträgt maximal 60 Prozent. Höchstens 40 Prozent des Wertes des Fondsvermögens darf in nicht gegen Euro abgesicherte Fremdwährungsbestände angelegt werden. Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden. Der Investmentfonds darf mehr als 35 Prozent des Wertes des Fondsvermögens in Schuldverschreibungen, Schuldscheindarlehen und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland anlegen.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental geprägte Investmentansatz erfolgt nach einer Top-down und Bottom-up Betrachtung. Der Ausgangspunkt ist zunächst die weltweite volkswirtschaftliche Untersuchung (Top-down-Perspektive), um die wesentlichen makroökonomischen Einflussfaktoren auf die Investmententscheidung zu bestimmen. Anschließend erfolgt bei der Zusammensetzung des Portfolios eine qualitative Einschätzung der einzelnen Vermögensgegenstände anhand verschiedener Kriterien (Bottom-up-Perspektive). Bei Aktien sind dies z.B. die Bewertung des Geschäftsmodells oder der Managementqualität, bei Anleihen z.B. die Kreditqualität oder die relative Bewertung einer Anleihe zur eigenen Zinskurve. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

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

Aktienengagement verringert

An den internationalen Finanzmärkten bestimmte bis zum Beginn des Jahres 2022 die Corona-Pandemie das Marktgeschehen. Mit dem völkerrechtswidrigen Überfall Russlands auf die Ukraine Ende Februar kam ein weiterer Krisenherd hinzu. Explodierende Energie- und Rohstoffpreise als Folge der wechselseitigen Sanktionsmaßnahmen sorgten für massive Verunsicherung und rückläufige Kurse. Daneben führte die Null-Covid-Politik in China mit damit einhergehenden Lockdown-Maßnahmen zu wiederholten Beeinträchtigungen im internationalen Handel, die sich auch an den Finanzmärkten niederschlugen.

Wichtige Kennzahlen

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	seit Auflegung p.a.
Anteilklasse CF	-13,7%	-	-1,1%
Anteilklasse TF	-14,1%	-	-1,6%

ISIN

Anteilklasse CF	DE000DK0V5F0
Anteilklasse TF	DE000DK0V5G8

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

Veräußerungsergebnisse im Berichtszeitraum

Anteilklasse CF

Realisierte Gewinne aus	in Euro
Renten und Zertifikate	12.433,29
Aktien	875.179,03
Zielfonds und Investmentvermögen	73.434,37
Optionen	496.272,25
Futures	5.056.451,74
Swaps	123.100,32
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	4.524.113,60
Devisenkassageschäften	89.158,56
sonstigen Wertpapieren	3,04
Summe	11.250.146,20

Realisierte Verluste aus	in Euro
Renten und Zertifikate	-1.810.282,95
Aktien	-1.568.756,71
Zielfonds und Investmentvermögen	-1.659.990,69
Optionen	-328.144,64
Futures	-3.263.944,00
Swaps	-114.346,44
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	-4.449.916,54
Devisenkassageschäften	-47.265,16
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	-13.242.647,13

Die Angaben spiegeln das Verhältnis der Veräußerungsergebnisse in den anderen Anteilklassen des Sondervermögens wider.

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

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Wachstumswerte wie Technologietitel und Unternehmen, welche den Umbau zu einer nachhaltigen Wirtschaft finanzieren müssen, waren vom Zinsanstieg stärker belastet als traditionelle Werte. Nach Beginn des Ukraine-Krieges bestand insbesondere Nachfrage nach Energietiteln (Öl & Gas) sowie Rüstungsaktien. Beide Entwicklungen waren für das Sondervermögen nachteilig.

Das Fondsmanagement verringerte in der ersten Berichtshälfte die Aktienmarktpositionierung. Europäische Aktien wurden angesichts der Auswirkungen des Ukraine-Konflikts temporär stärker reduziert, US-Aktien dagegen tendenziell erhöht. Ende Dezember umfassten Aktien und Aktienfonds insgesamt 48,5 Prozent des Fondsvolumens. Auf der Aktienseite standen nordamerikanische, europäische und japanische Einzeltitel im Fokus der Investitionen. Unter Branchengesichtspunkten fanden per saldo nur leichte Anpassungen statt. Pharma, Industrie und Technologie bildeten weiterhin die größten Sektorbestände im Portfolio. Sechs ETF (Exchange Traded Funds) mit unterschiedlichen regionalen Ausrichtungen (USA, Europa, Japan und Schwellenländer) ergänzten das Aktiensegment. Zudem nutzte das Fondsmanagement Futures auf Aktienindizes, die den wirtschaftlichen Investitionsgrad in Aktien Ende Dezember um 0,2 Prozentpunkte erhöhten.

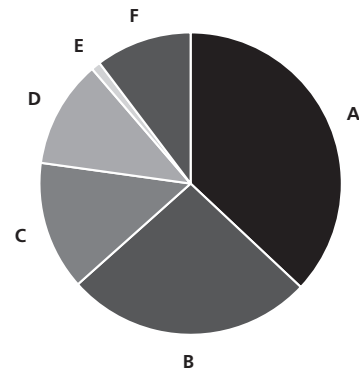
Die Anlagen im Rentenbereich wurden insgesamt erhöht und die Duration aktiv gesteuert. Zum Stichtag entfielen auf den Rentenbereich 41,2 Prozent des Fondsvolumens (inkl. Wertpapiere mit besonderen Merkmalen), wobei der größere Teil auf nachhaltige Rentenfonds mit unterschiedlichen thematischen und regionalen Schwerpunkten entfiel. Anlagen im Bereich Anleihen aus EM-Länder wurden vor dem Hintergrund der extremen Anstiege der Energie- und Nahrungsmittelpreise reduziert, da diese stärker von den Auswirkungen betroffen sind. Zudem umfasste das Segment Unternehmensanleihen, Euroland-Staatsanleihen und Titel halbstaatlicher Emittenten. Corporate Bonds erschienen nach diversen Zinserhöhungsrunden wieder verstärkt mit einem attraktiven Chance/Risiko-Verhältnis. Kurze Laufzeiten wurden tendenziell bevorzugt. Daneben kamen Zinsterminkontrakte und Swaps mit Rentenkomponente zur Steuerung des Segments zum Einsatz.

Darüber hinaus kamen Devisentermingeschäfte auf verschiedene Währungen zum Einsatz. Unter Fremdwährungsgesichtspunkten bestanden unter anderem aktive Positionen in US-Dollar, japanischen Yen und Schweizer Franken. Zudem wurden Australien- und Neuseeland-Dollar unter Ertragsgesichtspunkten neu ins Portfolio integriert.

Positive Effekte für die Fondsentwicklung lieferte die US-Dollar-Quote sowie die relativ kurze Duration. Insgesamt war das Marktumfeld jedoch von belastenden Faktoren dominiert, welche sich auch in der Fondsperformance niederschlug. Die wesentlichen Quellen des Veräußerungsergebnisses stellten sich im Berichtszeitraum wie folgt dar:

Fondsstruktur

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset



A	Aktien	37,0%
B	Rentenfonds	26,4%
C	Festverzinsliche Wertpapiere	13,8%
D	Aktienfonds	11,5%
E	Wertpapiere mit besonderen Merkmalen	1,0%
F	Barreserve, Sonstiges	10,3%

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

Wertentwicklung im Berichtszeitraum

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Index: 31.12.2021 = 100



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

Die realisierten Gewinne resultierten im Wesentlichen aus dem Handel mit Futures, Devisentermingeschäften und Aktien. Für die realisierten Verluste waren vorrangig die Veräußerung von Devisentermingeschäften, Futures sowie Renten und Zertifikaten maßgeblich.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Anteile an dem Sondervermögen sind Wertpapiere, deren Preise durch die börsentäglichen Kursschwankungen der im Fonds befindlichen Vermögensgegenstände bestimmt werden und deshalb steigen oder auch fallen können (Marktpreisrisiken).

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen i.d.R. die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Durch die Investition des Fonds in Anleihen können bei Ausfall eines Emittenten Verluste für den Fonds entstehen.

Aufgrund der Investitionen in fremde Währungen unterlag der Fonds Fremdwährungsrisiken. Darüber hinaus waren Derivate im Portfolio enthalten, sodass auch hierfür spezifische Risiken wie das Kontrahentenrisiko zu beachten waren.

Die Risiken von Investmentanteilen, die für einen Fonds erworben werden (so genannte „Zielfonds“), stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Zielfonds enthaltene Vermögensgegenstände. Da die Manager der einzelnen Zielfonds voneinander unabhängig handeln, kann es vorkommen, dass mehrere Zielfonds gleiche Engagements tätigen.

Dieses Sondervermögen enthält Anteile an anderen Fonds, die in Aktien und Renten investieren. Insofern unterliegt der Fonds mittelbar spezifischen Risiken wie dem Zinsänderungs- und Adressenausfallrisiko sowie Aktienkursrisiken.

Die Einschätzung der im Berichtsjahr eingegangenen Liquiditätsrisiken orientiert sich an der Veräußerbarkeit von Vermögenswerten, die potenziell eingeschränkt sein kann. Der Fonds verzeichnete im Berichtszeitraum keine wesentlichen Liquiditätsrisiken. Zur Bewertung und Vermeidung operationeller Risiken führt die Gesellschaft detaillierte Risikoüberprüfungen durch. Das Sondervermögen unterlag im Berichtszeitraum keinen besonderen operationellen Risiken.

In der Berichtsperiode verzeichnete der Fonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset eine Wertentwicklung von minus 13,7 Prozent (Anteilklasse CF) bzw. minus 14,1 Prozent (Anteilklasse TF).

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung*, der Währung des Anteilwertes, 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 das gesamte Sondervermögen nach § 168 Absatz 1 Satz 1 KAGB ermittelten Wertes zu berechnen.

Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	1,00% p.a.	3,00%	Ausschüttung
Anteilklasse TF**	1,50% 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 Multi Asset

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	76.362.800,24	36,21
Belgien	486.728,47	0,23
Bermuda	127.952,54	0,06
Dänemark	3.720.164,09	1,76
Deutschland	3.579.953,23	1,69
Finnland	767.277,82	0,36
Frankreich	6.227.646,74	2,97
Großbritannien	5.021.087,83	2,39
Irland	1.438.681,19	0,69
Italien	1.099.508,89	0,51
Japan	9.562.343,78	4,55
Niederlande	4.299.355,94	2,05
Norwegen	565.284,86	0,26
Österreich	93.336,10	0,04
Schweden	776.608,12	0,36
Schweiz	2.848.391,91	1,35
Spanien	1.272.791,00	0,61
USA	34.475.687,73	16,33
2. Anleihen	30.811.717,47	14,62
Belgien	902.853,10	0,42
Dänemark	455.240,00	0,22
Deutschland	3.853.727,52	1,81
Finnland	1.094.766,00	0,52
Frankreich	3.002.981,00	1,42
Griechenland	892.308,00	0,42
Großbritannien	492.232,50	0,23
Irland	410.551,99	0,19
Italien	1.967.859,50	0,93
Japan	184.613,73	0,09
Lettland	137.345,25	0,07
Luxemburg	1.112.766,00	0,53
Niederlande	4.354.416,05	2,08
Norwegen	675.507,50	0,32
Österreich	133.096,15	0,06
Polen	80.679,00	0,04
Portugal	1.907.411,08	0,91
Schweiz	674.454,00	0,32
Slowakei	1.074.726,25	0,51
Slowenien	1.117.292,90	0,53
Spanien	4.748.002,65	2,27
Ungarn	666.250,00	0,32
USA	764.845,50	0,36
Zypern	107.791,80	0,05
3. Investmentanteile	79.738.758,32	37,92
Irland	55.516.943,78	26,41
Luxemburg	24.221.814,54	11,51
4. Sonstige Wertpapiere	1.475.440,65	0,70
Schweiz	1.475.440,65	0,70
5. Derivate	-4.024.803,08	-1,94
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	20.552.261,51	9,80
7. Sonstige Vermögensgegenstände	5.987.115,57	2,84
II. Verbindlichkeiten	-317.733,32	-0,15
III. Fondsvermögen	210.585.557,36	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	76.362.800,24	36,21
CHF	2.310.543,98	1,09
DKK	3.720.164,09	1,76
EUR	19.321.462,59	9,17
GBP	3.911.657,88	1,86
JPY	9.562.343,78	4,55
NOK	565.284,86	0,26
SEK	776.608,12	0,36
USD	36.194.734,94	17,16
2. Anleihen	30.811.717,47	14,62
EUR	30.627.103,74	14,53
USD	184.613,73	0,09
3. Investmentanteile	79.738.758,32	37,92
EUR	32.005.476,50	15,22
USD	47.733.281,82	22,70
4. Sonstige Wertpapiere	1.475.440,65	0,70
CHF	1.475.440,65	0,70
5. Derivate	-4.024.803,08	-1,94
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	20.552.261,51	9,80
7. Sonstige Vermögensgegenstände	5.987.115,57	2,84

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Gliederung nach Anlageart - Währung

II. Verbindlichkeiten
III. Fondsvermögen

Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
-317.733,32	-0,15
210.585.557,36	100,00

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

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								105.268.791,07	49,94
Aktien								76.264.265,20	36,16
EUR								19.321.462,59	9,17
ES0125220311	Acciona S.A. Acciones Port.	STK		410	410	0	EUR 173,400	71.094,00	0,03
DE000A1EWWWO	adidas AG Namens-Aktien	STK		2.962	0	0	EUR 127,260	376.944,12	0,18
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		17.950	1.510	0	EUR 27,130	486.983,50	0,23
NL0013267909	Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder	STK		2.984	0	0	EUR 63,340	189.006,56	0,09
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		6.921	480	0	EUR 201,900	1.397.349,90	0,66
IT0004056880	Amplifon S.p.A. Azioni nom.	STK		1.538	0	0	EUR 27,910	42.925,58	0,02
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		2.700	353	250	EUR 511,200	1.380.240,00	0,66
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		32.498	2.000	0	EUR 26,300	854.697,40	0,41
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		113.031	10.000	0	EUR 5,671	640.998,80	0,30
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien	STK		1.598	0	0	EUR 107,800	172.264,40	0,08
FR0013280286	bioMerieux Actions au Porteur (P.S.)	STK		710	710	0	EUR 99,160	70.403,60	0,03
FR0006174348	Bureau Veritas SA Actions au Porteur	STK		4.736	0	0	EUR 24,840	117.642,24	0,06
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien	STK		700	700	0	EUR 118,550	82.985,00	0,04
FR001400AJ45	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom.	STK		10.584	10.584	0	EUR 26,465	280.105,56	0,13
NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam	STK		15.783	0	0	EUR 15,090	238.165,47	0,11
FR0000064578	Covivio S.A. Actions Port.	STK		815	815	0	EUR 56,350	45.925,25	0,02
IE0001827041	CRH PLC Reg.Shares	STK		13.400	1.186	0	EUR 37,310	499.954,00	0,24
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port.	STK		10.800	672	0	EUR 49,760	537.408,00	0,26
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien	STK		3.291	325	0	EUR 163,100	536.762,10	0,25
BE0974259880	D'Ieteren Group S.A. Parts Sociales au Port.	STK		420	420	0	EUR 181,200	76.104,00	0,04
ES0127797019	EDP Renováveis S.A. Acciones Port.	STK		4.627	0	0	EUR 20,820	96.334,14	0,05
BE0003822393	Elia Group Actions au Port.	STK		542	34	0	EUR 134,000	72.628,00	0,03
IE0009007884	Elisa Oyj Reg.Shares Cl.A	STK		2.275	0	0	EUR 49,790	113.272,25	0,05
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port.	STK		5.067	583	0	EUR 170,200	862.403,40	0,41
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK		2.700	5.285	2.585	EUR 37,900	102.330,00	0,05
DE0006048408	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien	STK		1.599	0	0	EUR 60,350	96.499,65	0,05
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien	STK		2.745	0	0	EUR 65,240	179.083,80	0,09
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur	STK		260	260	0	EUR 1.455,500	378.430,00	0,18
NL0010801007	IMCD N.V. Aandelen op naam	STK		1.015	1.015	0	EUR 135,350	137.380,25	0,07
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK		16.423	0	0	EUR 25,060	411.560,38	0,20
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK		287.000	27.445	0	EUR 2,091	599.973,50	0,28
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.V. Reg.Shares	STK		3.200	3.200	0	EUR 19,738	63.161,60	0,03
BE0003565737	KBC Groep N.V. Parts Sociales au Port.	STK		3.858	0	0	EUR 60,340	232.791,72	0,11
IE0004906560	Kerry Group PLC Reg.Shares A	STK		2.496	0	0	EUR 85,000	212.160,00	0,10
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B	STK		4.249	0	0	EUR 20,870	88.676,63	0,04
FR0000121964	Klépierre S.A. Actions Port.	STK		3.650	3.650	0	EUR 21,860	79.789,00	0,04
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen aan toonder	STK		2.773	34	1	EUR 115,600	320.558,80	0,15
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		4.109	160	0	EUR 337,100	1.385.143,90	0,66
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		2.022	0	0	EUR 182,050	368.105,10	0,17
FI0009013296	Neste Oyj Reg.Shs	STK		6.664	0	0	EUR 43,530	290.083,92	0,14
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder	STK		4.492	252	0	EUR 38,580	173.301,36	0,08
FI0009014377	Orion Corp. Reg.Shares Cl.B	STK		1.720	0	0	EUR 52,020	89.474,40	0,04
NL0013654783	Prosus N.V. Reg.Shares	STK		13.800	13.800	0	EUR 65,040	897.552,00	0,43
IT0004176001	Prismian S.p.A. Azioni nom.	STK		4.340	4.340	0	EUR 34,980	151.813,20	0,07
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		3.900	3.900	0	EUR 59,800	233.220,00	0,11
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien	STK		1.667	0	0	EUR 56,540	94.252,18	0,04
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		3.208	0	0	EUR 16,460	52.803,68	0,03
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK		30.048	0	0	EUR 26,050	782.750,40	0,37
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port.	STK		9.252	800	0	EUR 132,560	1.226.445,12	0,58
IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom.	STK		32.073	0	0	EUR 4,603	147.632,02	0,07
FI0009005961	Stora Enso Oyj Reg.Shares Cl.R	STK		9.100	9.100	0	EUR 13,295	120.984,50	0,06
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien	STK		16.674	0	0	EUR 2,316	38.616,98	0,02
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom.	STK		22.369	0	0	EUR 7,026	157.164,59	0,07
BE0974320526	Umicore S.A. Actions Nom.	STK		3.045	0	0	EUR 34,550	105.204,75	0,05
FR0013176526	Valéo S.E. Actions Port.	STK		3.294	0	0	EUR 16,705	55.026,27	0,03
AT0000746409	Verbund AG Inhaber-Aktien	STK		1.177	0	0	EUR 79,300	93.336,10	0,04
FR0000127771	Vivendi SE Actions Porteur	STK		11.223	0	0	EUR 9,000	101.007,00	0,05
FI0009003727	Wärtsilä Corp. Reg.Shares	STK		8.178	0	0	EUR 7,922	64.786,12	0,03
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		4.176	0	0	EUR 98,900	413.006,40	0,20
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien	STK		4.000	4.000	0	EUR 33,690	134.760,00	0,06
CHF								2.310.543,98	1,09
CH0010645932	Givaudan SA Namens-Aktien	STK		161	16	0	CHF 2.856,000	466.191,16	0,22
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG Namens-Aktien	STK		846	0	0	CHF 218,500	187.413,88	0,09
CH0013841017	Lonza Group AG Namens-Aktien	STK		1.291	130	0	CHF 457,300	598.559,60	0,28

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CH0002497458	SGS S.A. Namens-Aktien		STK	95	0	0	CHF 2.166,000	208.622,92	0,10
CH0012549785	Sonova Holding AG Namens-Aktien		STK	840	0	0	CHF 221,100	188.298,99	0,09
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien		STK	495	0	0	CHF 480,200	240.994,60	0,11
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien		STK	4.745	0	0	CHF 87,400	420.462,83	0,20
DKK								3.720.164,09	1,76
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B		STK	147	147	0	DKK 16.020,000	316.666,78	0,15
DK0060448595	Coloplast AS Navne-Aktier B		STK	1.873	0	0	DKK 819,400	206.374,67	0,10
DK0060738599	Demant AS Navne Aktier A		STK	1.650	1.650	0	DKK 193,950	43.032,48	0,02
DK0010272202	GENMAB AS Navne-Aktier		STK	1.159	120	0	DKK 2.947,000	459.289,20	0,22
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B		STK	14.000	0	5.209	DKK 943,900	1.776.956,02	0,84
DK0060336014	Novozymes A/S Navne-Aktier B		STK	3.163	0	0	DKK 350,900	149.246,87	0,07
DK0060094928	Orsted A/S Indehaver Aktier		STK	3.009	0	0	DKK 634,200	256.608,53	0,12
DK0060252690	Pandora A/S Navne-Aktier		STK	1.568	0	0	DKK 494,000	104.158,73	0,05
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier		STK	14.900	1.563	2.400	DKK 203,550	407.830,81	0,19
GBP								3.911.657,88	1,86
GB00BF8Q6K64	Abrdn PLC Reg.Shares		STK	28.989	0	0	GBP 1,894	62.011,44	0,03
GB0006731235	Associated British Foods PLC Reg.Shares		STK	4.331	0	0	GBP 15,810	77.355,89	0,04
GB0000811801	Barratt Developments PLC Reg.Shares		STK	15.842	0	0	GBP 4,000	71.588,51	0,03
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares		STK	1.808	0	0	GBP 38,000	77.616,73	0,04
GB0030913577	BT Group PLC Reg.Shares		STK	133.700	0	0	GBP 1,136	171.510,95	0,08
GB00B0744B38	Bunzl PLC Reg.Shares		STK	5.935	5.935	0	GBP 27,520	184.519,58	0,09
GB0031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares		STK	6.270	0	0	GBP 20,300	143.792,72	0,07
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien		STK	2.743	0	0	GBP 19,590	60.706,27	0,03
GB00BJFFLV09	Croda International PLC Reg.Shares		STK	2.188	0	0	GBP 66,700	164.871,83	0,08
IE0002424939	DCC PLC Reg.Shares		STK	1.267	0	0	GBP 41,340	59.172,57	0,03
GB00BMJ6DW54	Informa PLC Reg.Shares		STK	23.064	0	0	GBP 6,216	161.964,17	0,08
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group Reg.Shares		STK	2.800	0	0	GBP 47,540	150.380,15	0,07
GB0031638363	Intertek Group PLC Reg.Shares		STK	2.700	2.700	0	GBP 40,600	123.840,62	0,06
GB00B019KW72	J. Sainsbury PLC Reg.Shs		STK	29.498	0	0	GBP 2,197	73.214,31	0,03
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC Reg.Shares		STK	2.637	0	0	GBP 21,210	63.186,47	0,03
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg.Shares		STK	32.691	0	0	GBP 2,372	87.602,44	0,04
GB0005603997	Legal & General Group PLC Reg.Shares		STK	100.000	100.000	0	GBP 2,507	283.222,43	0,13
GB00B1CRLC47	Mondi PLC Reg.Shares		STK	7.692	0	0	GBP 14,165	123.091,81	0,06
GB0006776081	Pearson PLC Reg.Shares		STK	11.600	11.600	0	GBP 9,404	123.237,80	0,06
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares		STK	12.100	12.100	0	GBP 57,580	787.100,78	0,37
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares		STK	2.650	2.650	0	GBP 23,070	69.066,39	0,03
GB00BP9LHF23	Schroders PLC Reg.Shares		STK	13.129	13.129	0	GBP 4,418	65.528,57	0,03
GB00B5ZN1N88	Segro PLC Reg.Shares		STK	18.662	0	0	GBP 7,710	162.549,59	0,08
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC Reg.Shares		STK	4.035	0	0	GBP 26,810	122.211,95	0,06
GB0007669376	St. James's Place PLC Reg.Shares		STK	8.361	0	0	GBP 11,045	104.327,13	0,05
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC Reg.Shares		STK	60.000	60.000	58.979	GBP 1,016	68.834,24	0,03
GB0001367019	The British Land Co. PLC Reg.Shares		STK	10.878	0	0	GBP 3,978	48.886,29	0,02
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC Reg.Shares		STK	10.923	0	0	GBP 10,025	123.708,53	0,06
GB00B1KJ408	Whitbread PLC Reg.Shares		STK	3.300	3.300	3.224	GBP 25,900	96.557,72	0,05
JPY								9.562.343,78	4,55
JP3388200002	Aeon Co. Ltd. Reg.Shares		STK	9.100	1.900	0	JPY 2.783,000	180.091,02	0,09
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc. Reg.Shares		STK	6.900	1.500	0	JPY 4.031,000	197.787,73	0,09
JP3111200006	Asahi Kasei Corp. Reg.Shares		STK	20.000	5.800	0	JPY 941,400	133.888,00	0,06
JP3937200008	Azbil Corp. Reg.Shares		STK	1.700	0	0	JPY 3.325,000	40.195,56	0,02
JP3497400006	Daifuku Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.300	1.300	0	JPY 6.180,000	57.130,67	0,03
JP3476480003	Dai-ichi Life Holdings Inc. Reg.Shares		STK	13.400	2.200	0	JPY 2.994,000	285.294,93	0,14
JP3475350009	Daiichi Sankyo Co. Ltd. Reg.Shares		STK	17.000	17.000	0	JPY 4.250,000	513.777,78	0,24
JP3481800005	Daikin Industries Ltd. Reg.Shares		STK	2.600	700	0	JPY 20.200,000	373.475,56	0,18
JP3802400006	Fanuc Corp. Reg.Shares		STK	2.900	2.900	0	JPY 19.835,000	409.041,78	0,19
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Reg.Shares		STK	3.100	900	0	JPY 17.615,000	388.312,89	0,18
JP3774200004	Hankyu Hanshin Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.700	0	0	JPY 3.920,000	75.264,00	0,04
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.000	0	0	JPY 2.959,000	21.041,78	0,01
JP3360800001	Hulic Co. Ltd. Reg.Shares		STK	4.900	4.900	0	JPY 1.040,000	36.238,22	0,02
JP3148800000	Ibiden Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.400	0	0	JPY 4.785,000	47.637,33	0,02
JP3027680002	Japan Real Estate Inv. Corp. Reg.Shares		STK	16	16	0	JPY 577.000,000	65.649,78	0,03
JP3205800000	Kao Corp. Reg.Shares		STK	7.500	2.200	0	JPY 5.255,000	280.266,67	0,13
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares		STK	16.100	3.900	3.500	JPY 3.982,000	455.894,76	0,22
JP3240400006	Kikkoman Corp. Reg.Shares		STK	2.400	700	0	JPY 6.940,000	118.442,67	0,06
JP3304200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares		STK	14.800	5.000	0	JPY 2.876,000	302.683,02	0,14
JP3266400005	Kubota Corp. Reg.Shares		STK	16.000	16.000	0	JPY 1.817,000	206.734,22	0,10
JP3270000007	Kurita Water Industries Ltd. Reg.Shares		STK	1.800	1.100	0	JPY 5.460,000	69.888,00	0,03
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Group Corp Reg.Shares		STK	16.700	16.700	0	JPY 684,700	81.311,93	0,04
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co. Ltd. Reg.Shares		STK	15.500	1.800	0	JPY 1.711,000	188.590,22	0,09
JP3890310000	MS&AD Insurance Grp Hldgs Inc. Reg.Shares		STK	6.900	1.800	0	JPY 4.224,000	207.257,60	0,10
JP3688370000	Nippon Express Holdings Inc. Reg.Shares		STK	1.000	1.000	0	JPY 7.540,000	53.617,78	0,03
JP3047550003	Nippon Prologis REIT Inc. Reg.Shares		STK	28	28	0	JPY 308.500,000	61.425,78	0,03
JP3684000007	Nitto Denko Corp. Reg.Shares		STK	2.000	500	0	JPY 7.650,000	108.800,00	0,05
JP3762800005	Nomura Research Institute Ltd. Reg.Shares		STK	5.500	1.600	0	JPY 3.115,000	121.831,11	0,06
JP3197800000	Omron Corp. Reg.Shares		STK	2.800	800	0	JPY 6.405,000	127.530,67	0,06
JP3866800000	Panasonic Holdings Corp. Reg.Shares		STK	34.700	9.100	0	JPY 1.110,500	274.022,04	0,13

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
JP3970300004	Recruit Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK		13.900	13.900	0	JPY 4.177,000	412.873,24	0,20
JP3500610005	Resona Holdings Inc. Reg.Shares	STK		31.500	8.500	0	JPY 723,200	161.996,80	0,08
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares	STK		8.500	1.800	0	JPY 2.333,500	141.047,11	0,07
JP3162770006	SG Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK		3.700	0	0	JPY 1.830,000	48.149,33	0,02
JP3732000009	SoftBank Corp. Reg.Shares	STK		45.800	11.400	0	JPY 1.488,000	484.625,07	0,23
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares	STK		4.200	700	0	JPY 5.860,000	175.018,67	0,08
JP3435000009	Sony Group Corp. Reg.Shares	STK		6.000	2.100	0	JPY 10.035,000	428.160,00	0,20
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK		17.700	0	0	JPY 474,000	59.660,80	0,03
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group Reg.Shares	STK		16.000	4.000	1.600	JPY 5.296,000	602.567,11	0,29
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Hldg.Inc Reg.Shares	STK		4.700	1.000	0	JPY 4.588,000	153.341,16	0,07
JP3409000001	Sumitomo Realty & Dev. Co.Ltd. Reg.Shares	STK		3.500	3.500	0	JPY 3.121,000	77.678,22	0,04
JP3336560002	Suntory Beverage & Food Ltd. Reg.Shares	STK		2.000	0	0	JPY 4.500,000	64.000,00	0,03
JP3351100007	Sysmex Corp. Reg.Shares	STK		2.500	600	0	JPY 7.998,000	142.186,67	0,07
JP3546800008	Terumo Corp. Reg.Shares	STK		10.400	10.400	0	JPY 3.746,000	277.037,51	0,13
JP3571400005	Tokyo Electron Ltd. Reg.Shares	STK		1.450	600	0	JPY 38.880,000	400.896,00	0,19
JP3574200006	Tokyu Corp. Reg.Shares	STK		6.000	0	0	JPY 1.663,000	70.954,67	0,03
JP3621000003	Toray Industries Inc. Reg.Shares	STK		22.000	6.600	0	JPY 736,600	115.236,98	0,05
JP3596200000	Toto Ltd. Reg.Shares	STK		1.800	0	0	JPY 4.500,000	57.600,00	0,03
JP3942600002	Yamaha Corp. Reg.Shares	STK		1.600	0	0	JPY 4.920,000	55.978,67	0,03
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK		3.400	0	0	JPY 3.010,000	72.775,11	0,03
JP3933800009	Z Holdings Corp. Reg.Shares	STK		32.800	0	0	JPY 332,000	77.437,16	0,04
NOK								565.284,86	0,26
NO0010161896	DNB Bank ASA Navne-Aksjer	STK		14.307	0	0	NOK 194,900	264.992,28	0,13
NO0003054108	Mowi ASA Navne-Aksjer	STK		6.961	0	0	NOK 168,600	111.532,65	0,05
NO0003733800	Orkla ASA Navne-Aksjer	STK		13.977	0	0	NOK 71,160	94.519,78	0,04
NO0010063308	Telenor ASA Navne-Aksjer	STK		10.793	0	0	NOK 91,880	94.240,15	0,04
SEK								776.608,12	0,36
SE0017768716	Boliden AB Namn-Aktier	STK		4.402	4.402	0	SEK 399,000	157.769,27	0,07
SE0016589188	Electrolux, AB Namn-Aktier B	STK		4.101	0	0	SEK 143,220	52.758,56	0,03
SE0009922164	Essity AB Namn-Aktier B	STK		9.485	0	0	SEK 276,700	235.746,90	0,11
SE0001662230	Husqvarna AB Namn-Aktier B	STK		7.602	0	0	SEK 74,340	50.763,31	0,02
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB Namn-Aktier B (fria)	STK		9.295	0	0	SEK 134,600	112.381,27	0,05
SE0005190238	Tele2 AB Namn-Aktier B	STK		8.835	0	0	SEK 85,840	68.123,31	0,03
SE0000667925	Telia Company AB Namn-Aktier	STK		41.014	0	0	SEK 26,890	99.065,50	0,05
USD								36.096.199,90	17,11
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares	STK		2.776	2.776	0	USD 337,580	878.071,75	0,42
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK		1.610	254	0	USD 151,090	227.926,82	0,11
IE00BFT3W74	Allegion PLC Reg.Shares	STK		703	380	0	USD 106,740	70.309,88	0,03
US02005N1000	Ally Financial Inc. Reg.Shares	STK		1.139	0	0	USD 24,360	25.997,70	0,01
US0258161092	American Express Co. Reg.Shares	STK		3.736	1.438	518	USD 147,320	515.706,27	0,24
US03027X1000	American Tower Corp. Reg.Shares	STK		2.775	1.077	284	USD 215,740	560.954,32	0,27
US0304201033	American Water Works Co. Inc. Reg.Shares	STK		1.030	1.030	0	USD 154,780	149.377,75	0,07
US03076C1062	Ameriprise Financial Inc. Reg.Shares	STK		621	120	0	USD 312,310	181.723,60	0,09
US03073E1055	AmerisourceBergen Corp. Reg.Shares	STK		847	352	0	USD 166,050	131.782,01	0,06
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK		3.048	1.056	451	USD 263,160	751.568,69	0,36
JE00B783TY65	Aptiv PLC Reg.Shares	STK		1.931	750	0	USD 93,810	169.732,59	0,08
US0495601058	Atmos Energy Corp. Reg.Shares	STK		832	450	0	USD 114,490	89.253,39	0,04
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares	STK		2.428	520	0	USD 240,620	547.411,91	0,26
US0584981064	Ball Corp. Reg.Shares	STK		1.896	400	0	USD 51,620	91.704,40	0,04
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares	STK		1.529	275	0	USD 256,900	368.048,82	0,17
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares	STK		1.035	0	0	USD 81,240	78.785,10	0,04
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares	STK		862	160	0	USD 276,000	222.920,59	0,11
US09247X1019	Blackrock Inc. Reg.Shares	STK		881	196	0	USD 716,150	591.171,84	0,28
BMG169621056	Bunge Ltd. Reg.Shares	STK		965	775	0	USD 99,790	90.229,42	0,04
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)	STK		1.017	440	0	USD 92,250	87.906,54	0,04
US14149Y1082	Cardinal Health Inc. Reg.Shares	STK		1.770	550	0	USD 77,720	128.896,13	0,06
US14448C1045	Carrier Global Corp. Reg.Shares	STK		4.939	4.939	0	USD 41,850	193.672,66	0,09
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares	STK		3.105	730	0	USD 240,200	698.825,02	0,33
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		1.836	400	0	USD 77,550	133.409,98	0,06
US15135B1017	Centene Corp. Reg.Shares	STK		3.131	535	0	USD 81,720	239.742,63	0,11
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares	STK		2.293	376	0	USD 222,080	477.141,66	0,23
US1255231003	Cigna Corp. Reg.Shares	STK		1.745	306	0	USD 330,720	540.741,53	0,26
US12572Q1058	CME Group Inc. Reg.Shares	STK		1.917	348	0	USD 169,160	303.846,07	0,14
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC Reg.Shares	STK		3.114	0	0	USD 55,410	161.674,15	0,08
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares	STK		4.305	760	0	USD 79,370	320.157,27	0,15
US2058871029	ConAgra Brands Inc. Reg.Shares	STK		3.319	3.319	0	USD 38,770	120.569,34	0,06
US2091151041	Consolidated Edison Inc. Reg.Shares	STK		2.000	2.000	0	USD 96,490	180.819,86	0,09
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares	STK		808	180	0	USD 241,730	183.010,39	0,09
US23918K1088	DaVita Inc. Reg.Shares	STK		113	0	0	USD 75,210	7.963,20	0,00
US24906P1093	Dentsply Sirona Inc. Reg.Shares	STK		988	0	0	USD 32,280	29.883,01	0,01
US2600031080	Dover Corp. Reg.Shares	STK		970	970	0	USD 136,340	123.916,42	0,06
US2788651006	Ecolab Inc. Reg.Shares	STK		1.375	244	0	USD 147,710	190.303,35	0,09
US28176E1082	Edwards Lifesciences Corp. Reg.Shares	STK		3.860	1.231	0	USD 75,210	272.017,43	0,13
US28414H1032	Elanco Animal Health Inc. Reg.Shares	STK		3.300	3.300	0	USD 12,120	37.475,76	0,02

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US2855121099	Electronic Arts Inc. Reg.Shares	STK		1.585	300	0	USD 122,190	181.467,46	0,09
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares	STK		1.390	1.390	0	USD 512,880	667.981,45	0,32
US29444U7000	Equinix Inc. Reg.Shares	STK		487	76	0	USD 665,370	303.616,95	0,14
US29670G1022	Essential Utilities Inc. Reg.Shares	STK		1.200	1.200	0	USD 48,420	54.442,73	0,03
US30040W1080	Eversource Energy Reg.Shares	STK		1.885	400	0	USD 85,080	150.270,13	0,07
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares	STK		1.220	380	0	USD 105,210	120.268,17	0,06
US3030751057	FactSet Research Systems Inc. Reg.Shares	STK		240	90	0	USD 406,500	91.412,51	0,04
US3119001044	Fastenal Co. Reg.Shares	STK		3.072	600	0	USD 47,560	136.897,93	0,07
US34964C1062	Fortune Brands Innovations Inc Reg.Shares	STK		523	0	0	USD 57,610	28.231,46	0,01
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares	STK		3.246	581	0	USD 84,380	256.638,54	0,12
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares	STK		6.771	1.080	0	USD 85,260	540.918,68	0,26
US4180561072	Hasbro Inc. Reg.Shares	STK		515	0	0	USD 60,990	29.430,64	0,01
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares	STK		1.326	217	0	USD 240,380	298.659,06	0,14
US42250P1030	Healthpeak Properties Inc. Reg.Shares	STK		4.106	4.106	0	USD 96,951,23	96.951,23	0,05
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares	STK		787	600	0	USD 80,610	59.442,56	0,03
US43300A2033	Hilton Worldwide Holdings Inc. Reg.Shares	STK		1.476	273	0	USD 126,040	174.312,52	0,08
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares	STK		1.389	0	0	USD 76,100	99.042,30	0,05
US4404521001	Hormel Foods Corp. Reg.Shares	STK		1.720	920	0	USD 45,510	73.344,76	0,03
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares	STK		693	125	0	USD 513,200	333.237,39	0,16
US4456581077	Hunt (J.B.) Transport Svcs Inc.Reg.Shares	STK		631	631	0	USD 176,770	104.513,35	0,05
US4461501045	Huntington Bancshares Inc. Reg.Shares	STK		8.991	2.500	0	USD 14,140	119.121,80	0,06
US45167R1041	IDEX Corp. Reg.Shares	STK		443	190	0	USD 230,500	95.677,21	0,05
US45168D1046	IDEXX Laboratories Inc. Reg.Shares	STK		453	66	0	USD 410,380	174.188,00	0,08
US4523081093	Illinois Tool Works Inc. Reg.Shares	STK		1.857	461	0	USD 221,970	386.224,68	0,18
US4523271090	Illumina Inc. Reg.Shares	STK		793	132	0	USD 201,640	149.824,80	0,07
US45687V1061	Ingersoll-Rand Inc. Reg.Shares	STK		2.678	2.678	0	USD 52,790	132.463,45	0,06
US45784P1012	Insulet Corporation Reg.Shares	STK		416	0	0	USD 295,040	115.002,71	0,05
US4601461035	International Paper Co. Reg.Shares	STK		2.115	700	0	USD 34,770	68.904,71	0,03
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares	STK		2.464	1.300	0	USD 33,580	77.527,40	0,04
US4595061015	Intl Flavors & Fragrances Inc. Reg.Shares	STK		1.372	260	0	USD 105,120	135.136,70	0,06
BMG491BT1088	Invesco Ltd. Reg.Shares	STK		2.200	2.200	0	USD 18,300	37.723,12	0,02
IE00B4Q5ZN47	Jazz Pharmaceuticals PLC Reg.Shares	STK		363	320	0	USD 158,150	53.791,00	0,03
IE00BY7QL619	Johnson Controls Internat. PLC Reg.Shares	STK		3.682	601	0	USD 146,460	222.386,25	0,11
US4878361082	Kellogg Co. Reg.Shares	STK		1.532	500	0	USD 71,470	102.592,68	0,05
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc. Reg.Shares	STK		4.550	4.550	0	USD 35,830	152.753,81	0,07
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares	STK		1.806	336	0	USD 137,240	232.237,47	0,11
US4990491049	Knight-Swift Transp. Hldgs Inc Reg.Shs Cl.A	STK		900	900	0	USD 52,520	44.289,53	0,02
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares	STK		612	612	0	USD 235,490	135.038,54	0,06
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares	STK		190	190	0	USD 242,070	43.095,15	0,02
GB00B8W67B19	Liberty Global PLC Reg.Shares C	STK		4.200	2.100	0	USD 19,560	76.975,40	0,04
US5018892084	LKQ Corp. Reg.Shares	STK		1.659	800	0	USD 53,980	83.909,88	0,04
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares	STK		3.686	1.545	883	USD 202,260	698.552,69	0,33
US57060D1081	MarketAxess Holdings Inc. Reg.Shares	STK		210	210	0	USD 283,330	55.750,11	0,03
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares	STK		2.951	744	0	USD 166,780	461.155,10	0,22
US57638P1049	MasterBrand Inc. Reg.Shares	STK		523	523	0	USD 7,580	3.714,54	0,00
US5797802064	McCormick & Co. Inc. Reg.Shares (non voting)	STK		1.659	1.659	0	USD 84,140	130.792,47	0,06
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK		127	25	0	USD 1.467,110	174.582,31	0,08
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK		7.770	3.283	0	USD 241,010	1.754.647,65	0,83
US6153691059	Moody's Corp. Reg.Shares	STK		895	141	0	USD 282,930	237.266,20	0,11
US6658591044	Northern Trust Corp. Reg.Shares	STK		1.054	419	0	USD 89,480	88.369,10	0,04
JE00BYS54X48	Novocure Ltd. Reg.Shares	STK		570	570	0	USD 71,480	38.176,25	0,02
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares	STK		11.313	6.313	0	USD 146,030	1.547.938,52	0,74
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc. Reg.Shares	STK		607	607	0	USD 286,580	162.992,79	0,08
US68902V1070	Otis Worldwide Corp. Reg.Shares	STK		2.525	2.525	0	USD 79,070	187.071,21	0,09
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares	STK		630	0	0	USD 87,000	51.356,29	0,02
IE00BL509M33	Pentair PLC Reg.Shares	STK		495	0	0	USD 45,250	20.987,35	0,01
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares	STK		7.871	2.585	604	USD 181,980	1.342.107,83	0,64
US72919P2020	Plug Power Inc. Reg.Shares	STK		2.305	2.305	0	USD 12,230	26.413,82	0,01
US6934751057	PNC Financial Services Group Reg.Shares	STK		2.567	674	0	USD 157,830	379.620,15	0,18
US73278L1052	Pool Corp. Reg.Shares	STK		295	130	0	USD 306,920	84.836,17	0,04
US6935061076	PPG Industries Inc. Reg.Shares	STK		1.275	263	0	USD 126,400	151.004,92	0,07
US7443201022	Prudential Financial Inc. Reg.Shares	STK		1.994	282	0	USD 99,880	186.611,12	0,09
US74762E1029	Quanta Services Inc. Reg.Shares	STK		933	933	0	USD 142,700	124.749,68	0,06
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares	STK		715	250	0	USD 156,790	105.040,85	0,05
US7591EP1005	Regions Financial Corp. Reg.Shares	STK		5.353	1.600	0	USD 21,620	108.439,32	0,05
US7607591002	Republic Services Inc. Reg.Shares	STK		1.349	1.349	0	USD 130,750	165.267,51	0,08
US7611521078	ResMed Inc. Reg.Shares	STK		775	136	0	USD 209,370	152.037,25	0,07
US76954A1034	Rivian Automotive Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		2.800	2.800	0	USD 18,730	49.139,38	0,02
US7703231032	Robert Half International Inc. Reg.Shares	STK		352	0	0	USD 73,870	24.363,78	0,01
US7739031091	Rockwell Automation Inc. Reg.Shares	STK		636	125	0	USD 259,630	154.719,78	0,07
US7757111049	Rollins Inc. Reg.Shares	STK		1.350	1.350	0	USD 36,660	46.372,45	0,02
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares	STK		1.963	1.964	1	USD 339,810	625.014,79	0,30

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US8318652091	Smith Corp., A.O. Reg.Shares	STK		800	800	0	USD 57,660	43.221,36	0,02
US8581191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares	STK		1.005	380	0	USD 98,410	92.669,99	0,04
IE00BFY8C754	Steris PLC Reg.Shares	STK		585	130	0	USD 186,200	102.063,25	0,05
US78486Q1013	SVB Financial Group Reg.Shares	STK		327	66	0	USD 234,630	71.889,44	0,03
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares	STK		1.340	320	0	USD 111,330	139.781,87	0,07
US89417E1091	Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares	STK		1.020	500	0	USD 101,340	96.853,41	0,05
US87612E1064	Target Corp. Reg.Shares	STK		2.870	2.870	0	USD 148,370	398.989,83	0,19
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares	STK		8.850	7.364	0	USD 121,820	1.010.172,87	0,48
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK		5.304	1.776	453	USD 165,020	820.113,45	0,39
US0640581007	The Bk of New York MellonCorp. Reg.Shares	STK		4.368	700	0	USD 45,660	186.875,50	0,09
US1890541097	The Clorox Co. Reg.Shares	STK		666	254	0	USD 142,420	88.874,88	0,04
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares	STK		23.407	7.687	1.685	USD 63,950	1.402.555,77	0,67
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK		5.847	2.138	0	USD 320,410	1.755.387,46	0,83
US89417E1091	The Travelers Companies Inc. Reg.Shares	STK		1.307	210	0	USD 189,440	231.996,33	0,11
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares	STK		10.933	4.287	1.325	USD 87,180	893.079,35	0,42
US8923561067	Tractor Supply Co. Reg.Shares	STK		684	130	0	USD 226,980	145.471,37	0,07
IE00BK9ZQ967	Trane Technologies PLC Reg.Shares	STK		1.239	220	0	USD 170,430	197.856,89	0,09
US89832Q1094	Truist Financial Corp. Reg.Shares	STK		8.483	2.461	0	USD 43,200	343.373,72	0,16
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares	STK		456	456	0	USD 356,210	152.196,54	0,07
US9182041080	V.F. Corp. Reg.Shares	STK		2.027	600	0	USD 27,440	52.116,07	0,02
US91879Q1094	Vail Resorts Inc. Reg.Shares	STK		183	0	0	USD 237,940	40.799,27	0,02
US91913Y1001	Valero Energy Corp. Reg.Shares	STK		2.592	816	0	USD 126,320	306.789,82	0,15
US92276F1003	Ventas Inc. Reg.Shares	STK		2.755	2.755	0	USD 45,560	117.608,62	0,06
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK		1.366	284	0	USD 289,080	370.000,73	0,18
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares	STK		230	65	0	USD 562,220	121.162,43	0,06
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares	STK		421	110	0	USD 345,880	136.439,90	0,06
US95040Q1040	Welltower Inc. Reg.Shares	STK		2.870	2.870	0	USD 65,830	177.027,03	0,08
US9553061055	West Pharmaceutic.Services Inc Reg.Shares	STK		400	52	0	USD 238,980	89.568,52	0,04
US96145D1054	WRKCo Inc. Reg.Shares	STK		1.237	1.237	0	USD 35,290	40.903,00	0,02
US98419M1009	Xylem Inc. Reg.Shares	STK		1.312	0	0	USD 111,640	137.242,15	0,07
US98978V1035	Zoetis Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		2.537	411	0	USD 148,150	352.172,92	0,17
US98980F1049	Zoominfo Technologies Inc. Reg.Shares	STK		965	0	0	USD 30,150	27.261,42	0,01
Verzinsliche Wertpapiere								27.529.085,22	13,08
EUR								27.344.471,49	12,99
ES0200002071	3,5000 % Adif - Alta Velocidad MTN 22/29	EUR		200.000	200.000	0	% 98,304	196.608,00	0,09
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 20/30	EUR		300.000	0	0	% 91,863	275.589,00	0,13
XS2531420730	2,6250 % Alliander N.V. MTN 22/27	EUR		200.000	200.000	0	% 96,211	192.421,00	0,09
XS2545206166	4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 22/29	EUR		500.000	1.000.000	500.000	% 101,371	506.852,50	0,24
XS2357417257	0,6250 % Banco Santander S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/29	EUR		400.000	400.000	0	% 82,237	328.948,00	0,16
FR0013465358	0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 19/26	EUR		300.000	300.000	0	% 91,800	275.398,50	0,13
FR0014006N17	0,5000 % BNP Paribas S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/28	EUR		400.000	400.000	0	% 84,542	338.168,00	0,16
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27 ¹⁾	EUR		32.000	0	0	% 91,381	29.241,92	0,01
DE0001102481	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 19/50	EUR		30.000	0	0	% 52,090	15.627,00	0,01
DE0001030708	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30 ¹⁾	EUR		200.000	115.000	0	% 83,172	166.344,00	0,08
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24	EUR		20.000	0	0	% 95,501	19.100,10	0,01
FR0014004EF7	0,7500 % C.N.d.Reas.Mut.Agrico.Group.SA Notes 21/28	EUR		700.000	0	0	% 80,904	566.328,00	0,27
FR001400D0F9	4,1250 % Carrefour S.A. MTN 22/28	EUR		400.000	400.000	0	% 100,600	402.400,00	0,19
XS2533012790	2,7500 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 22/25	EUR		500.000	500.000	0	% 97,410	487.050,00	0,23
XS2381671671	0,2500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 21/28	EUR		400.000	0	475.000	% 72,399	289.596,00	0,14
XS2443438051	1,3750 % Danske Bank AS FLR Non-Pref. MTN 22/27	EUR		500.000	500.000	0	% 91,048	455.240,00	0,22
XS2534985523	3,1250 % DNB Bank ASA FLR Preferred MTN 22/27	EUR		200.000	200.000	0	% 97,918	195.835,00	0,09
XS2103014291	0,3750 % E.ON SE MTN 20/27	EUR		300.000	0	0	% 87,503	262.507,50	0,12
XS2327420977	0,6000 % E.ON SE MTN 21/32	EUR		400.000	0	0	% 73,516	294.064,00	0,14
XS2542914986	3,8750 % EDP Finance B.V. MTN 22/30	EUR		400.000	400.000	0	% 98,782	395.128,00	0,19
XS1937665955	1,5000 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 19/25	EUR		500.000	500.000	0	% 95,474	477.370,00	0,23
XS2390400716	0,3750 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 21/29	EUR		500.000	0	0	% 79,611	398.052,50	0,19
XS2432544349	1,0000 % ESB Finance DAC MTN 22/34	EUR		150.000	150.000	0	% 72,647	108.969,75	0,05
XS2532681074	3,7500 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA MTN 22/27	EUR		775.000	775.000	0	% 96,318	746.464,50	0,35

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
BE0002889716	3,2500 % Flaemische Gemeinschaft MTN 22/43		EUR	500.000	500.000	0	% 93,585	467.925,00	0,22
GR0124037715	0,7500 % Griechenland Notes 21/31		EUR	1.200.000	0	0	% 74,359	892.308,00	0,42
XS2530219349	2,6250 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 22/27		EUR	400.000	400.000	0	% 97,168	388.672,00	0,18
FR0013444304	0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. MTN 19/27		EUR	200.000	0	0	% 85,480	170.959,00	0,08
XS2317069685	0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Preferred MTN 21/28		EUR	500.000	500.000	0	% 83,198	415.990,00	0,20
XS2534891978	3,2500 % Knorr-Bremse AG MTN 22/27		EUR	500.000	500.000	0	% 98,066	490.330,00	0,23
ES0000012J07	1,0000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/42		EUR	300.000	300.000	0	% 61,130	183.390,00	0,09
ES0000012K20	0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32		EUR	3.800.000	3.800.000	0	% 77,881	2.959.478,00	1,41
ES0000012I08	0,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 21/28		EUR	200.000	0	0	% 85,384	170.768,00	0,08
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25		EUR	140.000	0	0	% 95,624	133.873,60	0,06
BE0000341504	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.81 17/27		EUR	100.000	0	0	% 91,722	91.722,00	0,04
BE0000346552	1,2500 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.86 18/33		EUR	250.000	210.000	0	% 83,733	209.332,50	0,10
NL0013552060	0,5000 % Königreich Niederlande Anl. 19/40		EUR	40.000	0	0	% 68,865	27.545,80	0,01
ES0000012B62	0,3500 % Königreich Spanien Bonos 18/23		EUR	85.000	0	0	% 98,871	84.040,35	0,04
ES00000127G9	2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25 ¹⁾		EUR	140.000	0	0	% 98,092	137.328,80	0,07
ES0000012G26	0,8000 % Königreich Spanien Obligaciones 20/27		EUR	200.000	0	0	% 90,295	180.589,00	0,09
FR00140044X1	0,7500 % La Banque Postale Non-Pref. MTN 21/31		EUR	200.000	0	0	% 74,735	149.470,00	0,07
FR001400CN47	2,6250 % La Poste MTN 22/28		EUR	500.000	500.000	0	% 92,299	461.492,50	0,22
XS2148623106	3,5000 % Lloyds Banking Group PLC FLR MTN 20/26		EUR	500.000	0	0	% 98,447	492.232,50	0,23
XS2238789460	0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA Notes 20/28		EUR	800.000	0	0	% 83,515	668.116,00	0,32
DE000A289RN6	2,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. MTN 20/25		EUR	250.000	0	0	% 98,761	246.902,50	0,12
XS2443893255	1,1250 % Nordea Bank Abp Non Preferred MTN 22/27		EUR	400.000	400.000	0	% 90,626	362.502,00	0,17
XS2171253912	0,5000 % OP Yrityspankki Oyj Preferred MTN 20/25		EUR	400.000	0	0	% 92,365	369.460,00	0,18
XS2346125573	1,1250 % Polski Koncern Naftowy Orlen MTN 21/28		EUR	100.000	0	0	% 80,679	80.679,00	0,04
XS2047619064	0,6250 % PostNL N.V. Notes 19/26		EUR	500.000	500.000	0	% 88,958	444.790,00	0,21
IE00BDHDPH44	0,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 18/28		EUR	36.000	0	0	% 90,589	32.611,86	0,02
IE00BKFVC899	0,2000 % Republik Irland Treasury Bonds 20/30		EUR	75.000	0	0	% 80,914	60.685,13	0,03
IE00BKFVC345	0,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 20/35		EUR	70.000	0	0	% 72,245	50.571,50	0,02
XS2420426038	0,2500 % Republik Lettland MTN 21/30 ¹⁾		EUR	175.000	0	0	% 78,483	137.345,25	0,07
AT0000A269M8	0,5000 % Republik Österreich MTN 19/29		EUR	55.000	0	0	% 86,218	47.419,90	0,02
AT0000A2EJ08	0,7500 % Republik Österreich MTN 20/51		EUR	150.000	0	0	% 57,118	85.676,25	0,04
PTOTEQOE0015	5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24		EUR	1.567.000	1.500.000	0	% 103,156	1.616.454,52	0,77
PTOTEXOEO024	1,9500 % Republik Portugal Obr. 19/29		EUR	21.000	0	0	% 93,330	19.599,30	0,01
PTOTEMOEO035	0,7000 % Republik Portugal Obr. 20/27		EUR	63.000	0	0	% 90,232	56.846,16	0,03
PTOTENOE0034	0,9000 % Republik Portugal Obr. 20/35		EUR	90.000	0	0	% 72,369	65.132,10	0,03
PTOTECOEO037	1,0000 % Republik Portugal Obr. 21/52		EUR	300.000	0	0	% 49,793	149.379,00	0,07
SI0002103842	1,1875 % Republik Slowenien Bonds 19/29		EUR	70.000	0	0	% 87,765	61.435,50	0,03
SI0002103974	0,2000 % Republik Slowenien Bonds 20/23		EUR	140.000	0	0	% 99,807	139.729,80	0,07
SI0002103990	0,8750 % Republik Slowenien Bonds 20/30		EUR	220.000	0	0	% 81,358	178.987,60	0,08
SI0002104196	0,1250 % Republik Slowenien Bonds 21/31		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 73,714	737.140,00	0,35
XS2297209293	0,0000 % Republik Zypern MTN 21/26 ¹⁾		EUR	120.000	0	0	% 89,827	107.791,80	0,05
SK4120010430	1,3750 % Slowakei Anl. 15/27		EUR	90.000	0	0	% 93,278	83.949,75	0,04
SK4000017158	0,2500 % Slowakei Anl. 20/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 93,450	934.500,00	0,44
SK4000017166	1,0000 % Slowakei Anl. 20/32		EUR	70.000	0	0	% 80,395	56.276,50	0,03
XS2532312548	2,8750 % Statkraft AS MTN 22/29		EUR	500.000	500.000	0	% 95,935	479.672,50	0,23
XS2178833773	3,8750 % Stellantis N.V. MTN 20/26		EUR	350.000	0	0	% 99,538	348.383,00	0,17
XS2550868801	5,1250 % Suedzucker Intl Finance B.V. Notes 22/27		EUR	400.000	400.000	0	% 101,985	407.938,00	0,19
FR001400AFL5	1,8750 % Suez S.A. MTN 22/27		EUR	400.000	400.000	0	% 90,794	363.176,00	0,17

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
XS2348325494	0,5000 % TenneT Holding B.V. MTN 21/31		EUR	100.000	0	0	% 75,759	75.759,00	0,04
XS2477935345	1,6250 % TenneT Holding B.V. MTN 22/26		EUR	375.000	375.000	0	% 93,093	349.098,75	0,17
XS2549543143	3,8750 % TenneT Holding B.V. MTN 22/28		EUR	500.000	500.000	0	% 100,796	503.977,50	0,24
CH0409606354	1,2500 % UBS Group AG FLR Notes 18/25		EUR	400.000	0	0	% 96,215	384.858,00	0,18
XS2181689659	1,7500 % Ungarn Bonds 20/35		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 66,625	666.250,00	0,32
XS2360310044	0,8000 % UniCredit S.p.A. FLR Preferred MTN 21/29		EUR	1.000.000	0	0	% 80,541	805.405,00	0,38
XS2478685931	2,2500 % UPM Kymmene Corp. MTN 22/29		EUR	400.000	400.000	0	% 90,701	362.804,00	0,17
DE000A3MQ556	1,3750 % Vonovia SE MTN 22/26		EUR	300.000	300.000	0	% 90,806	272.418,00	0,13
USD								184.613,73	0,09
US62954WAH88	4,1420 % NTT Finance Corp. Notes 22/24 144A		USD	200.000	200.000	0	% 98,515	184.613,73	0,09
Sonstige Beteiligungswertpapiere								1.475.440,65	0,70
CHF								1.475.440,65	0,70
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	4.960	280	260	CHF 293,400	1.475.440,65	0,70
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								3.282.632,25	1,54
Verzinsliche Wertpapiere								3.282.632,25	1,54
EUR								3.282.632,25	1,54
DE000A30VPL3	3,4500 % Amprion GmbH MTN 22/27		EUR	500.000	500.000	0	% 98,221	491.105,00	0,23
XS2079716853	0,0000 % Apple Inc. Notes 19/25		EUR	600.000	600.000	0	% 91,918	551.505,00	0,26
XS2354685575	0,3610 % EEW Energy from Waste GmbH Anl. 21/26		EUR	200.000	0	0	% 86,378	172.756,00	0,08
DE000A30VPZ3	2,5000 % Emissionskons.Landesfoerderins. IHS 22/29		EUR	1.300.000	1.300.000	0	% 96,274	1.251.562,00	0,59
XS2369906644	0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33 ¹⁾		EUR	300.000	0	0	% 71,114	213.340,50	0,10
XS2485265214	3,1250 % ProLogis Intl Funding II S.A. MTN 22/31		EUR	500.000	500.000	0	% 88,930	444.650,00	0,21
XS2388183381	1,0000 % Smurfit Kappa Treasury PUC Notes 21/33		EUR	225.000	0	0	% 70,095	157.713,75	0,07
Nichtnotierte Wertpapiere								98.535,04	0,05
Aktien								98.535,04	0,05
USD								98.535,04	0,05
US0036541003	Abiomed Inc. Reg.Shares		STK	276	110	0	USD 381,020	98.535,04	0,05
Wertpapier-Investmentanteile								79.738.758,32	37,92
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								79.738.758,32	37,92
EUR								32.005.476,50	15,22
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.		ANT	3.195.000	1.335.000	695.000	EUR 4,678	14.946.529,50	7,11
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares		ANT	85.000	179.000	249.000	EUR 5,617	477.445,00	0,23
IE00BYVJRP78	iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares		ANT	1.824.000	1.085.000	412.000	EUR 6,419	11.708.256,00	5,57
IE00BYZTVT56	iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares		ANT	1.000	450.000	449.000	EUR 4,496	4.496,00	0,00
IE00B52VJ196	iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)		ANT	5.000	17.700	90.000	EUR 55,500	277.500,00	0,13
LU0446734369	UBS(LFS-MSCI EMU Value UCITS Inhaber-Ant. A-dis		ANT	125.000	259.000	134.000	EUR 36,730	4.591.250,00	2,18
USD								47.733.281,82	22,70
LU1806495575	AIS-Amun.Idx US Corp. SRI A.N.UCIT.ETF USD A.N		ANT	398.000	273.000	20.000	USD 52,640	19.630.564,54	9,33
IE00BFZPF322	In.M.I Invesco AT1 Cap Bd ETF Reg.Shs Acc.		ANT	97.000	97.000	0	USD 23,760	2.159.494,03	1,03
IE00BKFO9C98	iShs II-§ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	2.500.000	1.765.000	0	USD 4,331	10.145.233,08	4,83
IE00BYVJRP78	iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares		ANT	870.000	870.000	0	USD 6,858	5.590.091,36	2,65
IE00BYVJRR92	iShsIV-MSCI USA SRI UCITS ETF Reg.Shares		ANT	140.000	181.000	260.100	USD 11,450	1.501.991,10	0,71
IE00BLRPRF81	L&G ESG Em.Mkts Corp.Bd ETF Reg.Shs Dis.		ANT	850.000	600.000	250.000	USD 8,455	6.733.895,53	3,21
IE00B4613386	SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist)		ANT	38.000	37.900	0	USD 55,385	1.972.012,18	0,94
Summe Wertpapiervermögen								EUR 188.388.716,68	89,45
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								-55.103,98	-0,03

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) März 23		XEUR	EUR	Anzahl -69				78.315,00	0,04	
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) März 23		XCME	USD	Anzahl 11				-138.756,15	-0,07	
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) März 23		IFUS	USD	Anzahl 24				5.337,17	0,00	
Summe Aktienindex-Derivate								EUR	-55.103,98	-0,03
Zins-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte								409.029,56	0,19	
EURO Buxl Future (FGBX) März 23		XEUR	EUR	-400.000				68.440,00	0,03	
Long Term EURO OAT Future (FOAT) März 23		XEUR	EUR	-6.000.000				123.325,56	0,06	
US Treasury Long Bond Future (US) März 23		XCBT	USD	-5.600.000				217.264,00	0,10	
Summe Zins-Derivate								EUR	409.029,56	0,19
Devisen-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Kauf)								36.840,39	0,01	
Offene Positionen										
AUD/USD 2.661.048,90		OTC						10.024,20	0,00	
CHF/EUR 220.000,00		OTC						-259,85	0,00	
DKK/EUR 1.700.000,00		OTC						30,81	0,00	
GBP/EUR 300.000,00		OTC						-3.686,12	0,00	
NZD/USD 3.284.430,04		OTC						30.731,35	0,01	
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								24.733,29	0,00	
Offene Positionen										
CHF/EUR 1.500.000,00		OTC						10.072,21	0,00	
DKK/EUR 25.050.000,00		OTC						781,85	0,00	
GBP/EUR 3.550.000,00		OTC						110.524,94	0,05	
GBP/USD 1.856.876,88		OTC						8.796,41	0,00	
JPY/EUR 674.447.044,00		OTC						-134.352,81	-0,06	
JPY/USD 200.182.000,00		OTC						-70.796,09	-0,03	
SEK/EUR 9.000.000,00		OTC						18.806,62	0,01	
USD/EUR 18.806.000,00		OTC						80.900,16	0,03	
Summe Devisen-Derivate								EUR	61.573,68	0,01
Swaps										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Zinsswaps (Erhalten/Zahlen)								-4.440.302,34	-2,11	
IRS 0.414% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 21.12.2025		OTC	USD	200.000				-20.448,91	-0,01	
IRS 0.495% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 22.12.2025		OTC	USD	200.000				-20.016,99	-0,01	
IRS 0.542% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 22.10.2023		OTC	USD	2.300.000				-92.076,89	-0,04	
IRS 0.622% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 21.12.2027		OTC	USD	130.000				-18.467,13	-0,01	
IRS 0.884% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 21.12.2030		OTC	USD	150.000				-28.383,80	-0,01	
IRS 1.21% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 22.10.2026		OTC	USD	2.900.000				-293.002,30	-0,14	
IRS 1.353% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 21.12.2050		OTC	USD	150.000				-53.006,30	-0,03	
IRS 1.435% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 22.10.2028		OTC	USD	1.500.000				-187.988,32	-0,09	
IRS 1.59% USD / SOFR USD / BNP_PAR 01.02.2032		OTC	USD	8.000.000				-1.128.483,86	-0,54	
IRS 1.628% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 22.10.2031		OTC	USD	1.000.000				-156.487,67	-0,07	
IRS 1.6531% USD / SOFR USD / BNP_PAR 01.02.2052		OTC	USD	4.000.000				-1.046.829,37	-0,50	
IRS 1.847% USD / LIBUSDM03 USD / DGZ_FRA 22.10.2051		OTC	USD	2.650.000				-735.182,31	-0,35	
IRS 2.2295% USD / SOFR USD / JPMORGAN_FRA 04.04.2024		OTC	USD	11.200.000				-323.810,92	-0,15	
IRS 2.5275% USD / SOFR USD / BNP_PAR 27.04.2024		OTC	USD	13.000.000				-336.117,57	-0,16	
Summe Swaps								EUR	-4.440.302,34	-2,11
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds										
Bankguthaben										
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle										
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	7.612.722,58			%	100,000	7.612.722,58	3,63
EUR-Guthaben bei										
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	11.939.066,20			%	100,000	11.939.066,20	5,68
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	95.641,56			%	100,000	12.860,84	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	372.262,59			%	100,000	35.377,10	0,02
DekaBank Deutsche Girozentrale			PLN	0,20			%	100,000	0,04	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	729.186,93			%	100,000	65.499,56	0,03
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	310.127,55			%	100,000	197.508,94	0,09
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	178,60			%	100,000	123,65	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	33.962,34			%	100,000	34.433,21	0,02

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	34.133,29			% 100,000	38.561,28	0,02
DekaBank Deutsche Girozentrale			HKD	525,52			% 100,000	63,14	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	23.291.552,00			% 100,000	165.628,81	0,08
DekaBank Deutsche Girozentrale			MXN	1.212.497,37			% 100,000	58.254,21	0,03
DekaBank Deutsche Girozentrale			NZD	132.288,48			% 100,000	78.567,77	0,04
DekaBank Deutsche Girozentrale			THB	2.000.000,00			% 100,000	54.297,07	0,03
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	276.728,22			% 100,000	259.290,91	0,12
DekaBank Deutsche Girozentrale			ZAR	112,46			% 100,000	6,20	0,00
Summe Bankguthaben²⁾								EUR 20.552.261,51	9,80
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR 20.552.261,51	9,80
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	296.805,46				296.805,46	0,14
Dividendenansprüche			EUR	50.043,91				50.043,91	0,02
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	987.042,71				987.042,71	0,47
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	128,40				128,40	0,00
Forderungen aus Anteilsceingeschäften			EUR	35.386,85				35.386,85	0,02
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	27.708,24				27.708,24	0,01
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	4.590.000,00				4.590.000,00	2,18
Summe Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 5.987.115,57	2,84
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen			EUR	-42,36				-42,36	0,00
Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften			EUR	-98.668,95				-98.668,95	-0,05
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-219.022,01				-219.022,01	-0,10
Summe Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -317.733,32	-0,15
Fondsvermögen								EUR 210.585.557,36	100,00
Umlaufende Anteile Klasse CF								STK 1.836.304,000	
Umlaufende Anteile Klasse TF								STK 365.666,000	
Anteilwert Klasse CF								EUR 95,81	
Anteilwert Klasse TF								EUR 94,74	

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

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

²⁾ Diese Bankguthaben sind ganz oder teilweise als Sicherheit für sonstige Derivate an einen Dritten übertragen.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR 32.000		29.241,92	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30	EUR 200.000		166.344,00	
2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25	EUR 140.000		137.328,80	
0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33	EUR 300.000		213.340,50	
0,2500 % Republik Lettland MTN 21/30	EUR 175.000		137.345,25	
0,0000 % Republik Zypern MTN 21/26	EUR 120.000		107.791,80	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		791.392,27	791.392,27

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.12.2022			
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88517	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43665	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,52270	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,13270	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,98633	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,68055	= 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	18,14240	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06725	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,44442	= 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso	(MXN)	20,81390	= 1 Euro (EUR)
Thailand, Baht	(THB)	36,83440	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	140,62500	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,32280	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,57020	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,68375	= 1 Euro (EUR)

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Marktschlüssel

Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
IFUS	New York/N.Y. - ICE Futures U.S.
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

OTC

Over-the-Counter

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
CHF				
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien	STK	0	397
CH0364749348	Vifor Pharma AG Nam.-Akt.	STK	0	861
DKK				
DK0060946788	Ambu A/S Navne-Aktier B	STK	0	2.097
DK0010272632	GN Store Nord AS Navne-Aktier	STK	0	1.974
EUR				
FR0004125920	Amundi S.A. Actions au Porteur	STK	0	755
FR0000120172	Carrefour S.A. Actions Port.	STK	0	9.710
FR0000120222	CNP Assurances S.A. Actions Port.	STK	0	2.840
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK	0	15.517
FR0010040865	Gecina S.A. Actions Nom.	STK	0	639
NL0015000LU4	Iveco Group N.V. Aandelen op naam	STK	3.157	3.157
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins SGPS, S.A. Acções Nominativas	STK	0	4.638
NL0009432491	Koninklijke Vopak N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	1.158
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK	0	2.248
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK	820	14.600
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares	STK	0	1.977
GBP				
GB0000456144	Antofagasta PLC Reg.Shares	STK	0	5.231
GB0000536739	Ashtead Group PLC Reg.Shares	STK	0	7.038
GB00BD6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares	STK	0	27.594
JE00BJVNS543	Ferguson PLC Reg.Shares	STK	0	3.468
GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC Reg.Shares	STK	0	31.715
JPY				
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares	STK	0	20.900
JP3218900003	Capcom Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.200
JP3519400000	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.800
JP3783600004	East Japan Railway Co. Reg.Shares	STK	0	3.500
JP3160400002	Eisai Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.800
JP3814000000	Fujifilm Holdings Corp. Reg.Shares	STK	0	4.400
JP3385980002	JSR Corp. Reg.Shares	STK	0	2.400
JP3229400001	Kansai Paint Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	700
JP3277800003	Keio Corp. Reg.Shares	STK	0	600
JP3880800002	Miura Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	600
JP3027670003	Nippon Building Fund Inc. Reg.Shares	STK	0	17
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Reg.Shares	STK	0	1.700
JP3190000004	Obayashi Corp. Reg.Shares	STK	0	8.900
JP3196000008	Odakyu Electric Railway Co.Ltd Reg.Shares	STK	0	3.900
JP3040880001	Orix Jreit Inc. Reg.Shares	STK	0	17
JP3421800008	Secom Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.400
JP3358800005	Shimizu Corp. Reg.Shares	STK	0	2.300
JP3347200002	Shionogi & Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	3.200
JP3431900004	Sohgo Security Services Co.Ltd Reg.Shares	STK	0	200
JP3399400005	Stanley Electric Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	600
JP3424950008	Tokyo Century Corp. Reg.Shares	STK	0	400
JP3659000008	West Japan Railway Co. Reg.Shares	STK	0	2.400
JP3932000007	Yaskawa Electric Corp. Reg.Shares	STK	0	2.500
USD				
US12685J1051	Cable One Inc. Reg.Shares	STK	0	7
US1344291091	Campbell Soup Co. Reg.Shares	STK	0	235
CA13645T1003	Canadian Pacific Railway Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.171
US16411R2085	Cheniere Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	1.263
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares	STK	5.343	22.700
US1264081035	CSX Corp. Reg.Shares	STK	2.058	11.732
US2786421030	eBay Inc. Reg.Shares	STK	0	2.992
US29082K1051	Embeckta Corp. Reg.Shares	STK	251	251
US34959J1088	Fortive Corp. Reg.Shares	STK	646	1.819
US3687361044	Generac Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	337
US4062161017	Halliburton Co. Reg.Shares	STK	4.162	4.162
US4932671088	Keycorp Reg.Shares	STK	1.600	5.177
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A	STK	463	1.379
US6558441084	Norfolk Southern Corp. Reg.Shares	STK	235	1.281
US6826801036	Oneok Inc. (New) Reg.Shares	STK	460	2.414
US7185461040	Phillips 66 Reg.Shares	STK	611	2.534

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US74251V1026	Principal Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	0	1.107
US74340W1036	ProLogis Inc. Reg.Shares	STK	751	3.959
US7766961061	Roper Technologies Inc. Reg.Shares	STK	85	561
US8574771031	State Street Corp. Reg.Shares	STK	390	1.974
US87918A1051	Teladoc Health Inc. Reg.Shares	STK	0	423
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK	250	1.593
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS2168647357	1,3750 % Banco Santander S.A. Non-Preferred MTN 20/26	EUR	0	400.000
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. MTN 19/29	EUR	0	500.000
FR0013398070	2,1250 % BNP Paribas S.A. FLR MTN 19/27	EUR	0	400.000
DE0001135226	4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 03/34	EUR	0	30.000
DE0001102473	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 19/29	EUR	0	58.000
XS1962571011	1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 19/31	EUR	0	200.000
XS1958307461	1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Non-Pref. MTN 19/29	EUR	0	300.000
FR0013508512	1,0000 % Crédit Agricole S.A. FLR Non-Pref. MTN 20/26	EUR	0	400.000
XS2024715794	0,5000 % Deutsche Telekom AG MTN 19/27	EUR	0	400.000
XS2306517876	0,2500 % DNB Bank ASA FLR Non-Pref. MTN 21/29	EUR	0	500.000
EU000A3K7MW2	1,6250 % Europaeische Union MTN 22/29	EUR	1.300.000	1.300.000
BE0002890722	3,0000 % Flaemische Gemeinschaft MTN 22/32	EUR	500.000	500.000
ES0000012G00	1,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/50	EUR	0	800.000
BE0000349580	0,1000 % Königreich Belgien Bons d'Etat 20/30	EUR	0	51.000
BE0000350596	0,4000 % Königreich Belgien Obl. Lin. 20/40	EUR	0	145.000
ES0000012B47	2,7000 % Königreich Spanien Bonos 18/48	EUR	0	70.000
ES0000012F43	0,6000 % Königreich Spanien Bonos 19/29	EUR	0	145.000
ES0000012E69	1,8500 % Königreich Spanien Bonos 19/35	EUR	0	220.000
ES0000012G34	1,2500 % Königreich Spanien Obligaciones 20/30	EUR	0	90.000
ES0000012G42	1,2000 % Königreich Spanien Obligaciones 20/40	EUR	0	140.000
FR0013396520	2,0000 % Orange S.A. MTN 19/29	EUR	0	400.000
XS2563353361	5,2500 % Orsted A/S FLR Notes 22/Und.	EUR	225.000	225.000
IT0005282527	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 17/24	EUR	1.000.000	1.000.000
IT0005344335	2,4500 % Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	0	115.000
IT0005340929	2,8000 % Republik Italien B.T.P. 18/28	EUR	0	44.000
IT0005358806	3,3500 % Republik Italien B.T.P. 18/35	EUR	0	78.000
IT0005363111	3,8500 % Republik Italien B.T.P. 18/49	EUR	0	42.000
IT0005384497	0,0500 % Republik Italien B.T.P. 19/23	EUR	0	80.000
IT0005367492	1,7500 % Republik Italien B.T.P. 19/24	EUR	0	170.000
IT0005386245	0,3500 % Republik Italien B.T.P. 19/25	EUR	60.000	250.000
IT0005370306	2,1000 % Republik Italien B.T.P. 19/26	EUR	0	210.000
IT0005390874	0,8500 % Republik Italien B.T.P. 19/27	EUR	0	240.000
IT0005383309	1,3500 % Republik Italien B.T.P. 19/30	EUR	0	250.000
IT0005416570	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 20/27	EUR	0	100.000
IT0005422891	0,9000 % Republik Italien B.T.P. 20/31	EUR	0	600.000
IT0005402117	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 20/36	EUR	0	260.000
IT0005438004	1,5000 % Republik Italien B.T.P. 20/45	EUR	100.000	100.000
IT0005425233	1,7000 % Republik Italien B.T.P. 20/51	EUR	0	1.200.000
IT0005439275	0,0000 % Republik Italien B.T.P. 21/24	EUR	400.000	400.000
IT0005466013	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/32	EUR	1.000.000	1.000.000
IT0005508590	4,0000 % Republik Italien B.T.P. 22/35	EUR	225.000	225.000
PTOTESOE0013	2,2000 % Republik Portugal Obr. 15/22	EUR	0	49.000
XS2182054887	0,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 20/26	EUR	0	300.000
XS2156510021	1,0000 % Svenska Handelsbanken AB MTN 20/25	EUR	0	300.000
XS2177441990	1,2010 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 20/27	EUR	0	400.000
XS2430285077	0,0640 % Toyota Finance Australia Ltd. MTN 22/25	EUR	225.000	225.000
FR001400EA16	5,3750 % Valéo S.E. MTN 22/27	EUR	300.000	300.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS2360381730	3,7500 % Elior Group SA Notes 21/26	EUR	0	275.000
XS2527451905	2,6250 % Svenska Handelsbanken AB Preferred MTN 22/29	EUR	300.000	300.000
USD				
US168863DV76	3,5000 % Republik Chile Notes 22/34	USD	225.000	225.000
US168863DW59	4,0000 % Republik Chile Notes 22/52	USD	200.000	200.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
CHF				
CH1156060167	Vifor Pharma AG Nam.-Akt. (2te Linie)	STK	861	861
EUR				
FR0000121261	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom.	STK	0	2.646
FR0010613471	Veolia Environnement S.A. Actions Port.	STK	0	6.100
GBP				
GB0002405495	Schroders PLC Reg.Shares	STK	394	2.626
JPY				
JP3729400006	Nippon Express Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	400
SEK				
SE0015811559	Boliden AB Namn-Aktier	STK	0	4.402
SE0017768724	Boliden AB Reg. Redemption Shares	STK	4.402	4.402
USD				

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US1567821046	Cerner Corp. Reg.Shares	STK	0	1.546
BMG475671050	IHS Markit Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.680
Andere Wertpapiere				
EUR				
BE0970178811	Elia Group Anrechte	STK	508	508
Wertpapier-Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
IE00B4L60045	iShsIII-EO Corp Bd 1-5yr U.ETF Reg.Shares	ANT	21.000	21.000
LU1686830909	L. I. Fd - L. I. DL Li. EM S. Act. Nom. Dis.	ANT	0	33.000
IE00B4613386	SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist)	ANT	31.900	37.900
USD				
IE00BCRY5Y77	iShsIV-DL Sh.Dur.Corp Bd U.ETF Reg.Shares (Dist)	ANT	69.000	69.000
IE00BD1F4M44	iShsIV-Edge MSCI USA V.F.U.ETF Reg.Shares	ANT	680.000	680.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	77.337
(Basiswert(e): Dow Jones Industrial Average Index (Price) (USD), ESTX Banks Index (Price) (EUR), EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), MSCI Emerging Markets Index, MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index, STXE 600 ESG-X Index (Price) (EUR))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	73.879
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), MSCI Emerging Markets Index, S&P 500 Index, STXE 600 ESG-X Index (Price) (EUR))		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	6.149
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	338.873
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO-BTP Future (FBTP), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU), Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY), US Treasury Long Bond Future (US))		
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	12.804
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	22.685
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))		
Verkaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	8.910
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))		
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	1.480
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))		
Währungsderivate		
Optionsrechte auf Devisen-Derivate		
Optionsrechte auf Devisen		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	4.126
EUR/USD		
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	4.039
EUR/USD		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/USD	EUR	13.866
CHF/EUR	EUR	15.134
CZK/EUR	EUR	1.526
DKK/EUR	EUR	34.146
GBP/EUR	EUR	25.041
GBP/USD	EUR	7.468
JPY/EUR	EUR	47.822
JPY/USD	EUR	55.270
NZD/USD	EUR	12.403
PLN/EUR	EUR	2.062
RUB/USD	EUR	89
SEK/EUR	EUR	8.492
USD/EUR	EUR	103.608
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/USD	EUR	17.703
CHF/EUR	EUR	9.047
DKK/EUR	EUR	27.487
GBP/EUR	EUR	17.705
GBP/USD	EUR	7.471
JPY/EUR	EUR	79.689

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Gattungsbezeichnung

JPY/USD
NZD/USD
PLN/EUR
RUB/USD
SEK/EUR
USD/EUR

Stück bzw.
Anteile bzw. Whg.
EUR
EUR
EUR
EUR
EUR
EUR

Volumen
in 1.000
28.255
18.184
2.074
89
5.918
55.922

Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):

unbefristet

EUR 56.680

(Basiswert(e): 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 19/29, 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30, 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24, 0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. MTN 19/27, 0,1000 % Königreich Belgien Bons d'Etat 20/30, 0,2000 % Republik Slowenien Bonds 20/23, 0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27, 0,2500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) MTN 21/28, 0,2500 % DNB Bank ASA FLR Non-Pref. MTN 21/29, 0,2500 % Republik Lettland MTN 21/30, 0,3750 % E.ON SE MTN 20/27, 0,3750 % ENEL Finance Intl N.V. MTN 21/29, 0,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 20/26, 0,5000 % Deutsche Telekom AG MTN 19/27, 0,5000 % OP Yrityspankki Oyj Preferred MTN 20/25, 0,5000 % TenneT Holding B.V. MTN 21/31, 0,6000 % E.ON SE MTN 21/32, 0,6250 % Banco Santander S.A. FLR Non-Pref. MTN 21/29, 0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32, 0,7500 % La Banque Postale Non-Pref. MTN 21/31, 0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25, 0,8000 % UniCredit S.p.A. FLR Preferred MTN 21/29, 0,8750 % Republik Slowenien Bonds 20/30, 0,9000 % Nasdaq Inc. Notes 21/33, 0,9000 % Republik Italien B.T.P. 20/31, 0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/32, 1,0000 % ESB Finance DAC MTN 22/34, 1,0000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/50, 1,0000 % Republik Portugal Obr. 21/52, 1,0000 % Slowakei Anl. 20/32, 1,0000 % Smurfit Kappa Treasury PUC Notes 21/33, 1,0000 % Svenska Handelsbanken AB MTN 20/25, 1,1250 % Polski Koncern Naftowy Orlen MTN 21/28, 1,1875 % Republik Slowenien Bonds 19/29, 1,2010 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 20/27, 1,3750 % Danske Bank AS FLR Non-Pref. MTN 22/27, 1,5000 % BMW Finance N.V. MTN 19/29, 1,6250 % Europaeische Union MTN 22/29, 1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. MTN 19/31, 2,0000 % Orange S.A. MTN 19/29, 2,1500 % Königreich Spanien Obligaciones 15/25, 2,6250 % Henkel AG & Co. KGaA MTN 22/27, 2,7500 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 20/30, 2,7500 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 22/25, 3,2500 % Knorr-Bremse AG MTN 22/27, 3,7500 % Elixir Group SA Notes 21/26, 3,8750 % Stellantis N.V. MTN 20/26, 3,8750 % TenneT Holding B.V. MTN 22/28, 4,1250 % Carrefour S.A. MTN 22/28, 4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 03/34, 5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24, Abrdn PLC Reg.Shares, Ally Financial Inc. Reg.Shares, Ambu A/S Navne-Aktier B, Amplifon S.p.A. Azioni nom., Antofagasta PLC Reg.Shares, ASML Holding N.V. Aandelen op naam, Associated British Foods PLC Reg.Shares, Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom., Bureau Veritas SA Actions au Porteur, CNH Industrial N.V. Aandelen op naam, Covivio S.A. Actions Port., Croda International PLC Reg.Shares, Demant AS Navne Aktier A, EDP Renováveis S.A. Acciones Port., Electrolux, AB Namn-Aktier B, Elia Group Actions au Port., GENMAB AS Navne-Aktier, Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien, Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Reg.Shares, Husqvarna AB Namn-Aktier B, Industria de Diseño Textil SA Acciones Port., Informa PLC Reg.Shares, InterContinental Hotels Group Reg.Shares, Intertek Group PLC Reg.Shares, Iveco Group N.V. Aandelen op naam, J. Sainsbury PLC Reg.Shs, L'Oréal S.A. Actions Port., Miura Co. Ltd. Reg.Shares, NN Group N.V. Aandelen aan toonder, Novozymes A/S Navne-Aktier B, Schneider Electric SE Actions Port., Severn Trent PLC Reg.Shares, Sonova Holding AG Namens-Aktien, Suntory Beverage & Food Ltd. Reg.Shares, Swiss Life Holding AG Namens-Aktien, Swiss Re AG Namens-Aktien, Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares, Taylor Wimpey PLC Reg.Shares, Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien, The British Land Co. PLC Reg.Shares, Umicore S.A. Actions Nom., Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares, United Utilities Group PLC Reg.Shares, Verbund AG Inhaber-Aktien, Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier, Vifor Pharma AG Nam.-Akt. (2te Linie), Wärtsilä Corp. Reg.Shares, Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam, Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares, Zalando SE Inhaber-Aktien)

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 2,76 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 5.794.165 Euro.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (CF)

Entwicklung des Sondervermögens

		EUR
I.	Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	141.467.398,38
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr	-881.700,60
2	Zwischenausschüttung(en)	-,-
3	Mittelzufluss (netto)	59.041.824,97
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 66.953.563,46
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 66.953.563,46
	davon aus Verschmelzung	EUR 0,00
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR -7.911.738,49
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-73.890,39
5	Ergebnis des Geschäftsjahres	-23.612.085,86
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-4.562.433,16
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-17.619.773,51
II.	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	175.941.546,50

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
31.12.2019	0,00	0,00
31.12.2020	22.197.636,00	102,65
31.12.2021	141.467.398,38	111,65
31.12.2022	175.941.546,50	95,81

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (CF)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2022 - 31.12.2022 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	174.977,99	0,10
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	1.573.657,40	0,86
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	26.115,50	0,01
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	284.954,47	0,16
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-80.193,43	-0,04
davon Negative Einlagezinsen	-131.075,62	-0,07
davon Positive Einlagezinsen	50.882,19	0,03
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	1.021.154,00	0,56
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	7.826,58	0,00
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	7.826,58	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-26.246,50	-0,01
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividenerträge	-26.246,50	-0,01
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-249.206,66	-0,14
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-249.206,66	-0,14
10. Sonstige Erträge	31.483,39	0,02
davon Kick-Back-Zahlungen	92,93	0,00
davon Kompensationszahlungen	29.253,10	0,02
davon Quellensteuerrückvergütung Dividenden	2.137,36	0,00
Summe der Erträge	2.764.522,74	1,51
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-4.966,25	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-1.848.910,19	-1,01
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-348.024,56	-0,19
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-2.582,41	-0,00
davon EMIR-Kosten	-11.577,24	-0,01
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-26.166,77	-0,01
davon Kosten für Stimmrechtsausübung	-20,58	-0,00
davon Kostenpauschale	-295.825,44	-0,16
davon Ratinggebühren	-11.852,12	-0,01
Summe der Aufwendungen	-2.201.901,00	-1,20
III. Ordentlicher Nettoertrag	562.621,74	0,31
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	11.250.146,20	6,13
2. Realisierte Verluste	-13.242.647,13	-7,21
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-1.992.500,93	-1,09
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.429.879,19	-0,78
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-4.562.433,16	-2,48
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-17.619.773,51	-9,60
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-22.182.206,67	-12,08
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-23.612.085,86	-12,86

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung

	EUR insgesamt	EUR je Anteil ¹⁾
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.429.879,19	-0,78
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹⁾	4.569.959,03	2,49
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung²⁾	3.140.079,84	1,71
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung ³⁾	3.140.079,84	1,71

Umlaufende Anteile: Stück 1.836.304

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

¹⁾ Betrag, um den die Ausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres übersteigt.

²⁾ Der Abzug von Kapitalertragsteuer und Solidaritätszuschlag erfolgt gemäß § 44 Abs. 1 Satz 3 EStG über die depotführende Stelle bzw. über die letzte inländische auszahlende Stelle als Entrichtungspflichtete.

³⁾ Ausschüttung am 24. Februar 2023 mit Beschlussfassung vom 21. Februar 2023.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (TF)

Entwicklung des Sondervermögens

		EUR
I.	Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	32.462.330,58
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr	-136.486,80
2	Zwischenausschüttung(en)	-,-
3	Mittelzufluss (netto)	7.699.819,63
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 11.920.331,65
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 11.920.331,65
	davon aus Verschmelzung	EUR 0,00
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR -4.220.512,02
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	2.937,08
5	Ergebnis des Geschäftsjahres	-5.384.589,63
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-1.049.405,94
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-3.871.088,59
II.	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	34.644.010,86

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
31.12.2019	0,00	0,00
31.12.2020	6.095.979,88	102,13
31.12.2021	32.462.330,58	110,75
31.12.2022	34.644.010,86	94,74

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset (TF)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2022 - 31.12.2022 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	34.567,19	0,09
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	310.634,11	0,85
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	5.148,32	0,01
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	56.219,93	0,15
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-15.854,82	-0,04
davon Negative Einlagezinsen	-25.884,44	-0,07
davon Positive Einlagezinsen	10.029,62	0,03
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	201.473,59	0,55
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	1.544,96	0,00
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	1.544,96	0,00
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-5.184,99	-0,01
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividenerträge	-5.184,99	-0,01
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-49.195,54	-0,13
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-49.195,54	-0,13
10. Sonstige Erträge	6.214,50	0,02
davon Kick-Back-Zahlungen	18,36	0,00
davon Kompensationszahlungen	5.774,34	0,02
davon Quellensteuerrückvergütung Dividenden	421,80	0,00
Summe der Erträge	545.567,25	1,49
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-980,41	-0,00
2. Verwaltungsvergütung	-547.655,62	-1,50
3. Verwahrstellenvergütung	0,00	0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-68.718,70	-0,19
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-510,22	-0,00
davon EMIR-Kosten	-2.285,01	-0,01
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-5.168,47	-0,01
davon Kosten für Stimmrechtsausübung	-4,01	-0,00
davon Kostenpauschale	-58.416,68	-0,16
davon Ratinggebühren	-2.334,31	-0,01
Summe der Aufwendungen	-617.354,73	-1,69
III. Ordentlicher Nettoertrag	-71.787,48	-0,20
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	2.221.089,86	6,07
2. Realisierte Verluste	-2.613.397,48	-7,15
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-392.307,62	-1,07
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-464.095,10	-1,27
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-1.049.405,94	-2,87
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-3.871.088,59	-10,59
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-4.920.494,53	-13,46
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-5.384.589,63	-14,73

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung

	EUR insgesamt	EUR je Anteil ¹⁾
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-464.095,10	-1,27
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹⁾	1.082.070,64	2,96
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung²⁾	617.975,54	1,69
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung ³⁾	617.975,54	1,69

Umlaufende Anteile: Stück 365.666

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

¹⁾ Betrag, um den die Ausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres übersteigt.

²⁾ Der Abzug von Kapitalertragsteuer und Solidaritätszuschlag erfolgt gemäß § 44 Abs. 1 Satz 3 EStG über die depotführende Stelle bzw. über die letzte inländische auszahlende Stelle als Entrichtungsverpflichtete.

³⁾ Ausschüttung am 24. Februar 2023 mit Beschlussfassung vom 21. Februar 2023.

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Anhang.

Zusätzliche Angaben zu den Derivaten

Instrumentenart	Kontrahent	Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)
Aktienindex-Terminkontrakte	CME Globex	-138.756,15
Aktienindex-Terminkontrakte	Eurex Deutschland	78.315,00
Aktienindex-Terminkontrakte	ICE Futures U.S., INC.	5.337,17
Devisenterminkontrakte	BNP Paribas S.A.	-229.350,56
Devisenterminkontrakte	BofA Securities Europe S.A.	61.652,51
Devisenterminkontrakte	DekaBank Deutsche Girozentrale	131.208,50
Devisenterminkontrakte	Morgan Stanley Europe SE	-21.258,12
Devisenterminkontrakte	NatWest Markets N.V.	110.524,94
Devisenterminkontrakte	UBS AG [London Branch]	8.796,41
Zinsswaps	BNP Paribas S.A.	-2.511.430,80
Zinsswaps	DekaBank Deutsche Girozentrale	-1.605.060,62
Zinsswaps	J.P. Morgan SE	-323.810,92
Zinsterminkontrakte	Chicago Board of Trade (CBOT)	217.264,00
Zinsterminkontrakte	Eurex Deutschland	191.765,56
Gesamtbetrag der Kurswerte der Bankguthaben, die Dritten als Sicherheit dienen:	EUR	4.590.000,00

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial wurde für dieses Sondervermögen gemäß der DerivateV nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt (relativer Value-at-Risk gem. § 8 DerivateV).

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§ 37 Abs. 5 DerivateV i. V. m. § 9 DerivateV)

5% ICE BofA BB & Lower Sovereign External Debt Index in EUR, 13% ICE BofA Global Corporate Index in EUR, 30% ICE BofA Global Government Index in EUR, 7% ICE BofA Global High Yield Index in EUR, 40% MSCI AC World NR in EUR, 5% Zinsbenchmark mit tgl. EUROSTR mit täglichem Zinsezins (30/360)

Dem Sondervermögen wird ein derivatereies Vergleichsvermögen gegenübergestellt. Es handelt sich dabei um eine Art virtuelles Sondervermögen, dem keine realen Positionen oder Geschäfte zugrunde liegen. Die Grundidee besteht darin, eine plausible Vorstellung zu entwickeln, wie das Sondervermögen ohne Derivate oder derivative Komponenten zusammengesetzt wäre. Das Vergleichsvermögen muss den Anlagebedingungen, den Angaben im Verkaufsprospekt und den wesentlichen Anlegerinformationen des Sondervermögens im Wesentlichen entsprechen, ein derivatereies Vergleichsmaßstab wird möglichst genau nachgebildet. In Ausnahmefällen kann von der Forderung des derivatereies Vergleichsvermögens abgewichen werden, sofern das Sondervermögen Long/Short-Strategien nutzt oder zur Abbildung von z.B. Rohstoffexposure oder Währungsabsicherungen.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (§ 37 Abs. 4 Satz 1 und 2 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

01.01.2022 - 18.09.2022

kleinster potenzieller Risikobetrag 2,40%

größter potenzieller Risikobetrag 3,76%

durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 2,93%

19.09.2022 - 31.12.2022

kleinster potenzieller Risikobetrag 4,36%

größter potenzieller Risikobetrag 5,15%

durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 4,84%

Der potenzielle Risikobetrag für das Marktrisiko des Sondervermögens wird über die Risikokennzahl Value-at-Risk (VaR) dargestellt. Zum Ausdruck gebracht wird durch diese Kennzahl der potenzielle Verlust des Sondervermögens, der unter normalen Marktbedingungen mit einem Wahrscheinlichkeitsniveau von 99% (Konfidenzniveau) bei einer angenommenen Haltedauer von 10 Arbeitstagen auf Basis eines effektiven historischen Betrachtungszeitraumes von einem Jahr nicht überschritten wird. Wenn zum Beispiel ein Sondervermögen einen VaR-Wert von 2,5% aufwies, dann würde unter normalen Marktbedingungen der potenzielle Verlust des Sondervermögens mit einer Wahrscheinlichkeit von 99% nicht mehr als 2,5% des Wertes des Sondervermögens innerhalb von 10 Arbeitstagen betragen. Im Bericht wird die maximale, minimale und durchschnittliche Ausprägung dieser Kennzahl auf Basis einer Beobachtungszeitreihe von maximal einem Jahr oder ab Umstellungsdatum veröffentlicht. Der VaR-Wert des Sondervermögens darf das Zweifache des VaR-Werts des derivatereies Vergleichsvermögens nicht übersteigen. Hierdurch wird das Marktrisiko des Sondervermögens klar limitiert.

Risikomodell (§ 37 Abs. 4 Satz 3 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

01.01.2022 - 18.09.2022: Varianz-Kovarianz Ansatz

19.09.2022 - 31.12.2022: historische Simulation

Im Berichtszeitraum genutzter Umfang des Leverage gemäß der Brutto-Methode (§ 37 Abs. 4 Satz 4 DerivateV i. V. m. § 5 Abs. 2 DerivateV)

154,78%

Emittenten oder Garanten, deren Sicherheiten mehr als 20% des Wertes des Fonds ausgemacht haben (§ 37 Abs. 6 DerivateV):

Im Berichtszeitraum wiesen keine Sicherheiten eine erhöhte Emittentenkonzentration nach § 27 Abs. 7 Satz 4 DerivateV auf.

Zusätzliche Angaben zu den Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäften (besichert)

Instrumentenart	Kontrahent	Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)
Wertpapier-Darlehen	DekaBank Deutsche Girozentrale	791.392,27
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:	EUR	1.600.418,53
davon:		
Schuldverschreibungen	EUR	1.600.418,53
Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse CF	EUR	7.826,58
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse CF	EUR	2.582,41
Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse TF	EUR	1.544,96
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften Anteilklasse TF	EUR	510,22
Umlaufende Anteile Klasse CF	STK	1.836.304

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Umlaufende Anteile Klasse TF	STK	365.666
Anteilwert Klasse CF	EUR	95,81
Anteilwert Klasse TF	EUR	94,74

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

Investmentanteile

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

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

Gesamtkostenquote (laufende Kosten) Anteilklasse CF	1,28%
Gesamtkostenquote (laufende Kosten) Anteilklasse TF	1,78%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Die anteiligen laufenden Kosten für die Zielfondsbestände sind auf Basis der zum Geschäftsjahresende des Dachfonds verfügbaren Daten ermittelt.

Für das Sondervermögen ist gemäß den Anlagebedingungen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Kostenpauschale von insgesamt 0,16% p.a. vereinbart. Davon entfallen bis zu 0,10% p.a. auf die Verwahrstelle und bis zu 0,10% p.a. auf Dritte. Die Kostenpauschale deckt die in den Besonderen Anlagebedingungen und im Verkaufsprospekt aufgeführten Vergütungen und Kosten ab, die dem Sondervermögen nicht separat belastet werden. Die Verwaltungsvergütung ist nicht Bestandteil der Kostenpauschale und wird dem Sondervermögen gesondert belastet.

Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen der aus dem Fonds an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen zu.

Die Gesellschaft gewährt an Vermittler, z.B. Kreditinstitute, wiederkehrend - meist jährlich - Vermittlungsentgelte als so genannte "Vermittlungsprovisionen" bzw. "Vermittlungsfolgeprovisionen".

Für den Erwerb und die Veräußerung der Investmentanteile sind keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge berechnet worden.

Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:

AIS-Amun.Idx US Corp. SRI A.N.UCIT.ETF USD A.N	n.v.
In.M.I Invesco AT1 Cap Bd ETF Reg.Shs Acc.	n.v.
iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	0,50
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.	n.v.
iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares	n.v.
iShsIII-EO Corp Bd 1-5yr U.ETF Reg.Shares	0,18
iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)	0,30
iShsIV-DL Sh.Dur.Corp Bd U.ETF Reg.Shares (Dist)	0,20
iShsIV-Edge MSCI USA V.F.U.ETF Reg.Shares	n.v.
iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares	n.v.
iShsIV-MSCI USA SRI UCITS ETF Reg.Shares	0,30
iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares	0,35
iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares	0,35
L&G ESG Em.Mkts Corp.Bd ETF Reg.Shs Dis.	0,35
L. I. Fd - L. I. DL Li. EM S. Act. Nom. Dis.	0,30
SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist)	0,55
SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist)	0,55
UBS(L)FS-MSCI EMU Value UCITS Inhaber-Ant. A-dis	0,25

Wesentliche sonstige Erträge

Anteilklasse CF		
Kick-Back-Zahlungen	EUR	92,93
Kompensationszahlungen	EUR	29.253,10
Quellensteuerrückvergütung Dividenden	EUR	2.137,36

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Anteilklasse TF		
Kick-Back-Zahlungen	EUR	18,36
Kompensationszahlungen	EUR	5.774,34
Quellensteuerrückvergütung Dividenden	EUR	421,80
Wesentliche sonstige Aufwendungen		
Anteilklasse CF		
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	2.582,41
EMIR-Kosten	EUR	11.577,24
Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	EUR	26.166,77
Kosten für Stimmrechtsausübung	EUR	20,58
Kostenpauschale	EUR	295.825,44
Ratinggebühren	EUR	11.852,12
Anteilklasse TF		
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	510,22
EMIR-Kosten	EUR	2.285,01
Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	EUR	5.168,47
Kosten für Stimmrechtsausübung	EUR	4,01
Kostenpauschale	EUR	58.416,68
Ratinggebühren	EUR	2.334,31
Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt	EUR	139.579,79

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka Investment GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme.

Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

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

Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlageerfolgsprämien, werden bei der Deka Investment GmbH nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

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

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

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

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

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

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitern unterhalb der Geschäftsführungs-Ebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
- Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 75 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2021 fand im Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2021 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung

davon feste Vergütung	EUR	52.919.423,38
davon variable Vergütung	EUR	43.285.414,31
	EUR	9.634.009,07

Zahl der Mitarbeiter der KVG 455

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der

Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**

Geschäftsführer	EUR	7.381.436,36
weitere Risk Taker	EUR	2.103.677,90
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR	1.913.005,27
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risk Taker	EUR	488.811,00
	EUR	2.875.942,19

* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt.

** weitere Risk Taker: alle sonstigen Risk Taker, die nicht Geschäftsführer oder Risk Taker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risk Taker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risk Taker oder Geschäftsführer befinden.

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	791.392,27	0,38

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	791.392,27	Deutschland

Art(en) von Abwicklung/Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem), per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte) oder trilateral (Agency-Geschäfte). Total Return Swaps werden als bilaterales OTC-Geschäft abgeschlossen.

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	791.392,27

Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen
EUR
USD

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR
unbefristet	1.600.418,53

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	8.485,37	100,00
Kostenanteil des Fonds	2.800,12	33,00
Ertragsanteil der KVG	2.800,12	33,00

Der oben ausgewiesene Kostenanteil des Fonds bzw. Ertragsanteil der KVG beinhaltet sowohl den Aufwandsersatz der Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) als auch zusätzliche Kosten Dritter. Damit werden der Infrastrukturaufwand der Kapitalverwaltungsgesellschaft und die Kosten des externen Wertpapierdarlehen-Serviceproviders für die Anbahnung, Durchführung und Abwicklung inklusive der Sicherheitenstellung abgegolten.

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

0,42% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Wertpapier-Darlehen	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Swedbank AB	659.709,15
Kreditanstalt für Wiederaufbau	471.210,60
Eika BoligKreditt A.S.	280.542,59
Infineon Technologies AG	188.956,19

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer 1
J.P.Morgan AG Frankfurt 1.600.418,53 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

Eine Zuordnung der Kontrahenten zu den erhaltenen Sicherheiten ist auf Geschäftsartenebenen durch die Globalbesicherung im Einzelnen bei Total Return Swaps nicht möglich. Der ausgewiesene Wert enthält daher ausdrücklich keine Total Return Swaps, diese sind innerhalb der Globalbesicherung jedoch ausreichend besichert.

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

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

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

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

Basierend auf dem Gesetz zur Umsetzung der zweiten Aktionärsrechterichtlinie (ARUG II) macht die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu § 134c Abs. 4 AktG folgende Angaben:

Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken

Informationen zu den wesentlichen allgemeinen mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens sind im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Risikohinweise“ aufgeführt. Für die konkreten wesentlichen Risiken im Geschäftsjahr verweisen wir auf den Tätigkeitsbericht.

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Die Zusammensetzung des Portfolios und die Portfolioumsätze können der Vermögensaufstellung bzw. den Angaben zu den während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäften, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, entnommen werden. Die Portfolioumsatzkosten werden im Anhang des vorliegenden Jahresberichts ausgewiesen (Transaktionskosten).

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Die Anlageziele und Anlagepolitik des Fonds werden im Tätigkeitsbericht dargestellt. Bei den Anlageentscheidungen werden die mittel- bis langfristigen Entwicklungen der Portfoliogesellschaften berücksichtigt. Dabei soll ein Einklang zwischen den Anlagezielen und Risiken sichergestellt werden.

Einsatz von Stimmrechtsberatern

Zur Einsatz von Stimmrechtsberatern informieren der Mitwirkungsbericht sowie der Stewardship Code der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Dokumente stehen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil> (Corporate Governance).

Handhabung der Wertpapierleihe und Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten

Auf inländischen Hauptversammlungen von börsennotierten Aktiengesellschaften übt die Kapitalverwaltungsgesellschaft das Stimmrecht entweder selbst oder über Stimmrechtsvertreter aus. Verleihe Aktien werden rechtzeitig an die Kapitalverwaltungsgesellschaft zurückübertragen, sodass diese das Stimmrecht auf Hauptversammlungen wahrnehmen kann. Für die in den Sondervermögen befindlichen ausländischen Aktien erfolgt die Ausübung des Stimmrechts insbesondere bei Gesellschaften, die im EURO STOXX 50® oder STOXX Europe 50® vertreten sind, sowie für US-amerikanische und japanische Gesellschaften mit signifikantem Bestand, falls diese Aktien zum Hauptversammlungstermin nicht verliehen sind. Zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften informieren der Stewardship Code und der Mitwirkungsbericht der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die entsprechenden Dokumente stehen Ihnen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil> (Corporate Governance).

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Ermittlung Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste:

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Berichtszeitraum die in den Anteilpreis einfließenden Wertansätze der im Bestand befindlichen Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Berichtszeitraumes mit den Summenpositionen zum Anfang des Berichtszeitraumes die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Auf Grund der Buchungssystematik bei Fonds mit Anteilklassen, wonach täglich die Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste zum Vortag auf Gesamtfondsebene berechnet und entsprechend dem Verhältnis der Anteilklassen zueinander verteilt wird, kann es bei Überwiegen der täglich negativen Veränderungen über die täglich positiven Veränderungen über den Berichtszeitraum innerhalb der Anteilklasse zum Ausweis von negativen nicht realisierten Gewinnen bzw. im umgekehrten Fall zu positiven nicht realisierten Verlusten kommen.

Bei den unter der Kategorie „Nichtnotierte Wertpapiere“ ausgewiesenen unterjährigen Transaktionen kann es sich um börsengehandelte bzw. in den organisierten Markt einbezogene Wertpapiere handeln, deren Fälligkeit mittlerweile erreicht ist und die aus diesem Grund der Kategorie nichtnotierte Wertpapiere zugeordnet wurden.

Die Klassifizierung von Geldmarktinstrumenten erfolgt gemäß Einstufung des Informationsdienstleisters WM Datenservice und kann in Einzelfällen von der Definition in § 194 KAGB abweichen. Insofern können Vermögensgegenstände, die gemäß § 194 KAGB unter Geldmarktinstrumente fallen, in der Vermögensaufstellung außerhalb der Kategorie „Geldmarktpapiere“ ausgewiesen sein.

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

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

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

Name des Produkts:
Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Unternehmenskennung (LEI-Code):
52990077YOW516YQPO53

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja
 Nein

<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 14,27% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



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

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

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum überwiegend in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Investmentanteile (im Folgenden „Zielfonds“), die nach Grundsätzen der Nachhaltigkeit ausgewählt wurden. Bei der Auswahl der Investitionen wurden sowohl ökologische als auch soziale und die verantwortungsvolle Unternehmens- und Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dies erfolgte durch die Anwendung von Ausschlusskriterien sowie einer Analyse und Bewertung der Unternehmen und/oder Staaten anhand von ESG-Kriterien und unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitschancen und -risiken im Rahmen der ESG-Strategie. Die ESG-Strategie zielte darauf ab mindestens 51% des Fondsvermögens

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

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

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

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

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

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

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

Im Rahmen der ESG-Strategie wurden Zielfonds ausgeschlossen,

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

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

Darüber hinaus tätigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungs-Verordnung ((EU) 2019/2088). Mit den nachhaltigen Investitionen wurde angestrebt einen Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen bis 2030 (UN Sustainable Development Goals, SDGs) zu leisten. Die SDGs umfassen 17 Zielsetzungen, die darauf ausgerichtet sind durch eine wirtschaftlich nachhaltige Entwicklung weltweit Armut zu reduzieren und Wohlstand zu fördern. Dabei werden gleichzeitig soziale Bedürfnisse wie Bildung, Gesundheit und Beschäftigung wie auch Klimawandel und Umweltschutz

berücksichtigt. Dies konnte durch direkte Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente oder indirekte Investitionen über Zielfonds in Unternehmen und Staaten erfolgen, die mit ihren (Geschäfts-) Tätigkeiten zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs beitragen. Weitere Details zu den Zielen der nachhaltigen Investitionen sind im Abschnitt „Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“ zu finden.

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

1. Einhaltung der in der Anlagestrategie vereinbarten Ausschlusskriterien

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

2. Ökologische Wirkung

Der Indikator „ökologische Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 41,90 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

Der Indikator berechnet sich aus der Summe der Umsätze der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen in den Geschäftsfeldern alternative Energien, Energieeffizienz, nachhaltiges Bauen, nachhaltige Landwirtschaft, nachhaltige Wasserwirtschaft und Vermeidung von Umweltverschmutzung durch eine Minimierung der Abfallerzeugung, jeweils gewichtet mit dem Anteil der Investition am Fondsvermögen. Dabei handelt es sich um Geschäftsfelder, in denen Produkte oder Dienstleistungen angeboten werden, die zur Erreichung von Umweltzielen (basierend auf den SDGs) beitragen. Es werden sowohl direkte Investitionen in Unternehmen über Aktien und Anleihen als auch indirekte Investitionen über Zielfonds berücksichtigt. Die Gesamtsumme wird mit 1.000 Euro investiertem Kapital ins Verhältnis gesetzt. Die Berechnung des Indikators basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt den Durchschnitt der Datenlage an den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum wider.

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

3. Soziale Wirkung

Der Indikator „soziale Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 51,16 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

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

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

4. Durchschnittlicher MSCI Government ESG Score

Der Indikator „Government ESG Score“ betrug im Berichtszeitraum 6,12.

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

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

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

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

Dazu wurde im Berichtsjahr teilweise direkt und indirekt in Unternehmen investiert, die Produkte oder Dienstleistungen anbieten, die zur Erreichung eines oder mehrerer SDGs beitragen. Dazu

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

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

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

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

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

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

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

Die Auswahl der Emittenten erfolgte unter Berücksichtigung von definierten Schwellenwerten für die einbezogenen PAI-Indikatoren. Dadurch wurden negative Effekte in Bezug auf die nachhaltigen Anlageziele begrenzt. Eine Auflistung der PAI-Indikatoren findet sich im

darauffolgenden Abschnitt „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

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

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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

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

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

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

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

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

- CO₂-Fußabdruck der Unternehmen (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Treibhausgasemissionsintensität der Staaten (PAI 15 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts in Unternehmen, hielten die Unternehmen einen definierten Schwellenwert bei der CO₂-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und Energieverbrauchsintensität ein und waren nicht an der Herstellung oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen beteiligt. Zudem wurden keinem der Unternehmen bei den nachhaltigen Investitionen Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren und/ oder UN Global Compact Verstöße vorgeworfen.

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts in Staaten, hielten die Staaten einen definierten Schwellenwert bei der CO₂-Intensität ein. Zudem verstießen die Staaten bei den nachhaltigen Investitionen nicht gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen und waren deshalb von der EU sanktioniert.

Bei allen nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, überstieg der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck der Unternehmen bzw. die CO₂-Intensität der Staaten im Zielfonds einen festgelegten Schwellenwert nicht. Zudem überstieg der Anteil des Sondervermögens im Zielfonds, das in Unternehmen investiert wurde, die gegen den UN Global Compact verstießen, einen definierten Schwellenwert nicht. Die nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, enthielten zudem keine Unternehmen, die an der Herstellung oder dem Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

Die Messung und Bewertung der PAI der Unternehmen, Staaten und Zielfonds im Anlageuniversum erfolgte unter Verwendung von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Die PAI-Informationen für Unternehmen und Staaten wurden dem Portfoliomanagement des Finanzprodukts zur Berücksichtigung im Investitionsprozess zur Verfügung gestellt.

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

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

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

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

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

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

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

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

Seit dem 01.09.2022 wurde dann nicht mehr in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen investiert, deren CO₂-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und/ oder Energieverbrauchsintensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt. Zudem wurde seit dem 01.09.2022 nicht in Unternehmen investiert, die gegen den UN Global Compact verstießen, denen in den letzten drei Jahren Menschenrechtsverletzungen vorgeworfen wurden und/oder die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren. Darüber hinaus wurde seit dem 01.09.2022 nicht in Staaten investiert, deren CO₂-Intensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt und/ oder die gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen verstießen und deshalb von der EU sanktioniert waren.

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

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

- Treibhausgasemissionen (PAI 1, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- CO₂-Fußabdruck (PAI 2, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (PAI 4, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (PAI 5, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Emissionen in Wasser (PAI 8, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (PAI 9, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (PAI 12, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress (PAI 8, Tabelle 2, (EU) 2022/1288)

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

- CO₂-Fußabdruck (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Treibhausgasemissionsintensität der Länder (PAI 15, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.01.2022 - 31.12.2022

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

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

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares (IE00BYVJRP78)	Zielfonds	7,99%	Irland
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc. (IE00BJK55C48)	Zielfonds	6,73%	Irland
AIS-Amun.Idx US Corp. SRI A.N.UCIT.ETF USD A.N (LU1806495575)	Zielfonds	6,30%	Luxemburg
UBSLFS-MSCI EMU Val.UCITS ETF Inhaber-Ant. A-dis (LU0446734369)	Zielfonds	3,82%	Luxemburg
L&G ESG Em.Mkts Corp.Bd ETF Reg.Shs Dis. (IE00BLRPRF81)	Zielfonds	3,53%	Irland
iShs II-§ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis. (IE00BKFO9C98)	Zielfonds	3,04%	Irland
iShsIV-DL Sh.Dur.Corp Bd U.ETF Reg.Shares (Dist) (IE00BCRY5Y77)	Zielfonds	1,62%	Irland
Koenigreich Spanien Bonos 22/32 (ES0000012K20)	Staatsanleihen	1,57%	Spanien
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B (DK0060534915)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	0,84%	Dänemark
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine (CH0012032048)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	0,79%	Schweiz
SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Reg.Shares (Dist) (IE00B4613386)	Zielfonds	0,77%	Irland
iShsII-EO Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares (IE00BYZTVT56)	Zielfonds	0,72%	Irland
Microsoft Corp. Reg.Shares (US5949181045)	Software & Dienste	0,72%	Vereinigte Staaten
iShsIV-Edge MSCI USA V.F.U.ETF Reg.Shares (IE00BD1F4M44)	Zielfonds	0,70%	Irland
ASML Holding N.V. Aandelen op naam (NL0010273215)	Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	0,70%	Niederlande



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale beitrugen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale) betrug im Berichtszeitraum 87%. Darunter fallen alle Investitionen, die die im Rahmen der verbindlichen Elemente der ESG-Anlagestrategie definierten Ausschlusskriterien des Fonds einhielten.

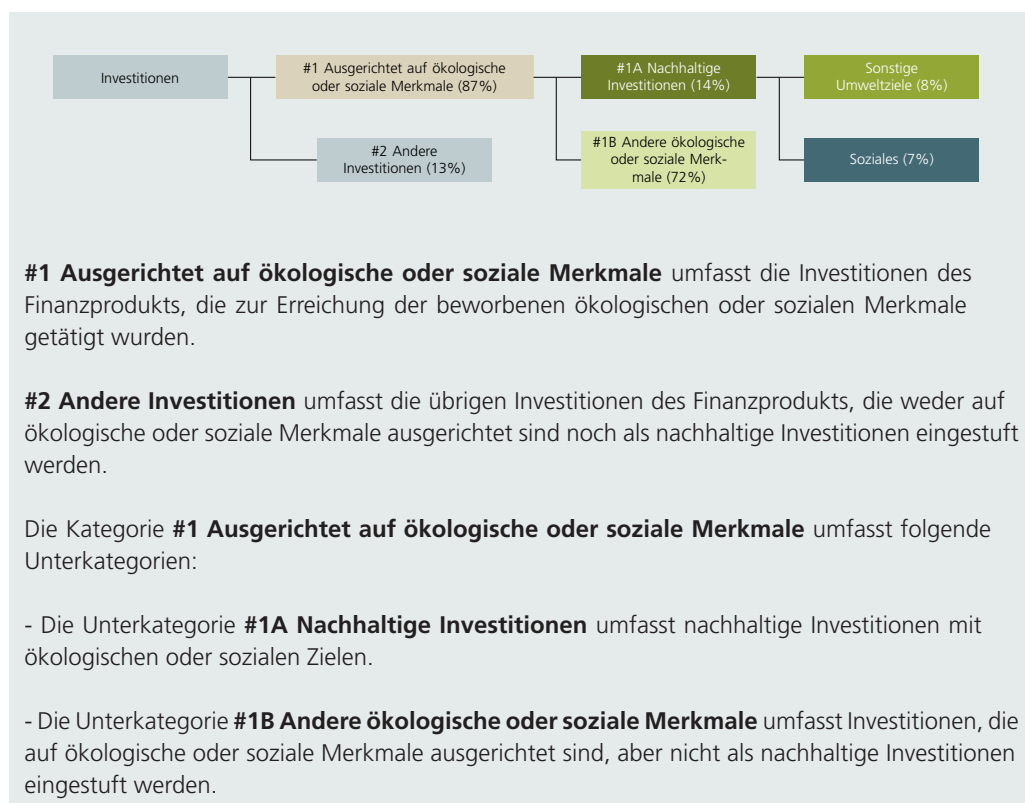
Nachhaltige Investitionen (#2 nachhaltige Investitionen) im Sinne des Artikel 2 Nr.17 der Offenlegungsverordnung ((EU) 2019/2088) sind alle Investitionen des Finanzprodukts in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beitragen, vorausgesetzt, dass diese Investitionen keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Der Anteil nachhaltiger Investitionen betrug im Berichtszeitraum 14%. Dabei wurden sowohl nachhaltige Investitionen mit Umweltziel als auch nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel getätigt.

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen wurde bei Unternehmen auf Basis deren Umsatzes, der zu den SDGs beiträgt, angerechnet. Bei Staaten fand eine Anrechnung zum Anteil der nachhaltigen Investitionen auf Basis deren Nachhaltigkeitsbewertung, die den Fortschritt bei der Erreichung der SDGs misst, (zwischen 0 und 100%) statt. Bei Wertpapieren, deren Mittelverwendung an die Finanzierung von nachhaltigen Wirtschaftsaktivitäten gebunden war

(z.B. Green Bonds, Social Bonds oder Sustainability Bonds), wurde die komplette Investition in das Wertpapier als nachhaltig angerechnet.

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

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



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

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

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

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 5,10% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilspektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC zurückgegriffen. Der Anteil beinhaltet Unternehmen, die Umsätze im Bereich der fossilen Brennstoffe, einschließlich der Förderung, Verarbeitung, Lagerung und dem Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie thermischer und metallurgischer Kohle erwirtschaften.

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

Sektor	Anteil
Basiskonsumgüter	4,64%
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	1,76%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	2,41%
Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	0,47%
Energie	0,51%
Energie	0,51%
Finanzwesen	8,76%
Banken	3,60%
Diversifizierte Finanzdienste	2,37%
Versicherungen	2,79%
Gesundheitswesen	6,92%
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	2,93%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	3,99%
Immobilien	1,29%
Immobilien	1,29%
Industrie	5,84%
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	1,05%
Investitionsgüter	3,56%
Transportwesen	1,23%
Informationstechnologie	3,80%
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	1,84%
Hardware & Ausrüstung	0,31%
Software & Dienste	1,65%
Kommunikationsdienste	2,17%
Medien & Unterhaltung	0,86%
Telekommunikationsdienste	1,31%
Nicht-Basiskonsumgüter	4,58%
Automobile & Komponenten	1,36%
Dienstleistungsunternehmen	0,37%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	1,02%
Groß- und Einzelhandel	1,83%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,39%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,39%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2,08%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2,08%
Sonstige	14,40%
Sonstige	14,40%
Staatsanleihen	5,68%
Staatsanleihen	5,68%
Versorgungsbetriebe	2,12%
Versorgungsbetriebe	2,12%
Zielfonds	36,83%
Zielfonds	36,83%

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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



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

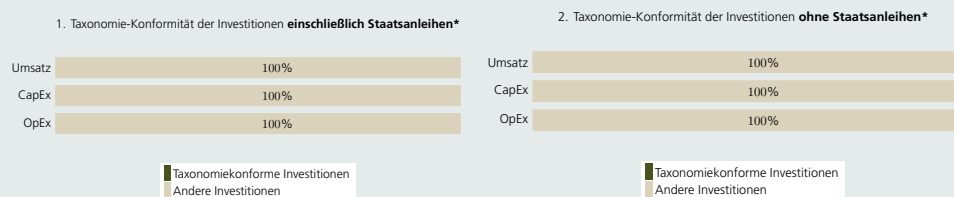
Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht nachweisbar in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu keinem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug demnach 0% (gemessen an den drei Leistungsindikatoren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

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

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

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

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




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

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

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

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

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



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

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

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel betrug 7,53%.

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 6,74%.

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



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

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

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

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



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

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

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

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

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

Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset

Frankfurt am Main, den 11. April 2023
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

An die Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka-Nachhaltigkeit Multi Asset – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Deka Investment GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Deka Investment GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu

verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzu beziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte

Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Deko Investment GmbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Deko Investment GmbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Deko Investment GmbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige

Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Deko Investment GmbH nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 13. April 2023

KPMG AG **Wirtschaftsprüfungsgesellschaft**

Kühn
Wirtschaftsprüfer

Steinbrenner
Wirtschaftsprüfer

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 2021

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;
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Square
Am Flughafen
60549 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. Dezember 2022

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

