

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2024. Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts

Verwaltungsgesellschaft: Deka Investment GmbH

Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2024

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel 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 bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Anteilklassen im Überblick	6
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024	7
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024	8
Anhang	14
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

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

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist es einen mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachs durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und durch eine 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, kann der fundamental und aktiv gemanagte Fonds weltweit in unterschiedliche Anlageklassen (z.B. Aktien und Anleihen) investieren. Im Rahmen des Auswahlprozesses für Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Investmentanteile werden neben wirtschaftlichen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien (Ökologie, Soziales und Governance) berücksichtigt. Die taktische Allokation zeichnet sich durch eine flexible, aktive Fondssteuerung aus. Mindestens 25 % des Fondsvermögens müssen in Aktien und / oder Aktienfonds investiert werden.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental geprägte Investmentansatz erfolgt nach einer TopDown und Bottom-up Betrachtung. Der Ausgangspunkt ist zunächst die weltweite volkswirtschaftliche Untersuchung (Topdown-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.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus. Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten. Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen.

Wichtige Kennzahlen

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

Performance*	6 Monate
Anteilklasse CF (A)	1,5%
Anteilklasse TF (A)	1,3%

ISIN

Anteilklasse CF (A)	DE000DKOLNA2
Anteilklasse TF (A)	DE000DKOLNBO

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

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 Europäischen Union, der Mitgliedstaaten der Europäischen Union 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.

Die Gesellschaft lässt sich von einem Anlageausschuss beraten.

Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung*, der Währung des Anteilwertes, der Vertriebsvergütungen**, 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 (A) und TF (A).

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

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

Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF (A)**	1,25% p.a.	3,75%	Ausschüttung
Anteilklasse TF (A)**	1,75% 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.

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	13.867.897,44	16,33
China	466.140,75	0,55
Deutschland	2.561.364,31	3,01
Japan	6.065.607,67	7,15
Kaiman-Inseln	3.771.358,66	4,44
Österreich	490.080,00	0,58
Schweiz	171.674,71	0,20
USA	341.671,34	0,40
2. Anleihen	38.057.572,33	44,85
Deutschland	11.740.811,37	13,84
Frankreich	440.317,50	0,52
Italien	1.965.890,00	2,32
Kanada	1.747.429,43	2,06
Niederlande	993.205,00	1,17
Österreich	6.532.065,70	7,70
Sonstige	9.175.074,78	10,81
USA	5.462.778,55	6,43
3. Investmentanteile	14.874.224,27	17,50
Irland	14.700.305,08	17,30
Luxemburg	173.919,19	0,20
4. Zertifikate	6.178.867,20	7,28
Irland	6.178.867,20	7,28
5. Derivate	-810.102,41	-0,97
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	9.614.474,48	11,31
7. Sonstige Vermögensgegenstände	3.498.841,80	4,13
II. Verbindlichkeiten	-366.472,37	-0,43
III. Fondsvermögen	84.915.302,74	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	13.867.897,44	16,33
CHF	171.674,71	0,20
EUR	2.450.360,00	2,88
HKD	3.155.128,87	3,72
JPY	6.065.607,67	7,15
USD	2.025.126,19	2,38
2. Anleihen	38.057.572,33	44,85
EUR	8.084.525,50	9,53
USD	29.973.046,83	35,32
3. Investmentanteile	14.874.224,27	17,50
EUR	12.468.939,40	14,67
USD	2.405.284,87	2,83
4. Zertifikate	6.178.867,20	7,28
EUR	6.178.867,20	7,28
5. Derivate	-810.102,41	-0,97
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	9.614.474,48	11,31
7. Sonstige Vermögensgegenstände	3.498.841,80	4,13
II. Verbindlichkeiten	-366.472,37	-0,43
III. Fondsvermögen	84.915.302,74	100,00

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

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

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 *)
Börsengehandelte Wertpapiere								52.220.643,29	61,53
Aktien								13.867.897,44	16,33
EUR								2.450.360,00	2,88
DE0005800601	GFT Technologies SE Inhaber-Aktien	STK		28.000	17.000	10.000	EUR 25,600	716.800,00	0,84
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien	STK		12.000	12.000	0	EUR 42,050	504.600,00	0,59
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK		9.000	9.000	9.000	EUR 65,020	585.180,00	0,69
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien	STK		12.000	27.000	25.000	EUR 40,840	490.080,00	0,58
DE0007461006	PVA TePla AG Inhaber-Aktien	STK		10.000	10.000	0	EUR 15,370	153.700,00	0,18
CHF								171.674,71	0,20
CH0435377954	SIG Group AG Namens-Aktien	STK		10.000	10.000	0	CHF 16,520	171.674,71	0,20
HKD								3.155.128,87	3,72
KYG070341048	Baidu Inc. Reg.Shares	STK		20.000	0	0	HKD 85,250	204.101,18	0,24
KYG3777B1032	Geely Automobile Holdings Ltd. Reg.Shares	STK		500.000	500.000	0	HKD 8,790	526.114,18	0,62
KYG5479M1050	Li Auto Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		30.000	30.000	0	HKD 70,300	252.462,98	0,30
CNE1000003X6	Ping An Insurance(Grp)Co.China Reg.Shares H	STK		110.000	110.000	0	HKD 35,400	466.140,75	0,55
KYG875721634	Tencent Holdings Ltd. Reg.Shares	STK		25.000	25.000	0	HKD 372,400	1.114.476,22	1,31
KYG9830T1067	Xiaomi Corp. Reg.Shares Cl.B	STK		300.000	300.000	0	HKD 16,480	591.833,56	0,70
JPY								6.065.607,67	7,15
JP3834800009	Heiwa Real Estate Co. Ltd. Reg.Shares	STK		15.000	15.000	0	JPY 3.920,000	341.513,00	0,40
JP3284600008	Koito Mfg Co. Ltd. Reg.Shares	STK		40.000	40.000	0	JPY 2.219,000	515.522,00	0,61
JP3899800001	Mitsubishi Motors Corp. Reg.Shares	STK		300.000	200.000	0	JPY 443,200	772.237,55	0,91
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co. Ltd. Reg.Shares	STK		120.000	120.000	0	JPY 1.468,500	1.023.493,54	1,21
JP3891200002	Mitsui-Soko Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK		15.000	15.000	0	JPY 4.775,000	416.001,16	0,49
JP3672400003	Nissan Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK		150.000	0	0	JPY 545,900	475.591,69	0,56
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares	STK		30.000	10.000	0	JPY 2.196,500	382.721,07	0,45
JP3547670004	Persol Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK		200.000	0	0	JPY 222,700	258.690,29	0,30
JP3362800009	Shochiku Co. Ltd. Reg.Shares	STK		6.000	6.000	0	JPY 9.421,000	328.305,50	0,39
JP3435000009	Sony Group Corp. Reg.Shares	STK		4.200	0	0	JPY 13.640,000	332.731,23	0,39
JP3462660006	Takeuchi MFG Co. Ltd. Reg.Shares	STK		15.000	0	0	JPY 5.630,000	490.489,33	0,58
JP3126800006	The Awa Bank Ltd. Reg.Shares	STK		22.000	22.000	0	JPY 2.826,000	361.097,72	0,43
JP3347600003	The Shiga Bank Ltd. Reg.Shares	STK		15.000	15.000	0	JPY 4.215,000	367.213,59	0,43
USD								2.025.126,19	2,38
US00827B1061	Affirm HLDGS INC Reg.Shares Cl.A	STK		12.000	12.000	0	USD 30,460	341.671,34	0,40
US01609W1027	Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)	STK		16.000	16.000	0	USD 72,370	1.082.370,54	1,27
US09075V1026	BioNTech SE Nam.-Akt. (sp.ADRs)	STK		8.000	8.000	0	USD 80,380	601.084,31	0,71
Verzinsliche Wertpapiere								32.173.878,65	37,92
EUR								8.084.525,50	9,53
FR0014004EF7	0,7500 % C.N.d.Reas.Mut.Agrico.Group.SA Notes 21/28	EUR		500.000	0	0	% 88,064	440.317,50	0,52
IT0005327306	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 18/25	EUR		2.000.000	2.000.000	0	% 98,295	1.965.890,00	2,32
AT0000A2Y8G4	1,8500 % Republik Oesterreich MTN 22/49	EUR		2.200.000	2.200.000	0	% 76,242	1.677.313,00	1,98
AT0000A33SH3	2,9000 % Republik Oesterreich MTN 23/29	EUR		3.000.000	3.000.000	0	% 100,260	3.007.800,00	3,54
XS2049616548	0,0000 % Siemens Finan.maatschappij NV MTN 19/24	EUR		1.000.000	0	0	% 99,321	993.205,00	1,17
USD								24.089.353,15	28,39
US045167FU29	4,2500 % Asian Development Bank MTN 23/26	USD		2.000.000	0	0	% 98,975	1.850.345,86	2,18
US4581X0EL86	4,5000 % Inter-American Dev. Bank MTN 23/33	USD		3.000.000	0	0	% 100,392	2.815.241,17	3,32
US459058KT95	3,5000 % International Bank Rec. Dev. Notes 23/28	USD		5.000.000	2.000.000	0	% 96,485	4.509.487,75	5,31
US500769JJ42	0,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 21/26	USD		3.000.000	3.000.000	0	% 93,588	2.624.439,15	3,09
US500769JR67	1,2500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 22/25	USD		3.000.000	0	0	% 97,660	2.738.642,74	3,23
US500769JY19	4,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 23/33	USD		5.000.000	2.000.000	0	% 97,660	4.564.427,93	5,38
XS2297663416	0,3750 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.2NF 21/25	USD		2.000.000	0	0	% 96,993	1.813.301,55	2,14
US676167CJ60	4,2500 % Oesterreichische Kontrollbk AG MTN 23/28	USD		2.000.000	0	2.000.000	% 98,793	1.846.952,70	2,18
US29736RAU41	5,1500 % The Estée Lauder Compan. Inc. Notes 23/53	USD		1.500.000	1.500.000	0	% 94,607	1.326.514,30	1,56
Zertifikate								6.178.867,20	7,28
EUR								6.178.867,20	7,28
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK		29.440	31.000	16.860	EUR 209,880	6.178.867,20	7,28
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								5.883.693,68	6,93
Verzinsliche Wertpapiere								5.883.693,68	6,93
USD								5.883.693,68	6,93
US037833EW60	4,8500 % Apple Inc. Notes 23/53	USD		2.000.000	2.000.000	0	% 98,252	1.836.829,31	2,16
US398433AP71	5,7500 % Griffon Corp. Notes 20/28	USD		500.000	0	0	% 96,912	452.946,81	0,53
US594918CE21	2,9210 % Microsoft Corp. Notes 21/52	USD		2.000.000	2.000.000	0	% 69,277	1.295.139,28	1,53
US683234AS74	0,6250 % Provinz Ontario Bonds 21/26	USD		2.000.000	2.000.000	0	% 93,470	1.747.429,43	2,06
US92343EAL65	4,7500 % Verisign Inc. Notes 17/27	USD		600.000	600.000	0	% 98,305	551.348,85	0,65

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
Nichtnotierte Wertpapiere								0,00	0,00	
Aktien								0,00	0,00	
USD								0,00	0,00	
US003CVR0169	Abiomed Inc. Reg.Shares		STK	122	0	0	USD 0,000	0,00	0,00	
Wertpapier-Investmentanteile								14.874.224,27	17,50	
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								14.874.224,27	17,50	
EUR								12.468.939,40	14,67	
IE00BYX8XC17	iShs IV-iShs MSCI Japan SRI Reg.Shares		ANT	10.000	0	0	EUR 6,493	64.930,00	0,08	
IE00BYVJRP78	iShs IV-Sust.MSCI Em.Mkts SRI Reg.Shares		ANT	10.000	0	0	EUR 6,626	66.260,00	0,08	
IE00B52VJ196	iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)		ANT	1.000	0	0	EUR 70,980	70.980,00	0,08	
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Reg.Shs Acc.		ANT	1.110.000	1.100.000	0	EUR 11,050	12.265.500,00	14,43	
LU0514695690	xtrackers MSCI China 1C		ANT	100	0	0	EUR 12,694	1.269,40	0,00	
USD								2.405.284,87	2,83	
LU1806495575	AIS-Amun.Indx US Corp. SRI A.N.UCIT.ETF USD A.N		ANT	3.250	0	0	USD 56,831	172.649,79	0,20	
IE00BFZPF322	In.M.I Invesco AT1 Cap Bd ETF Reg.Shs Acc.		ANT	600	0	0	USD 25,310	14.195,18	0,02	
IE00BKFO9C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	530.000	400.000	250.000	USD 4,478	2.218.439,90	2,61	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	72.978.561,24	85,96
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
DAX-Index Future (FDAX) Sep. 24		XEUR	EUR	Anzahl 2				13.500,00	0,02	
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep.24		XEUR	EUR	Anzahl -42				3.360,00	0,00	
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) Sep. 24		IFUS	USD	Anzahl 65				-64.699,01	-0,08	
MSCI World Index Future (FMWO) Sep. 24		XEUR	USD	Anzahl 250				68.706,92	0,08	
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
S & P 500 Index (S500) Call Dez. 24 5300		XCBO		Anzahl -25			USD 403,600	-943.166,95	-1,11	
S & P 500 Index (S500) Put Juli 24 5440		XCBO		Anzahl 40			USD 36,250	135.539,35	0,16	
Summe Aktienindex-Derivate								EUR	-807.627,60	-0,95
Zins-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte										
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 24		XEUR	EUR	9.000.000				68.400,00	0,08	
EURO Buxl Future (FGBX) Sep. 24		XEUR	EUR	6.000.000				188.400,00	0,22	
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte										
EURO Buxl Future (FGBX) Call Aug. 24 128		XEUR	EUR	Anzahl -80			EUR 0,955	-76.400,00	-0,09	
EURO Buxl Future (FGBX) Put Aug. 24 132		XEUR	EUR	Anzahl -80			EUR 0,487	-38.930,00	-0,05	
Summe Zins-Derivate								EUR	-115.330,00	-0,14
Devisen-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Kauf)										
Offene Positionen										
JPY/CHF 400.000.000,00		OTC						-101.461,69	-0,12	
JPY/EUR 700.000.000,00		OTC						-126.631,13	-0,15	
TRY/EUR 25.000.000,00		OTC						87.720,00	0,10	
TRY/USD 160.000.000,00		OTC						259.499,05	0,30	
USD/EUR 4.000.000,00		OTC						33.097,43	0,04	
Devisenterminkontrakte (Verkauf)										
Offene Positionen										
HKD/USD 40.000.000,00		OTC						-3.906,78	0,00	
JPY/CHF 400.000.000,00		OTC						96.416,93	0,11	
TRY/EUR 25.000.000,00		OTC						-51.571,01	-0,06	
TRY/USD 100.000.000,00		OTC						-68.496,29	-0,08	
USD/EUR 18.000.000,00		OTC						-289.479,23	-0,34	
Summe Devisen-Derivate								EUR	-164.812,72	-0,20
Swaps										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Credit Default Swaps (CDS)										
Protection Buyer										
CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S34 V3 5Y / GOLDMANS_FRA 20.12.2025		OTC	EUR	1.000.000				-46.436,27	-0,05	
Protection Seller										
CDS ITRAXX EUROPE CROSSOVER S34 V3 5Y / BOFASECEUR 20.12.2025		OTC	EUR	-1.000.000				46.436,27	0,05	
Summe Swaps								EUR	0,00	0,00
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds										
Bankguthaben										

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	341.436,31			% 100,000	341.436,31	0,40
EUR-Guthaben bei									
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	229.232,55			% 100,000	229.232,55	0,27
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CZK	1.423.124,09			% 100,000	56.824,95	0,07
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	280.917,00			% 100,000	37.665,78	0,04
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HUF	14.583.238,10			% 100,000	36.881,31	0,04
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	3.132.142,16			% 100,000	274.124,12	0,32
	DekaBank Deutsche Girozentrale		PLN	2.226,77			% 100,000	516,54	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	3.215.634,46			% 100,000	282.237,84	0,33
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	44.898,29			% 100,000	27.842,09	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	868.788,82			% 100,000	592.389,00	0,70
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	98.349,60			% 100,000	102.204,23	0,12
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	207.914,34			% 100,000	245.754,37	0,29
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	37.175,10			% 100,000	4.450,14	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		ILS	4.882,12			% 100,000	1.214,35	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	46.911.970,00			% 100,000	272.466,79	0,32
	DekaBank Deutsche Girozentrale		MXN	126.743,77			% 100,000	6.451,62	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	123.524,22			% 100,000	70.062,80	0,08
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SGD	9.011,96			% 100,000	6.207,65	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		TRY	33.061,80			% 100,000	937,51	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		TWD	27.336,00			% 100,000	787,72	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	1.058.173,76			% 100,000	989.132,32	1,16
	DekaBank Deutsche Girozentrale		ZAR	695.339,15			% 100,000	35.654,49	0,04
Termingelder									
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	2.000.000,00			% 100,000	2.000.000,00	2,36
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	4.000.000,00			% 100,000	4.000.000,00	4,71
Summe Bankguthaben							EUR	9.614.474,48	11,31
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	9.614.474,48	11,31
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	474.068,50				474.068,50	0,56
	Dividendenansprüche		EUR	57.211,82				57.211,82	0,07
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	2.358.026,84				2.358.026,84	2,78
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	15.188,08				15.188,08	0,02
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	14.346,56				14.346,56	0,02
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	580.000,00				580.000,00	0,68
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	3.498.841,80	4,13
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-96.472,37				-96.472,37	-0,11
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-270.000,00				-270.000,00	-0,32
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-366.472,37	-0,43
Fondsvermögen							EUR	84.915.302,74	100,00
Umlaufende Anteile Klasse CF (A)							STK	663.680,000	
Umlaufende Anteile Klasse TF (A)							STK	96.186,000	
Anteilwert Klasse CF (A)							EUR	111,95	
Anteilwert Klasse TF (A)							EUR	110,39	

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

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)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	35,26555 = 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,31090 = 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	25,04400 = 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	395,41000 = 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	19,50215 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06980 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46659 = 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso	(MXN)	19,64525 = 1 Euro (EUR)
Israel, Schekel	(ILS)	4,02035 = 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,45175 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	172,17500 = 1 Euro (EUR)
Taiwan, Neue Dollar	(TWD)	34,70270 = 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)

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

Marktschlüssel

Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
IFUS	New York/N.Y. - ICE Futures U.S.

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				
AUD				
AU000000FMG4	Fortescue Ltd. Reg.Shares	STK	0	10.775
CAD				
CA1254911003	CI Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	4.674
CA6837151068	Open Text Corp. Reg.Shares	STK	0	14.000
CHF				
CH1243598427	Sandoz Group AG Namens-Aktien	STK	0	1.200
CH1256740924	SGS S.A. Namen-Aktien	STK	5.000	5.000
DKK				
DK0010272202	GENMAB AS Navne-Aktier	STK	2.000	4.000
DK0060036564	Spar Nord Bank A/S Navne-Aktier	STK	15.000	40.000
DK0010311471	Sydbank AS Navne-Aktier	STK	14.000	23.000
EUR				
FR0004125920	Amundi S.A. Actions au Porteur	STK	0	14.000
AT0000730007	Andritz AG Inhaber-Aktien	STK	0	10.000
DE0005470306	CTS Eventim AG & Co. KGaA Inhaber-Aktien	STK	12.000	12.000
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien	STK	0	2.500
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien	STK	0	60.000
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK	0	80.000
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port.	STK	30.000	30.000
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK	40.000	40.000
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien	STK	20.000	20.000
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK	200.000	200.000
FI0009014575	Metso Oyj Reg.Shares	STK	0	60.000
IT0005366767	Nexi S.p.A. Azioni nom.	STK	15.000	65.000
IT0000433307	Saras S.p.A. Raffinerie Sarde Azioni nom.	STK	0	200.000
DE000SHA0159	Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.	STK	70.000	70.000
FR0010411983	SCOR SE Actions au Porteur	STK	15.000	15.000
NL00150001Q9	Stellantis N.V Aandelen op naam	STK	0	15.000
FR0000051807	Téléperformance SE Actions Port.	STK	12.000	12.000
GBP				
GB00B1VNSX38	Drax Group PLC Reg.Shares	STK	0	40.000
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC Reg.Shares	STK	0	60.000
GB00BMX86B70	Haleon PLC Reg.Shares	STK	0	50.000
JPY				
JP3528600004	Chiyoda Corp. (6366) Reg.Shares	STK	0	300.000
JP3826200002	Future Corp. Reg.Shares	STK	27.100	27.100
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	40.000
JP3699400002	Japan Airport Terminal Co.Ltd. Reg.Shares	STK	10.000	10.000
JP3752900005	Japan Post Holdings Co.Ltd Reg.Shares	STK	50.000	50.000
JP3215800008	Kaneka Corp. Reg.Shares	STK	30.000	30.000
JP3266400005	Kubota Corp. Reg.Shares	STK	0	38.000
JP3862960006	Macnica Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	10.000
JP3753800006	Mitsubishi Logisnext Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	50.000
JP3672000001	Nissan Shatai Co. Ltd. Reg.Shares	STK	60.000	60.000
JP3188220002	Otsuka Holdings Company Ltd. Reg.Shares	STK	0	10.000
JP3967170006	Rakus Co. Ltd Reg.Shares	STK	30.000	30.000
JP3436150001	SB Technology Corp. Reg.Shares	STK	20.000	20.000
JP3322930003	Sumco Corp. Reg.Shares	STK	25.000	25.000
NOK				
NO0003067902	Hexagon Composites ASA Navne-Aksjer	STK	0	100.000
SEK				
SE0008374250	Fingerprint Cards AB Namn-Aktier B	STK	0	16.405
SE0000936478	Intrum AB Namn-Aktier	STK	35.000	65.000
SE0016075337	OX2 AB Namn-Aktier	STK	0	47.993
USD				
US0185811082	ABread Financial Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	7.000
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C	STK	6.000	11.400
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares	STK	7.000	7.000
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares	STK	4.500	4.500
US04271T1007	Array Technologies Inc. Reg.Shares	STK	35.000	35.000
US07831C1036	BellRing Brands Inc. Reg.Shares	STK	0	7.000
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares	STK	2.500	2.500
US1152361010	Brown & Brown Inc. Reg.Shares	STK	7.000	7.000
US1344291091	Campbell Soup Co. Reg.Shares	STK	15.000	15.000
US14888U1016	Catalyst Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	60.000	60.000
US03073E1055	Cencora Inc. Reg.Shares	STK	0	5.000

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US12572Q1058	CME Group Inc. Reg.Shares	STK	3.000	3.000
US20602D1019	Concentrix Corp. Reg.Shares	STK	2.500	5.000
US2199481068	Corpay Inc. Reg.Shares	STK	3.000	3.000
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares	STK	0	5.100
US2441991054	Deere & Co. Reg.Shares	STK	1.200	1.200
US24703L2025	Dell Technologies Inc. Reg.Shares C	STK	6.000	6.000
US2480191012	DeLuxe Corp. Reg.Shares	STK	10.000	20.000
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares	STK	0	1.050
US29977X1054	EverCommerce Inc. Reg.Shares	STK	20.000	55.000
US30161Q1040	Exelixis Inc. Reg.Shares	STK	0	30.000
US3390411052	FleetCor Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	3.000
US35905A1097	Frontdoor Inc. Reg.Shares	STK	0	5.331
US37940X1028	Global Payments Inc. Reg.Shares	STK	0	6.000
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares	STK	95.000	95.000
US45337C1027	Incyte Corp. Reg.Shares	STK	5.000	10.000
US4824801009	KLA Corp. Reg.Shares	STK	0	1.700
US58506Q1094	Medpace Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	3.000
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK	0	5.000
US30303M1027	Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	2.500	2.500
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK	4.700	4.700
US60770K1079	Moderna Inc. Reg.Shares	STK	0	4.000
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	1.500	1.500
US64125C1099	Neurocrine Biosciences Inc. Reg.Shares	STK	5.000	10.000
US65290E1010	Nextracker Inc. Reg.Shs Cl.A	STK	3.000	13.000
US6541061031	NIKE Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	5.000	5.000
US6700024010	Novavax Inc. Reg.Shares	STK	0	45.000
US6293775085	NRG Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	8.000
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares	STK	1.500	1.500
US6934751057	PNC Financial Services Group Reg.Shares	STK	0	3.000
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	0	400
US7611521078	ResMed Inc. Reg.Shares	STK	0	3.800
US7766961061	Roper Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	1.600
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares	STK	0	877
US8740541094	Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares	STK	0	3.000
US87162W1009	TD SYNnex Corp. Reg.Shares	STK	5.000	9.000
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares	STK	8.500	8.500
US5007541064	The Kraft Heinz Co. Reg.Shares	STK	20.000	20.000
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares	STK	800	1.510
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares	STK	2.100	2.100
US91913Y1001	Valero Energy Corp. Reg.Shares	STK	0	1.500
US92343E1029	Verisign Inc. Reg.Shares	STK	0	2.500
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	0	1.900
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	1.500
US9598021098	Western Union Co. Reg.Shares	STK	0	20.000
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS2756387499	3,5000 % American Honda Finance Corp. MTN 24/26	EUR	500.000	500.000
XS2745719000	4,0000 % Banco de Sabadell S.A. FLR Pref. MTN 24/30	EUR	200.000	200.000
XS2751667150	5,0000 % Banco Santander S.A. FLR MTN 24/34	EUR	300.000	300.000
DE000A3LT423	3,3750 % BMW US Capital LLC MTN 24/34	EUR	450.000	450.000
FR0014000671	4,8750 % BPCE S.A. FLR MTN 24/36	EUR	100.000	100.000
XS2747766090	3,5000 % EDP Servicios Financ.Espana SA MTN 24/30	EUR	250.000	250.000
XS2773789065	3,6250 % Epiroc AB MTN 24/31	EUR	250.000	250.000
EU000A1G0EA8	0,2000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 18/24	EUR	0	6.000.000
DE000HCB0B28	3,6250 % Hamburg Commer. Bank AG Schiffs-Pfe. S.2765 24/26	EUR	200.000	200.000
XS2748213290	4,8710 % Iberdrola Finanzas S.A. FLR MTN 24/Und.	EUR	400.000	400.000
XS2767979052	3,3750 % Infineon Technologies AG MTN 24/27	EUR	100.000	100.000
XS2745115837	3,6250 % NatWest Markets PLC MTN 24/29	EUR	400.000	400.000
XS2770921315	5,6250 % Republik Rumaenien MTN 24/36 Reg.S	EUR	325.000	325.000
FR001400N285	3,2500 % Schneider Electric SE MTN 24/35	EUR	400.000	400.000
DE000A3827R4	3,7500 % Sixt SE MTN 24/29	EUR	350.000	350.000
XS2753429047	4,0000 % Ungarn Bonds 24/29	EUR	300.000	300.000
XS2767489391	3,5000 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 24/37	EUR	175.000	175.000
XS2757520965	4,7500 % ZF Europe Finance B.V. MTN 24/29	EUR	400.000	400.000
USD				
US298785JV96	3,7500 % European Investment Bank Notes 23/33	USD	0	3.000.000
US4581X0CF37	3,0000 % Inter-American Dev. Bank MT Bank Nts 14/24	USD	0	2.000.000
XS2756521212	5,8750 % Republik Rumaenien MTN 24/29 Reg.S	USD	350.000	350.000
Sonstige Beteiligungswertpapiere				
CHF				
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK	0	3.200
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
SEK				
SE0015961982	Vimian Group AB Namn-Aktier	STK	0	80.000
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS2769426623	7,0000 % Avis Budget Finance PLC Notes 24/29 Reg.S	EUR	600.000	600.000
XS2798174434	8,7190 % Reno De Medici S.p.A. FLR Notes 24/29 Reg.S	EUR	625.000	625.000
Nichtnotierte Wertpapiere				

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Verzinsliche Wertpapiere				
AUD				
AU3CB0300135	5,1000 % Bendigo & Adelaide Bank Ltd. MT Cov.Bds 23/28	AUD	0	540.000
Andere Wertpapiere				
SEK				
SE0022241154	Fingerprint Cards AB Anrechte	STK	16.405	16.405
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:				
(Basiswert(e): DAX Performance-Index, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Hang Seng Index, MSCI Emerging Markets Index (USD), MSCI World (Price weighted) Index (Net Ret.) (USD), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index, STXE600 Real Estate Index (Price) (EUR))		EUR	176.684	
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswert(e): DAX Performance-Index, Nasdaq-100 Index, Nikkei 225 Stock Average Index (JPY), S&P 500 Index)		EUR	89.168	
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX))		EUR	121.968	
Optionsrechte				
Wertpapier-Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktien				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):				
(Basiswert(e): Meta Platforms Inc. Reg.Shares CIA, NVIDIA Corp. Reg.Shares)		EUR	1.471	
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):				
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)		EUR	23.338	
Verkaufte Kaufoptionen (Call):				
(Basiswert(e): DAX Performance-Index, S&P 500 Index)		EUR	63.181	
Optionsrechte auf Zins-Derivate				
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kaufoptionen (Call):				
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX))		EUR	128.435	
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):				
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX))		EUR	84.475	
Devisentermingeschäfte				
Devisenterminkontrakte (Verkauf)				
Verkauf von Devisen auf Termin:				
DKK/EUR		EUR	670	
JPY/CHF		EUR	6.349	
JPY/EUR		EUR	3.115	
JPY/USD		EUR	1.827	
NOK/CHF		EUR	5.130	
NOK/USD		EUR	12.957	
TRY/EUR		EUR	713	
TRY/USD		EUR	2.943	
USD/EUR		EUR	32.315	
Devisenterminkontrakte (Kauf)				
Kauf von Devisen auf Termin:				
CHF/GBP		EUR	3.174	
GBP/EUR		EUR	3.496	
JPY/CHF		EUR	2.434	
JPY/EUR		EUR	11.774	
JPY/USD		EUR	1.949	
NOK/CHF		EUR	5.130	
NOK/USD		EUR	13.022	
TRY/EUR		EUR	758	
TRY/USD		EUR	1.517	
USD/EUR		EUR	38.519	
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):				
unbefristet				
(Basiswert(e): Andritz AG Inhaber-Aktien, Engie S.A. Actions Port, Intrum AB Namn-Aktier)		EUR	2.096	

Frankfurter Sparkasse Nachhaltigkeit Invest Flexibel

Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF (A)	STK	663,680
Umlaufende Anteile Klasse TF (A)	STK	96,186
Anteilwert Klasse CF (A)	EUR	111,95
Anteilwert Klasse TF (A)	EUR	110,39

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)

Im Sondervermögen bestehen zum Berichtsstichtag keine offenen Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte. Erläuterungen gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nur für zeitraumbezogene Angaben erforderlich.

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	492,23	100,00
Kostenanteil des Fonds	162,44	33,00
Ertragsanteil der KVG	162,44	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.

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.

Überreicht durch:

Frankfurter Sparkasse
Anstalt öffentlichen Rechts
Neue Mainzer Straße 47-53
60311 Frankfurt am Main
Deutschland



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

 **Finanzgruppe**