

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2024.

## **Deka-ESG Sigma Plus Konservativ**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2024

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

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-ESG Sigma Plus Konservativ für den Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024.

Der Trend rückläufiger Inflationsraten in den vergangenen sechs Monaten stabilisierte die Finanzmärkte und verlieh den Aktienbörsen weiterhin kräftigen Auftrieb. Gleichwohl findet die europäische Wirtschaft nur langsam zurück auf den Aufwärtspfad. Die deutsche Volkswirtschaft wies im ersten Quartal 2024 wieder Erholungstendenzen auf, nachdem das größte EWU-Mitglied 2023 noch als Wachstumsstütze ausgefallen war. Während sich in Europa ein moderates Anziehen der wirtschaftlichen Aktivität abzeichnet, präsentierte sich die Wirtschaftslage in den USA hingegen sehr robust, auch die Schwellenländer wachsen solide. Jedoch sorgten die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken konzentrierte sich weiterhin auf die Inflationsbekämpfung, wobei sich die Hinweise für eine Senkung der Leitzinsen zur Jahresmitte verdichteten. Im ersten Quartal 2024 sorgten allerdings die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und wieder steigende Renditen. Die Fed behielt das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei. Die EZB senkte hingegen den Hauptrefinanzierungssatz im Juni von 4,50 Prozent um 25 Basispunkte auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende Juni bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,4 Prozent. Damit legten die Renditen auf Halbjahressicht zu.

Die globalen Zinssenkungserwartungen waren ein Antriebsfaktor für die Kurse der weltweiten Aktienmärkte, die sich in der Breite in einer freundlichen Verfassung zeigten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten zwischenzeitlich jeweils auf ein Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Die großen US-Technologiewerte mit Bezug zum Trendthema Künstliche Intelligenz verzeichneten dabei die stärksten Zuwächse.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024	7
Anhang	14
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	16

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

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

## Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist es einen mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachs durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und die positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte zu erreichen. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der quantitativ und aktiv gemanagte Fonds weltweit in unterschiedliche Anlageklassen wie Aktien und Anleihen an. Im Rahmen des Wertpapierauswahlprozesses werden neben wirtschaftlichen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien (Ökologie, Soziales und Governance) berücksichtigt. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Aktien, Aktienfonds und Aktienderivate investiert werden darf, beträgt maximal 35%.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen der quantitativen Anlagestrategie "Sigma Plus". Bei dieser werden auf monatlicher Basis die erwarteten Erträge aller relevanten Anlageklassen und Märkte prognostiziert sowie die aktuelle Prognosegüte bewertet. Beides fließt anschließend in ein robustes Optimierungsverfahren ein, worüber die optimale Zusammensetzung des Portfolios auf Ebene der verschiedenen Kategorien von Vermögensgegenständen bestimmt wird. Für die Kategorien Aktien und Unternehmensanleihen folgt danach üblicherweise eine auf einer großen Anzahl von Faktoren basierende Einzeltitelauswahl sowie im Rentenportfolio eine aktive Durationssteuerung. Das Konzept strebt dabei die Erzielung einer stabilen Wertentwicklung mit kontrolliertem Risiko bei gleichzeitigem Fokus auf absoluten Ertrag an. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus. Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten.

### Wichtige Kennzahlen

#### Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

Performance*	6 Monate
	1,6%
ISIN	DE000DK0V6C5

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

Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen. Die Einstufung welche Unternehmen in diesem Sinne kontroverse Geschäftspraktiken anwenden, erfolgt im Rahmen des Investmentprozesses. Unternehmen, die kontroverse Waffen herstellen, werden grundsätzlich aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Nicht investiert wird zudem in Staaten, die nach dem Freedom-House Index als "unfrei" ("not free") eingestuft werden und/oder nach dem Corruption-Perceptions-Index einen Score von weniger als 40 aufweisen. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens "BBB" oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

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

Dieser Investmentfonds darf mehr als 35% des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland, der deutschen Bundesländer, der Europäischen Union, der Mitgliedstaaten der Europäischen Union, der Vereinigten Staaten von Amerika und der Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) investieren.

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

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>24.697.391,84</b>	<b>31,41</b>
Australien	332.889,97	0,42
Belgien	139.208,12	0,18
Dänemark	353.066,03	0,45
Deutschland	749.195,84	0,94
Finnland	99.434,65	0,13
Frankreich	720.650,91	0,92
Großbritannien	818.043,04	1,03
Irland	422.553,17	0,54
Israel	90.794,45	0,12
Italien	534.435,50	0,67
Japan	1.118.355,23	1,42
Kanada	693.905,91	0,88
Liberia	26.806,50	0,03
Neuseeland	55.871,72	0,07
Niederlande	463.038,31	0,59
Schweden	401.071,44	0,51
Schweiz	510.018,75	0,64
Spanien	296.823,97	0,38
USA	16.871.228,33	21,49
<b>2. Anleihen</b>	<b>21.656.429,48</b>	<b>27,54</b>
Deutschland	5.945.248,00	7,57
Frankreich	3.122.396,50	3,97
Großbritannien	1.181.407,17	1,50
Italien	1.244.412,00	1,58
Spanien	1.140.474,00	1,45
USA	9.022.491,81	11,47
<b>3. Investmentanteile</b>	<b>30.056.543,30</b>	<b>38,24</b>
Deutschland	13.885.671,00	17,66
Irland	9.510.138,54	12,10
Luxemburg	6.660.733,76	8,48
<b>4. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>56.080,06</b>	<b>0,07</b>
Schweiz	56.080,06	0,07
<b>5. Derivate</b>	<b>-391.811,05</b>	<b>-0,48</b>
<b>6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>2.130.308,26</b>	<b>2,71</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>486.848,97</b>	<b>0,62</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-83.251,38</b>	<b>-0,11</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>78.608.539,48</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>24.697.391,84</b>	<b>31,41</b>
AUD	351.163,45	0,44
CAD	693.905,91	0,88
CHF	407.632,56	0,51
DKK	353.066,03	0,45
EUR	2.959.073,48	3,75
GBP	874.691,56	1,10
JPY	1.118.355,23	1,42
NZD	55.871,72	0,07
SEK	401.071,44	0,51
USD	17.482.560,46	22,28
<b>2. Anleihen</b>	<b>21.656.429,48</b>	<b>27,54</b>
EUR	11.452.530,50	14,57
GBP	1.181.407,17	1,50
USD	9.022.491,81	11,47
<b>3. Investmentanteile</b>	<b>30.056.543,30</b>	<b>38,24</b>
EUR	27.063.333,97	34,43
USD	2.993.209,33	3,81
<b>4. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>56.080,06</b>	<b>0,07</b>
CHF	56.080,06	0,07
<b>5. Derivate</b>	<b>-391.811,05</b>	<b>-0,48</b>
<b>6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>2.130.308,26</b>	<b>2,71</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>486.848,97</b>	<b>0,62</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-83.251,38</b>	<b>-0,11</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>78.608.539,48</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>38.884.020,36</b>	<b>49,45</b>
<b>Aktien</b>								<b>24.697.391,84</b>	<b>31,41</b>
<b>EUR</b>								<b>2.959.073,48</b>	<b>3,75</b>
IT0001233417	A2A S.p.A. Azioni nom.	STK		61.431	0	0	EUR 1,870	114.875,97	0,15
BE0974264930	AGEAS SA/NV Actions Nominatives	STK		1.847	1.847	0	EUR 42,740	78.940,78	0,10
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		2.629	0	1.199	EUR 27,750	72.954,75	0,09
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		448	0	153	EUR 261,700	117.241,60	0,15
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK		166	49	78	EUR 969,700	160.970,20	0,20
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK		4.449	0	0	EUR 23,500	104.551,50	0,13
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		3.291	0	1.233	EUR 30,570	100.605,87	0,13
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		11.570	0	0	EUR 9,340	108.063,80	0,14
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom.	STK		17.100	0	0	EUR 4,348	74.350,80	0,09
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien	STK		984	0	0	EUR 83,000	81.672,00	0,10
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK		1.706	0	669	EUR 59,800	102.018,80	0,13
ES0140609019	Caixabank S.A. Acciones Port.	STK		22.983	9.613	0	EUR 4,978	114.409,37	0,15
FR0000125338	Cappemini SE Actions Port.	STK		476	0	191	EUR 185,700	88.393,20	0,11
NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam	STK		4.774	0	0	EUR 9,512	45.410,29	0,06
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur	STK		1.073	0	562	EUR 73,200	78.543,60	0,10
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		4.063	4.063	0	EUR 23,510	95.521,13	0,12
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		7.667	0	3.156	EUR 12,410	95.147,47	0,12
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK		817	0	339	EUR 86,620	70.768,54	0,09
FR0000121147	Forvia SE Actions Port.	STK		1.543	1.543	0	EUR 11,265	17.381,90	0,02
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien	STK		690	690	0	EUR 83,100	57.339,00	0,07
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK		1.635	0	1.775	EUR 34,660	56.669,10	0,07
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK		18.714	0	0	EUR 3,508	65.648,71	0,08
FR0010259150	Ipsen S.A. Actions au Porteur	STK		787	0	0	EUR 114,600	90.190,20	0,11
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK		22.502	0	0	EUR 3,575	80.444,65	0,10
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Action Port.(C.R.)	STK		40	0	61	EUR 712,900	28.516,00	0,04
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK		5.977	0	2.720	EUR 13,695	81.855,02	0,10
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK		8.890	8.890	0	EUR 11,185	99.434,65	0,13
IT0004176001	Prismian S.p.A. Azioni nom.	STK		2.043	0	0	EUR 57,680	117.840,24	0,15
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		1.164	0	380	EUR 100,200	116.632,80	0,15
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK		457	457	0	EUR 188,620	86.199,34	0,11
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK		765	0	0	EUR 175,140	133.982,10	0,17
BE0003470755	Solvay S.A. Actions au Porteur A	STK		511	0	0	EUR 32,800	16.760,80	0,02
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A. Actions Port.	STK		150	0	0	EUR 184,000	27.600,00	0,04
NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen op naam	STK		3.227	0	1.466	EUR 18,452	59.544,60	0,08
BE0974464977	Syensqo S.A. Actions au Porteur	STK		511	0	0	EUR 85,140	43.506,54	0,06
DE0008303504	TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien	STK		1.845	1.845	0	EUR 13,780	25.424,10	0,03
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom.	STK		1.436	0	0	EUR 34,585	49.664,06	0,06
<b>AUD</b>								<b>351.163,45</b>	<b>0,44</b>
AU000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK		8.322	0	0	AUD 20,430	105.430,94	0,13
AU00000030678	Coles Group Ltd. Reg.Shares	STK		7.333	7.333	0	AUD 17,030	77.440,53	0,10
AU000000FMG4	Fortescue Ltd. Reg.Shares	STK		5.938	5.938	0	AUD 21,410	78.836,78	0,10
AU000000GPT8	GPT Group Reg.Units	STK		28.697	0	0	AUD 4,000	71.181,72	0,09
AU000000JHX1	James Hardie Industries PLC Reg.Shares (CUFS)	STK		623	623	0	AUD 47,300	18.273,48	0,02
<b>CAD</b>								<b>693.905,91</b>	<b>0,88</b>
CA11271J1075	Brookfield Corp. Reg.Shares CIA	STK		1.700	0	0	CAD 56,950	66.013,90	0,08
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs CIA (Sub.Vtg)	STK		1.400	0	300	CAD 137,440	131.200,03	0,17
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK		14	0	0	CAD 3.927,500	37.491,86	0,05
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares	STK		900	0	0	CAD 159,110	97.641,12	0,12
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK		4.700	0	0	CAD 36,290	116.299,43	0,15
CA67077M1086	Nutrien Ltd Reg.Shares	STK		1.300	1.300	0	CAD 71,160	63.077,15	0,08
CA6837151068	Open Text Corp. Reg.Shares	STK		1.400	0	0	CAD 40,860	39.004,90	0,05
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK		1.500	0	0	CAD 67,010	68.536,77	0,09
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK		900	0	0	CAD 121,630	74.640,75	0,09
<b>CHF</b>								<b>407.632,56</b>	<b>0,51</b>
CH0025751329	Logitech International S.A. Namens-Aktien	STK		896	896	0	CHF 87,500	81.472,74	0,10
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK		569	0	524	CHF 92,340	54.600,73	0,07
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		1.427	697	406	CHF 96,120	142.539,10	0,18
CH0024638196	Schindler Holding AG Inhaber-Partizipationsschein	STK		335	335	0	CHF 226,400	78.816,57	0,10
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK		100	0	72	CHF 483,100	50.203,42	0,06
<b>DKK</b>								<b>353.066,03</b>	<b>0,45</b>
DK00062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		1.863	0	311	DKK 999,800	249.743,89	0,32
DK0010219153	Rockwool A/S Navne-Aktier B	STK		276	276	0	DKK 2.792,000	103.322,14	0,13
<b>GBP</b>								<b>874.691,56</b>	<b>1,10</b>
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares	STK		1.294	0	0	GBP 31,080	47.537,03	0,06
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares	STK		765	0	0	GBP 124,160	112.269,02	0,14
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien	STK		3.194	1.090	0	GBP 27,120	102.386,19	0,13
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares	STK		7.680	0	0	GBP 15,305	138.934,90	0,18
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC Reg.Shares	STK		3.604	3.604	0	GBP 18,840	80.256,92	0,10
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Reg.Shares	STK		7.162	7.162	0	GBP 6,920	58.581,06	0,07

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
GB00B06QFB75	IG Group Holdings PLC Reg.Shares		STK	4.836	0	0	GBP 8,210	46.929,54	0,06
GB00BLDRH360	OSB GROUP PLC Reg.Shares		STK	7.304	0	0	GBP 4,378	37.796,65	0,05
GB00BLGZ9862	Tesco PLC Reg.Shs		STK	22.227	0	0	GBP 3,092	81.233,86	0,10
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares		STK	1.433	0	1.250	GBP 43,660	73.951,46	0,09
GB00B1KJJ408	Whitbread PLC Reg.Shares		STK	2.690	0	0	GBP 29,820	94.814,93	0,12
<b>JPY</b>								<b>1.118.355,23</b>	<b>1,42</b>
JP3486800000	Daito Trust Constr. Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.100	0	0	JPY 16.585,000	105.959,05	0,13
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Reg.Shares		STK	6.000	5.400	0	JPY 2.517,000	87.713,08	0,11
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Reg.Shares		STK	7.300	0	0	JPY 1.720,000	72.925,80	0,09
JP3837800006	Hoya Corp. Reg.Shares		STK	900	400	0	JPY 18.705,000	97.775,52	0,12
JP3684000007	Nitto Denko Corp. Reg.Shares		STK	800	0	0	JPY 12.710,000	59.056,19	0,08
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares		STK	4.000	0	0	JPY 2.196,500	51.029,48	0,06
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares		STK	4.400	0	0	JPY 3.552,000	90.772,76	0,12
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.074	0	2.026	JPY 6.238,000	38.911,64	0,05
JP3347200002	Shionogi & Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.700	1.700	0	JPY 6.277,000	61.977,06	0,08
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares		STK	5.400	3.600	800	JPY 3.435,000	107.733,41	0,14
JP3814800003	Subaru Corp. Reg.Shares		STK	2.800	2.800	0	JPY 3.410,000	55.455,21	0,07
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares		STK	4.500	0	1.500	JPY 6.005,000	156.947,87	0,20
JP3633400001	Toyota Motor Corp. Reg.Shares		STK	4.000	4.000	0	JPY 3.290,000	76.433,86	0,10
JP3659000008	West Japan Railway Co. Reg.Shares		STK	3.200	1.600	900	JPY 2.995,000	55.664,30	0,07
<b>NZD</b>								<b>55.871,72</b>	<b>0,07</b>
NZTELE000154	Spark New Zealand Ltd. Reg.Shares		STK	23.679	0	0	NZD 4,160	55.871,72	0,07
<b>SEK</b>								<b>401.071,44</b>	<b>0,51</b>
SE0017486897	Atlas Copco AB Namn-Aktier B (fria)		STK	6.833	0	0	SEK 171,500	102.854,69	0,13
SE0000379190	Castellum AB Namn-Aktier		STK	1.911	1.911	0	SEK 128,900	216.202,32	0,03
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria)		STK	2.710	0	2.540	SEK 156,300	37.177,21	0,05
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A		STK	8.371	0	0	SEK 101,100	74.280,88	0,09
SE0000114837	Trelleborg AB Namn-Aktier B (fria)		STK	4.081	0	0	SEK 410,000	146.858,47	0,19
SE0021628898	Volvo Car AB Namn-Aktier B		STK	6.340	6.340	0	SEK 32,850	18.279,87	0,02
<b>USD</b>								<b>17.482.560,46</b>	<b>22,28</b>
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares		STK	1.509	0	0	USD 104,650	147.613,43	0,19
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	873	309	0	USD 168,990	137.902,66	0,18
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A		STK	515	0	140	USD 303,190	145.955,18	0,19
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares		STK	329	0	61	USD 546,760	168.147,35	0,21
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares		STK	1.208	0	595	USD 89,160	100.677,96	0,13
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares		STK	700	0	0	USD 130,800	85.586,09	0,11
US00971T1016	Akamai Technologies Inc. Reg.Shares		STK	849	0	0	USD 89,940	71.376,95	0,09
IE00BFR3W74	Allegion PLC Reg.Shares		STK	843	0	0	USD 116,320	91.659,90	0,12
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C		STK	2.757	639	295	USD 186,860	481.560,12	0,61
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	3.088	417	450	USD 185,410	535.189,83	0,68
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares		STK	3.340	0	591	USD 197,850	617.703,31	0,79
US0311001004	AMETEK Inc. Reg.Shares		STK	642	0	0	USD 166,470	99.900,67	0,13
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	351	0	0	USD 313,690	102.921,28	0,13
IE00BLPHHW54	AON PLC Reg.Shares A		STK	317	0	0	USD 292,800	86.761,64	0,11
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	6.609	0	1.426	USD 214,100	1.322.664,89	1,68
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares		STK	365	0	0	USD 232,530	79.335,81	0,10
US0527691069	Autodesk Inc. Reg.Shares		STK	242	0	0	USD 243,680	55.122,98	0,07
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	529	0	0	USD 237,300	117.341,28	0,15
US0533321024	AutoZone Inc. Reg.Shares		STK	28	0	17	USD 2.955,400	77.352,03	0,10
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares		STK	3.081	0	0	USD 39,250	113.039,12	0,14
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares		STK	1.364	0	0	USD 84,320	107.508,39	0,14
US09247X1019	Blackrock Inc. Reg.Shares		STK	120	0	0	USD 781,130	87.619,74	0,11
US0936711052	Block H. & R. Inc. Reg.Shares		STK	1.156	0	855	USD 53,530	57.843,22	0,07
US09857L1089	Booking Holdings Inc. Reg.Shares		STK	10	25	29	USD 4.009,400	37.478,03	0,05
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	2.278	0	0	USD 41,510	88.390,15	0,11
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares		STK	222	0	38	USD 1.586,660	329.256,42	0,42
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)		STK	997	0	0	USD 87,730	81.759,96	0,10
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	509	0	0	USD 307,920	146.505,22	0,19
US14149Y1082	Cardinal Health Inc. Reg.Shares		STK	653	0	0	USD 99,620	60.807,50	0,08
US14448C1045	Carrier Global Corp. Reg.Shares		STK	2.233	0	0	USD 63,230	131.980,36	0,17
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares		STK	431	0	0	USD 327,460	131.926,77	0,17
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares		STK	542	0	0	USD 170,220	86.239,71	0,11
US03073E1055	Cencora Inc. Reg.Shares		STK	292	0	0	USD 227,960	62.221,28	0,08
US15135B1017	Centene Corp. Reg.Shares		STK	993	993	0	USD 67,370	62.533,57	0,08
IL0010824113	Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares		STK	597	0	0	USD 162,700	90.794,45	0,12
US1729081059	Cintas Corp. Reg.Shares		STK	36	36	0	USD 711,640	23.947,50	0,03
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	3.888	0	745	USD 47,450	172.448,68	0,22
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC Reg.Shares		STK	664	0	911	USD 73,690	45.737,67	0,06
US1924461023	Cognizant Technology Sol.Corp. Reg.Shs Cl.A		STK	1.575	0	0	USD 67,730	99.714,67	0,13
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A		STK	2.461	0	0	USD 38,280	88.060,46	0,11
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares		STK	230	0	132	USD 280,490	60.303,51	0,08
US2435371073	Deckers Outdoor Corp. Reg.Shares		STK	61	0	0	USD 999,910	57.014,87	0,07
US2441991054	Deere & Co. Reg.Shares		STK	334	0	0	USD 376,790	117.636,81	0,15
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	4.874	0	0	USD 22,420	102.145,34	0,13
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	310	0	0	USD 535,770	155.252,10	0,20
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares		STK	283	78	62	USD 909,040	240.473,28	0,31

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares		STK	920	0	0	USD 125,990	108.348,10	0,14
US3032501047	Fair Isaac Corp. Reg.Shares		STK	126	0	0	USD 1.477,510	174.019,69	0,22
US3377381088	Fiserv Inc. Reg.Shares		STK	559	0	0	USD 149,080	77.898,41	0,10
US34964C1062	Fortune Brands Innovations Inc. Reg.Shares		STK	892	892	0	USD 65,470	54.588,93	0,07
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	230	0	91	USD 444,770	95.622,64	0,12
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares		STK	1.423	0	0	USD 63,710	84.744,19	0,11
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	1.894	0	0	USD 68,830	121.858,31	0,16
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	272	0	0	USD 343,290	87.282,56	0,11
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares		STK	4.508	0	0	USD 21,040	88.659,86	0,11
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	1.577	0	0	USD 74,210	109.393,50	0,14
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares		STK	3.197	0	0	USD 34,710	103.727,68	0,13
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares		STK	139	0	0	USD 362,980	47.162,29	0,06
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares		STK	923	0	3.945	USD 30,590	26.392,38	0,03
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares		STK	864	426	0	USD 170,850	137.983,17	0,18
US4612021034	Intuit Inc. Reg.Shares		STK	120	0	0	USD 651,440	73.072,35	0,09
US4663131039	Jabil Inc. Reg.Shares		STK	416	0	0	USD 107,920	41.965,53	0,05
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	1.472	0	0	USD 145,800	200.614,69	0,26
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	1.263	0	0	USD 199,170	235.139,01	0,30
US4878361082	Kellanova Co. Reg.Shares		STK	1.174	0	0	USD 57,680	63.298,11	0,08
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares		STK	749	0	0	USD 139,350	97.563,24	0,12
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares		STK	80	0	0	USD 1.055,830	78.955,32	0,10
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares		STK	244	0	0	USD 542,690	123.776,74	0,16
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares		STK	273	0	299	USD 219,800	56.090,30	0,07
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A		STK	488	0	0	USD 95,830	43.713,82	0,06
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	778	0	0	USD 210,940	153.403,74	0,20
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares		STK	1.853	0	0	USD 66,400	115.011,40	0,15
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A		STK	361	0	0	USD 442,750	149.404,33	0,19
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares		STK	310	0	0	USD 258,170	74.810,90	0,10
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	223	0	78	USD 593,200	123.652,65	0,16
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	1.307	0	1.093	USD 129,820	158.604,17	0,20
US30303M1027	Meta Platforms Inc. Reg.Shares CIA		STK	257	257	0	USD 519,560	124.814,84	0,16
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	70	0	0	USD 1.406,520	92.032,53	0,12
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	3.043	236	724	USD 452,850	1.288.112,31	1,64
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	391	0	0	USD 302,830	101.681,00	0,14
US6703461052	Nucor Corp. Reg.Shares		STK	441	0	0	USD 154,710	63.775,57	0,08
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares		STK	9.910	9.031	179	USD 123,990	1.148.570,67	1,46
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	601	0	257	USD 171,870	96.554,37	0,12
US6951561090	Packaging Corp. of America Reg.Shares		STK	296	0	0	USD 183,190	50.686,33	0,06
US7010941042	Parker-Hannifin Corp. Reg.Shares		STK	255	0	0	USD 504,220	120.187,04	0,15
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares		STK	634	0	0	USD 117,840	69.836,01	0,09
IE00BLS09M33	Pentair PLC Reg.Shares		STK	1.124	1.124	0	USD 76,050	79.902,97	0,10
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares		STK	451	0	0	USD 166,260	70.090,91	0,09
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares		STK	837	0	0	USD 109,750	85.867,22	0,11
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares		STK	598	0	179	USD 195,150	109.085,53	0,14
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares		STK	187	0	625	USD 137,340	24.006,90	0,03
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	88	41	0	USD 1.050,860	86.442,03	0,11
US7595091023	Reliance Inc. Reg.Shares		STK	209	0	133	USD 280,640	54.826,85	0,07
US7703231032	Robert Half Inc. Reg.Shares		STK	1.429	0	0	USD 63,480	84.794,28	0,11
US776961061	Roper Technologies Inc. Reg.Shares		STK	283	0	0	USD 562,060	148.684,78	0,19
LR0008862868	Royal Caribbean Cruises Ltd. Reg.Shares		STK	179	179	0	USD 160,210	26.806,50	0,03
US79466L3024	Salesforce Inc. Reg.Shares		STK	514	324	0	USD 252,850	121.485,23	0,15
US81762P1021	ServiceNow Inc. Reg.Shares		STK	93	0	0	USD 774,130	67.296,78	0,09
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares		STK	410	0	0	USD 258,910	99.227,05	0,13
US858191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares		STK	1.313	0	0	USD 125,050	153.477,89	0,20
US8636671013	Stryker Corp. Reg.Shares		STK	219	219	0	USD 340,540	69.712,34	0,09
US8716071076	Synopsys Inc. Reg.Shares		STK	289	0	0	USD 595,000	160.735,65	0,20
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares		STK	1.262	0	0	USD 115,430	136.168,12	0,17
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares		STK	765	0	0	USD 197,420	141.172,46	0,18
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares		STK	898	0	0	USD 193,430	162.366,93	0,21
US1255231003	The Cigna Group Reg.Shares		STK	259	0	0	USD 334,150	80.898,16	0,10
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares		STK	2.023	0	0	USD 63,910	120.854,30	0,15
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	587	0	0	USD 341,490	187.375,80	0,24
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	1.282	0	245	USD 166,620	199.669,88	0,25
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares		STK	173	0	0	USD 550,780	89.067,99	0,11
US90384S3031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares		STK	290	0	0	USD 385,950	104.622,83	0,13
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	463	0	0	USD 486,440	210.526,94	0,27
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	3.453	0	1.011	USD 40,820	131.754,96	0,17
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	333	0	139	USD 472,510	147.079,67	0,19
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares CIA		STK	590	0	155	USD 266,590	147.025,71	0,19
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	123	0	0	USD 903,740	103.907,29	0,13
US94106L1098	Waste Management Inc. Reg.Shares		STK	509	0	183	USD 212,670	101.186,23	0,13
US9553061055	West Pharmaceutical Services Inc. Reg.Shares		STK	312	312	0	USD 328,760	95.880,65	0,12
US9598021098	Western Union Co. Reg.Shares		STK	6.294	0	3.318	USD 12,000	70.600,11	0,09
US9699041011	Williams-Sonoma Inc. Reg.Shares		STK	79	79	0	USD 287,300	21.215,83	0,03
US98138H1014	Workday Inc. Reg.Shares A		STK	128	0	0	USD 223,360	26.724,70	0,03
US98956P1021	Zimmer Biomet Holdings Inc. Reg.Shares		STK	517	0	0	USD 108,380	52.376,58	0,07
US98980L1017	Zoom Video Communications Inc. Reg.Sh. CIA		STK	1.358	581	0	USD 58,470	74.221,59	0,09
<b>Verzinsliche Wertpapiere EUR</b>								<b>14.130.548,46</b>	<b>17,97</b>
								<b>11.452.530,50</b>	<b>14,57</b>



# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
DE0001102606	1,7000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/32 <sup>1)</sup>		EUR	3.300.000	0	700.000	% 94,951	3.133.383,00	3,99
ES0000012K61	2,5500 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32		EUR	1.200.000	0	0	% 95,040	1.140.474,00	1,45
DE000A2NB9V2	0,1000 % Land Berlin Landessch. Ausg.514 19/30		EUR	1.100.000	0	900.000	% 85,703	942.733,00	1,20
DE000NRW2111	2,0000 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1247 13/25		EUR	1.400.000	0	0	% 98,348	1.376.872,00	1,75
DE000NRW0FU3	1,2500 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1325 14/25		EUR	500.000	0	0	% 98,452	492.260,00	0,63
FR0011461037	3,2500 % Rep. Frankreich OAT 13/45		EUR	1.800.000	1.800.000	0	% 94,875	1.707.750,00	2,17
FR0013313582	1,2500 % Rep. Frankreich OAT 17/34		EUR	1.700.000	0	0	% 83,215	1.414.646,50	1,80
IT0005518128	4,4000 % Republik Italien B.T.P. 22/33		EUR	1.200.000	0	0	% 103,701	1.244.412,00	1,58
<b>GBP</b>								<b>1.181.407,17</b>	<b>1,50</b>
GB0032452392	4,2500 % Großbritannien Treasury Stock 03/36		GBP	1.000.000	0	0	% 99,950	1.181.407,17	1,50
<b>USD</b>								<b>1.496.610,79</b>	<b>1,90</b>
US912810FP85	5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31		USD	1.500.000	0	0	% 106,738	1.496.610,79	1,90
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>								<b>56.080,06</b>	<b>0,07</b>
<b>CHF</b>								<b>56.080,06</b>	<b>0,07</b>
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	215	0	0	CHF 251,000	56.080,06	0,07
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>7.525.881,02</b>	<b>9,57</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>7.525.881,02</b>	<b>9,57</b>
<b>USD</b>								<b>7.525.881,02</b>	<b>9,57</b>
US912810RM27	3,0000 % U.S. Treasury Bonds 15/45		USD	3.000.000	3.000.000	0	% 78,973	2.214.600,56	2,82
US912828U246	2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26		USD	300.000	0	0	% 94,133	263.973,12	0,34
US91282CGA36	4,0000 % U.S. Treasury Notes 22/25		USD	3.000.000	0	500.000	% 98,715	2.768.223,33	3,52
US91282CGP05	4,0000 % U.S. Treasury Notes 23/28		USD	2.000.000	0	500.000	% 98,598	1.843.291,39	2,34
US91282CHC82	3,3750 % U.S. Treasury Notes S.C.-2033 23/33		USD	500.000	0	700.000	% 93,242	435.792,62	0,55
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>30.056.543,30</b>	<b>38,24</b>
<b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>13.885.671,00</b>	<b>17,66</b>
<b>EUR</b>								<b>13.885.671,00</b>	<b>17,66</b>
DE000ETF599	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	137.900	4.000	22.100	EUR 87,950	12.128.305,00	15,42
DE0005424568	Deka-Vega Plus I (A)		ANT	25.700	0	0	EUR 68,380	1.757.366,00	2,24
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>4.597.176,32</b>	<b>5,85</b>
<b>EUR</b>								<b>4.597.176,32</b>	<b>5,85</b>
LU1685588219	Deka-MultiFactor Global Corporates I		ANT	7.403	0	0	EUR 83,440	617.706,32	0,79
LU1685587591	Deka-MultiFactor Global Corporates HY I		ANT	46.500	0	0	EUR 85,580	3.979.470,00	5,06
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>11.573.695,98</b>	<b>14,73</b>
<b>EUR</b>								<b>8.580.486,65</b>	<b>10,92</b>
IE00BH4G7D40	iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shs Hgd Dis.		ANT	1.850.000	270.000	320.000	EUR 4,014	7.425.530,00	9,45
IE00BKL5874	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	259.500	50.000	60.000	EUR 4,451	1.154.956,65	1,47
<b>USD</b>								<b>2.993.209,33</b>	<b>3,81</b>
IE00BK09C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	222.100	100.000	100.000	USD 4,478	929.651,89	1,18
LU1974695790	UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.BUE Act. Nom.A-acc.		ANT	172.300	68.900	74.700	USD 12,813	2.063.557,44	2,63
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>76.466.444,68</b>	<b>97,26</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>-24.969,82</b>	<b>-0,03</b>
DJ Euro Stoxx 50 Index (STXE) Sep.24		XEUR	EUR	Anzahl -28				-15.540,00	-0,02
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) Sep. 24		XIOM	USD	Anzahl 2				6.535,80	0,01
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) Sep. 24		XCME	USD	Anzahl 5				-677,70	0,00
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 24		XCME	USD	Anzahl -17				-34.165,26	-0,04
ESTX Mid Index Future (FMCE) Sep. 24		XEUR	EUR	Anzahl 14				-4.410,00	-0,01
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 24		IFEU	GBP	Anzahl -1				-520,08	0,00
MDAX Mini Future (FSMX) Sep. 24		XEUR	EUR	Anzahl 12				-5.129,88	-0,01
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) Sep. 24		IFUS	USD	Anzahl 45				32.809,87	0,04
OMX Index Future (O30) Juli 24		XNDX	SEK	Anzahl -11				-9,65	0,00
OMXC25 Index Future (OMW) Juli 24		XNDX	DKK	Anzahl -4				-606,05	0,00
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 24		XMOD	CAD	Anzahl -1				-2.109,66	0,00
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 24		XSFE	AUD	Anzahl -1				-1.147,21	0,00
<b>Optionsrechte</b>								<b>-20.061,07</b>	<b>-0,02</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>								<b>-20.061,07</b>	<b>-0,02</b>
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juli 24 4900		XEUR		Anzahl -42			EUR 77,000	-32.340,00	-0,04
S & P 500 Index (S500) Put Juli 24 5450		XCBO		Anzahl 4			USD 32,840	12.278,93	0,02
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-45.030,89</b>	<b>-0,05</b>

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Zins-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Zinsterminkontrakte</b>										
								<b>-105.179,63</b>	<b>-0,13</b>	
	10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 24	XEUR	EUR	300.000				-1.126,42	0,00	
	EURO Bund Future (FGBL) Sep. 24	XEUR	EUR	-2.000.000				-36.521,72	-0,05	
	EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 24	XEUR	EUR	-200.000				-840,00	0,00	
	EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 24	XEUR	EUR	300.000				-3.840,00	0,00	
	Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 24	XCBT	USD	-400.000				-2.658,21	0,00	
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 24	XEUR	EUR	-3.300.000				24.146,37	0,03	
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 24	XCBT	USD	-6.400.000				-59.619,78	-0,08	
	Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 24	XCBT	USD	-400.000				-847,13	0,00	
	Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (LXY) Sep. 24	XCBT	USD	-100.000				-1.489,76	0,00	
	US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 24	XCBT	USD	-1.000.000				-22.382,98	-0,03	
	<b>Summe Zins-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-105.179,63</b>	<b>-0,13</b>	
<b>Devisen-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>										
<b>Offene Positionen</b>										
	CAD/EUR 370.000,00		OTC					-3.908,62	0,00	
	GBP/EUR 1.200.000,00		OTC					-9.703,99	-0,01	
	JPY/EUR 10.000.000,00		OTC					981,21	0,00	
	SEK/EUR 3.000.000,00		OTC					2.310,90	0,00	
	USD/EUR 14.200.000,00		OTC					-231.280,03	-0,29	
	<b>Summe Devisen-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-241.600,53</b>	<b>-0,30</b>	
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.178.239,45			%	100,000	1.178.239,45	1,50
<b>EUR-Guthaben bei</b>										
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	15.836,41			%	100,000	15.836,41	0,02
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	725.613,89			%	100,000	97.291,40	0,12
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	143.193,35			%	100,000	12.532,24	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	347.277,40			%	100,000	30.480,71	0,04
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	40.727,24			%	100,000	25.255,56	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	225.770,88			%	100,000	153.943,26	0,20
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	15.828,42			%	100,000	16.448,79	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	92.042,70			%	100,000	108.794,30	0,14
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	401.908,33			%	100,000	48.111,42	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	38.888.855,00			%	100,000	225.868,19	0,29
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	19.786,94			%	100,000	11.223,13	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	220.681,98			%	100,000	206.283,40	0,26
	<b>Summe Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>2.130.308,26</b>	<b>2,71</b>	
	<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>						<b>EUR</b>	<b>2.130.308,26</b>	<b>2,71</b>	
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
	Zinsansprüche		EUR	192.594,84				192.594,84	0,25	
	Dividendenansprüche		EUR	15.957,84				15.957,84	0,02	
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	140,53				140,53	0,00	
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	18.155,76				18.155,76	0,02	
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	260.000,00				260.000,00	0,33	
	<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>486.848,97</b>	<b>0,62</b>	
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-46,36				-46,36	0,00	
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften		EUR	-29.893,14				-29.893,14	-0,04	
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-53.311,88				-53.311,88	-0,07	
	<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-83.251,38</b>	<b>-0,11</b>	
<b>Fondsvermögen</b>										
	<b>Umlaufende Anteile</b>						<b>EUR</b>	<b>78.608.539,48</b>	<b>100,00</b>	
	<b>Anteilwert</b>						<b>STK</b>	<b>804.520,000</b>		
							<b>EUR</b>	<b>97,71</b>		

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

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
<b>Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)</b>				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
17000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/32	EUR	2.500.000	2.373.775,00	
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>	<b>EUR</b>		<b>2.373.775,00</b>	<b>2.373.775,00</b>

Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 1.376.872,00

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2024

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,84603	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45815	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,42600	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,39335	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,96229	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06980	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46659	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	172,17500	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,35370	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,61261	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,76305	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XIOM	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Option Market (IOM)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
IFUS	New York/N.Y. - ICE Futures U.S.
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options
XNDX	Stockholm - Nasdaq Stockholm - Derivatives

### OTC

Over-the-Counter

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>AUD</b>				
AU000000MGR9	Mirvac Group Reg.Stapled Units	STK	0	73.755
<b>CAD</b>				
CA11284V1058	Brookfield Renewable Corp. Reg.Shs Cl.A Sub.Vot.	STK	0	4.400
CA3759161035	Gildan Activewear Inc. Reg.Shares (Sub.Vtg)	STK	0	3.500
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)	STK	0	2.700
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK	0	1.200
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.500
<b>DKK</b>				
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK	0	49
<b>EUR</b>				
AT0000730007	Andritz AG Inhaber-Aktien	STK	0	2.057
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK	0	2.447
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien	STK	0	1.327
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK	0	2.200
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	901
ES0173093024	Redeia Corporacion S.A. Acciones Port.	STK	0	6.104
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK	0	1.350
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	1.757
AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien	STK	0	3.340
<b>GBP</b>				
GB00031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares	STK	0	4.509
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC Reg.Shares	STK	0	8.270
GB000B1WY2338	Smiths Group PLC Reg.Shares	STK	0	3.868
<b>HKD</b>				
HK0000063609	Swire Properties Ltd. Reg.Shares	STK	0	21.600
<b>JPY</b>				
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares	STK	0	3.100
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.500
JP3304200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.800
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares	STK	0	37.500
JP3326000001	Sankyu Inc. Reg.Shares	STK	0	1.300
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	14.400
<b>SEK</b>				
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK	0	8.890
<b>USD</b>				
US0326541051	Analog Devices Inc. Reg.Shares	STK	0	727
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares	STK	0	286
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares	STK	0	769
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares	STK	0	824
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares	STK	0	1.786
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares	STK	0	712
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares	STK	0	2.772
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	380
US5950171042	Microchip Technology Inc. Reg.Shares	STK	0	1.527

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US60770K1079	Moderna Inc. Reg.Shares	STK	0	483
US6819191064	Omnicom Group Inc. Reg.Shares	STK	0	1.133
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK	0	3.018
US82968B1035	Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares	STK	7.311	7.311
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares	STK	0	1.076
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	0	492
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares	STK	0	333
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares	STK	0	366
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
FR001400H7V7	3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33	EUR	0	3.500.000
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>SEK</b>				
SE0016844831	Volvo Car AB Namn-Aktier B	STK	6.340	6.340
SE0021628914	Volvo Car AB Namn-Aktier IL B	STK	6.340	6.340

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>5.747</b>
(Basiswert(e): ESTX Mid Index (Price) (EUR), MDAX Performance-Index, MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, Russell 2000 Index, Swiss Market Index (Price) (CHF))		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>12.723</b>
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), OMX Stockholm 30 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), TOPIX Index (Price) (JPY))		
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>7.805</b>
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU), US Treasury Long Bond Future (US))		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>4.922</b>
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY), US Treasury Long Bond Future (US))		
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	<b>EUR</b>	<b>15.211</b>
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)		
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>	<b>EUR</b>	<b>14.524</b>
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))		
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	<b>EUR</b>	<b>170</b>
CAD/EUR	<b>EUR</b>	<b>427</b>
GBP/EUR	<b>EUR</b>	<b>1.519</b>
JPY/EUR	<b>EUR</b>	<b>346</b>
SEK/EUR	<b>EUR</b>	<b>293</b>
USD/EUR	<b>EUR</b>	<b>15.495</b>
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	<b>EUR</b>	<b>171</b>
CAD/EUR	<b>EUR</b>	<b>1.069</b>
GBP/EUR	<b>EUR</b>	<b>3.047</b>
JPY/EUR	<b>EUR</b>	<b>722</b>
SEK/EUR	<b>EUR</b>	<b>647</b>
USD/EUR	<b>EUR</b>	<b>27.982</b>
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
<b>unbefristet</b>	<b>EUR</b>	<b>26.277</b>
(Basiswert(e): 1,2500 % Rep. Frankreich OAT 17/34, 1,7000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/32, 3,2500 % Rep. Frankreich OAT 13/45, 4,4000 % Republik Italien B.T.P. 22/33, Andritz AG Inhaber-Aktien)		

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	804.520
Anteilwert	EUR	97,71

### Angaben zu Bewertungsverfahren

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

#### Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

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

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

#### Investmentanteile

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

#### Derivate

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

#### Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

#### Sonstiges

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

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

#### Verwendete Vermögensgegenstände

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR

2.373.775,00

in % des Fondsvermögens

3,02

#### 10 größte Gegenparteien

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

2.373.775,00

Sitzstaat

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)

unbefristet

absolute Beträge in EUR

2.373.775,00

#### 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

#### Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

##### Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

3.157.369,32

#### Ertrags- und Kostenanteile

##### Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

Kostenanteil des Fonds

Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

1.068,11

352,43

352,43

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00

33,00

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.

# Deka-ESG Sigma Plus Konservativ

## 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.

## Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

3,10% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps Wertpapier-Darlehen

Deutsche Bank AG

absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR

3.157.369,32

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

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

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

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer

1

Clearstream Banking Frankfurt

3.157.369,32 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.

---

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

Deka Investment GmbH

Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2023

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 112,7 Mio.

### Alleingeschafterin

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 Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 2024

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](http://www.deka.de)

