

Halbjahresbericht zum 31. Mai 2022. SSKM Nachhaltigkeit Invest

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

Verwaltungsgesellschaft: Deka Investment GmbH

Bericht der Geschäftsführung.

31. Mai 2022

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds SSKM Nachhaltigkeit Invest für den Zeitraum vom 1. Dezember 2021 bis zum 31. Mai 2022.

Bis in den Februar 2022 hinein beherrschte die Corona-Pandemie die Schlagzeilen an den Börsen, wobei die Inflationsentwicklung zunehmend an Bedeutung gewann. Die Erholung der globalen Wirtschaft setzte sich zunächst fort, wobei sich das Wachstumstempo in Euroland verlangsamte. Der Angriff Russlands auf die Ukraine Ende Februar markierte als exogenes Schockereignis den Wendepunkt und versetzte das Geschehen an den internationalen Kapitalmärkten in den Krisenmodus. Umfangreiche Sanktionsmaßnahmen des Westens wurden gegen den russischen Aggressor auf den Weg gebracht. Russland seinerseits verhängte Gegenmaßnahmen und stoppte die Lieferung von Gas in mehrere europäische Länder. Signifikante Preissteigerungen für Energie und Rohstoffe, Lieferkettenprobleme sowie Corona-Lockdowns in China belasteten das Marktumfeld.

Die Geld- und Fiskalpolitik wurde in den vergangenen sechs Monaten von der rasanten Inflationsentwicklung dominiert. Sowohl die EZB als auch die Federal Reserve haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet. Darüber hinaus vollzog die US-Notenbank die Leitzinswende und erhöhte diesen im März um 25 sowie Anfang Mai um 50 Basispunkte. Dank einer stark expansiven Finanzpolitik haben sich die USA rascher als Europa von der Pandemie erholt. Zudem trifft der Krieg gegen die Ukraine die europäische Wirtschaft um ein Vielfaches stärker. Für die EZB ist daher eine Zinserhöhung problematischer. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo kräftig an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 1,1 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 2,8 Prozent.

Das Gros der Aktienmärkte tendierte im Berichtszeitraum schwächer. Die Inflationsentwicklung, hohe Rohstoffpreise, Lieferkettenprobleme sowie der Krieg in der Ukraine setzten die Kurse wiederholt unter Druck. Insbesondere Wachstumstitel wie aus dem Technologiebereich waren hiervon betroffen.

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 |
| Vermögensübersicht zum 31. Mai 2022 | 6 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022 | 7 |
| Anhang | 15 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 17 |

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

SSKM Nachhaltigkeit Invest Anlagepolitik.

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

Der aktiv gemanagte Fonds kann weltweit in unterschiedliche Anlageklassen investieren. Im Rahmen des Wertpapierauswahlprozesses werden neben wirtschaftlichen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien (Ökologie, Soziales und Governance) berücksichtigt. Der Anteil des Fondsvermögens, der in Aktien, Aktienfonds und Aktienderivate investiert werden darf, beträgt maximal 70%. 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.

Der Fonds legt mindestens 25% des Aktivvermögens (Wert der Vermögensgegenstände ohne Berücksichtigung von Verbindlichkeiten) in Kapitalbeteiligungen i.S.d. § 2 Abs. 8 InvStG an.

Der Investmentfonds darf mehr als 35% des Wertes des Fondsvermögens in Schuldverschreibungen, Schuldscheindarlehen und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland anlegen.

Weiterhin können Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Die Anleger können börsentäglich die Rücknahme der Anteile verlangen. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Rücknahme aussetzen oder einschränken, wenn außergewöhnliche Umstände dies zur Wahrnehmung der Anlegerinteressen erforderlich erscheinen lassen. Setzt die Verwaltungsgesellschaft die Rücknahme von Anteilen ganz oder teilweise aus und lehnt daher die Rücknahme der Anteile ganz (Rücknahmeaussetzung) oder teilweise (Rücknahmebeschränkung) ab, kann dies dazu führen, dass der Auftrag ganz zu einem späteren Zeitpunkt ausgeführt wird oder dass ein Auftrag in Höhe seines nicht ausgeführten Anteils erlischt.

Wichtige Kennzahlen

SSKM Nachhaltigkeit Invest

| Performance* | 6 Monate |
|--------------|--------------|
| | -1,7% |
| ISIN | DE000DK0V6A9 |

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

SSKM Nachhaltigkeit Invest

Vermögensübersicht zum 31. Mai 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land

| | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens *) |
|---|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | |
| 1. Aktien | 64.373.847,23 | 52,69 |
| Australien | 1.087.814,13 | 0,89 |
| Belgien | 129.470,04 | 0,11 |
| Dänemark | 582.689,64 | 0,48 |
| Deutschland | 1.269.652,61 | 1,05 |
| Finnland | 954.387,44 | 0,78 |
| Frankreich | 811.450,90 | 0,66 |
| Großbritannien | 1.686.390,72 | 1,38 |
| Irland | 1.009.379,50 | 0,83 |
| Italien | 110.938,40 | 0,09 |
| Japan | 2.646.425,76 | 2,17 |
| Kanada | 4.741.148,10 | 3,87 |
| Neuseeland | 242.039,64 | 0,20 |
| Niederlande | 1.107.803,64 | 0,90 |
| Norwegen | 1.212.503,22 | 0,99 |
| Schweden | 1.533.087,27 | 1,27 |
| Schweiz | 2.669.867,13 | 2,19 |
| Spanien | 814.767,98 | 0,67 |
| USA | 41.764.031,11 | 34,16 |
| 2. Anleihen | 38.524.980,31 | 31,48 |
| Australien | 382.584,00 | 0,31 |
| Belgien | 3.263.747,00 | 2,67 |
| Deutschland | 6.173.212,00 | 5,05 |
| Finnland | 2.824.590,00 | 2,31 |
| Frankreich | 1.510.044,50 | 1,23 |
| Großbritannien | 1.219.895,11 | 1,00 |
| Italien | 4.006.125,00 | 3,28 |
| Luxemburg | 467.500,00 | 0,38 |
| Niederlande | 1.834.456,72 | 1,50 |
| Norwegen | 1.357.225,93 | 1,11 |
| Schweden | 392.887,50 | 0,32 |
| Spanien | 4.100.915,00 | 3,35 |
| USA | 10.991.797,55 | 8,97 |
| 3. Sonstige Wertpapiere | 567.337,64 | 0,46 |
| Schweiz | 567.337,64 | 0,46 |
| 4. Derivate | 446.972,57 | 0,35 |
| 5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | 16.423.582,29 | 13,44 |
| 6. Sonstige Vermögensgegenstände | 2.098.488,01 | 1,71 |
| II. Verbindlichkeiten | -163.725,74 | -0,13 |
| III. Fondsvermögen | 122.271.482,31 | 100,00 |

Gliederung nach Anlageart - Währung

| | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens *) |
|---|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | |
| 1. Aktien | 64.373.847,23 | 52,69 |
| AUD | 1.087.814,13 | 0,89 |
| CAD | 4.741.148,10 | 3,87 |
| CHF | 2.669.867,13 | 2,19 |
| DKK | 582.689,64 | 0,48 |
| EUR | 5.198.471,01 | 4,26 |
| GBP | 1.564.153,63 | 1,28 |
| JPY | 2.646.425,76 | 2,17 |
| NOK | 1.212.503,22 | 0,99 |
| NZD | 242.039,64 | 0,20 |
| SEK | 1.533.087,27 | 1,27 |
| USD | 42.895.647,70 | 35,09 |
| 2. Anleihen | 38.524.980,31 | 31,48 |
| EUR | 28.277.868,70 | 23,12 |
| USD | 10.247.111,61 | 8,36 |
| 3. Sonstige Wertpapiere | 567.337,64 | 0,46 |
| CHF | 567.337,64 | 0,46 |
| 4. Derivate | 446.972,57 | 0,35 |
| 5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | 16.423.582,29 | 13,44 |
| 6. Sonstige Vermögensgegenstände | 2.098.488,01 | 1,71 |
| II. Verbindlichkeiten | -163.725,74 | -0,13 |
| III. Fondsvermögen | 122.271.482,31 | 100,00 |

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

SSKM Nachhaltigkeit Invest

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2022.

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.05.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|-------------------------------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------------|----------------------|-------------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | 92.941.500,36 | 76,05 |
| Aktien | | | | | | | | 64.373.847,23 | 52,69 |
| EUR | | | | | | | | 5.198.471,01 | 4,26 |
| NL0011794037 | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder | STK | | 16.337 | 6.995 | 0 | EUR 25,635 | 418.799,00 | 0,34 |
| DE000A1DAH00 | Brenntag SE Namens-Aktien | STK | | 8.589 | 1.762 | 0 | EUR 72,960 | 626.653,44 | 0,51 |
| FI0009007884 | Elisa Oyj Reg.Shares Cl.A | STK | | 13.456 | 2.893 | 0 | EUR 52,780 | 710.207,68 | 0,58 |
| ES0130960018 | Enagas S.A. Acciones Port. | STK | | 3.752 | 0 | 0 | EUR 21,460 | 80.517,92 | 0,07 |
| FR0014008VX5 | EuroAPI SAS Actions Nom. | STK | | 319 | 319 | 0 | EUR 13,614 | 4.342,87 | 0,00 |
| DE000A0Z2Z25 | freenet AG Namens-Aktien | STK | | 6.791 | 0 | 0 | EUR 24,380 | 165.564,58 | 0,14 |
| BE0003797140 | Groupe Bruxelles Lambert SA(GBL) Act.au Porteur | STK | | 1.494 | 0 | 0 | EUR 86,660 | 129.470,04 | 0,11 |
| NL0000009827 | Koninklijke DSM N.V. Aandelen aan toonder | STK | | 329 | 0 | 0 | EUR 155,200 | 51.060,80 | 0,04 |
| DE000LEG1110 | LEG Immobilien SE Namens-Aktien | STK | | 2.692 | 0 | 0 | EUR 94,440 | 254.232,48 | 0,21 |
| DE0006599905 | Merck KGaA Inhaber-Aktien | STK | | 745 | 0 | 0 | EUR 174,800 | 130.226,00 | 0,11 |
| NL0010773842 | NN Group N.V. Aandelen aan toonder | STK | | 2.110 | 8.160 | 9.339 | EUR 46,250 | 97.587,50 | 0,08 |
| FI0009014377 | Orion Corp. Reg.Shares Cl.B | STK | | 3.062 | 0 | 0 | EUR 37,760 | 115.621,12 | 0,09 |
| NL0000379121 | Randstad N.V. Aandelen aan toonder | STK | | 9.045 | 9.045 | 0 | EUR 52,800 | 477.576,00 | 0,39 |
| ES0173093024 | Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. | STK | | 31.045 | 14.223 | 0 | EUR 19,210 | 596.374,45 | 0,49 |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. Actions Port. | STK | | 7.339 | 6.377 | 0 | EUR 99,460 | 729.936,94 | 0,60 |
| IT0003153415 | Snam S.p.A. Azioni nom. | STK | | 20.567 | 0 | 16.177 | EUR 5,394 | 110.938,40 | 0,09 |
| DE0008303504 | TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien | STK | | 5.531 | 0 | 0 | EUR 16,810 | 92.976,11 | 0,08 |
| ES0178430E18 | Telefónica S.A. Acciones Port. | STK | | 27.378 | 27.378 | 0 | EUR 5,036 | 137.875,61 | 0,11 |
| FI0009005987 | UPM Kymmene Corp. Reg.Shares | STK | | 3.891 | 0 | 0 | EUR 33,040 | 128.558,64 | 0,11 |
| FR0000127771 | Vivendi SE Actions Porteur | STK | | 7.006 | 0 | 0 | EUR 11,015 | 77.171,09 | 0,06 |
| NL0000395903 | Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam | STK | | 679 | 0 | 0 | EUR 92,460 | 62.780,34 | 0,05 |
| AUD | | | | | | | | 1.087.814,13 | 0,89 |
| AU00000008XB1 | Brambles Ltd. Reg.Shares | STK | | 16.427 | 0 | 15.219 | AUD 10,880 | 119.555,40 | 0,10 |
| AU0000000MPL3 | Medibank Private Ltd. Reg.Shares | STK | | 170.871 | 170.871 | 0 | AUD 3,220 | 368.049,54 | 0,30 |
| AU0000000NAB4 | National Australia Bank Ltd. Reg.Shares | STK | | 9.714 | 9.714 | 0 | AUD 31,260 | 203.127,69 | 0,17 |
| AU0000000TLS2 | Telstra Corp. Ltd. Reg.Shares | STK | | 152.991 | 123.955 | 0 | AUD 3,880 | 397.081,50 | 0,32 |
| CAD | | | | | | | | 4.741.148,10 | 3,87 |
| CA0636711016 | Bank of Montreal Reg.Shares | STK | | 1.300 | 1.300 | 0 | CAD 137,410 | 131.229,11 | 0,11 |
| CA0553487604 | BCE Inc. Reg.Shares new | STK | | 7.800 | 2.600 | 0 | CAD 69,060 | 395.721,52 | 0,32 |
| CA1360691010 | Canadian Imperial Bk of Comm. Reg.Shares | STK | | 2.800 | 1.400 | 0 | CAD 69,950 | 143.884,57 | 0,12 |
| CA12532H1047 | CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg) | STK | | 7.300 | 3.600 | 0 | CAD 108,950 | 584.276,72 | 0,48 |
| CA19239C1068 | Cogeco Communications Inc. Reg.Shares (Sub. Vtg.) | STK | | 6.200 | 800 | 0 | CAD 105,980 | 482.707,55 | 0,39 |
| CA9611485090 | George Weston Ltd. Reg.Shares | STK | | 3.900 | 0 | 0 | CAD 154,390 | 442.335,98 | 0,36 |
| CA3759161035 | Gildan Activewear Inc. Reg.Shares (Sub.Vtg) | STK | | 2.700 | 2.700 | 0 | CAD 39,500 | 78.348,26 | 0,06 |
| CA4488112083 | Hydro One Ltd. Reg.Shares | STK | | 13.900 | 0 | 0 | CAD 35,230 | 359.745,97 | 0,29 |
| CA45823T1066 | Intact Financial Corp. Reg.Shares | STK | | 900 | 0 | 0 | CAD 181,690 | 120.127,38 | 0,10 |
| CA5394811015 | Loblaws Companies Ltd. Reg.Shares | STK | | 1.500 | 1.500 | 0 | CAD 116,230 | 128.079,02 | 0,10 |
| CA59162N1096 | Metro Inc. Reg.Shares | STK | | 8.100 | 2.600 | 0 | CAD 69,480 | 413.440,79 | 0,34 |
| CA7481932084 | Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg) | STK | | 5.700 | 0 | 5.400 | CAD 28,550 | 119.549,97 | 0,10 |
| CA7751092007 | Rogers Communications Inc. Reg.Shares Cl.B | STK | | 2.000 | 0 | 1.800 | CAD 64,950 | 95.428,40 | 0,08 |
| CA7800871021 | Royal Bank of Canada Reg.Shares | STK | | 5.800 | 700 | 0 | CAD 132,100 | 562.858,59 | 0,46 |
| CA8667961053 | Sun Life Financial Inc. Reg.Shares | STK | | 5.200 | 1.700 | 2.300 | CAD 63,860 | 243.949,96 | 0,20 |
| CA0641491075 | The Bank of Nova Scotia Reg.Shares | STK | | 4.400 | 0 | 0 | CAD 85,430 | 276.141,43 | 0,23 |
| CA8911021050 | Toromont Industries Ltd. Reg.Shares | STK | | 2.000 | 2.000 | 0 | CAD 111,160 | 163.322,88 | 0,13 |
| CHF | | | | | | | | 2.669.867,13 | 2,19 |
| CH0012829898 | Emmi AG Namens-Aktien | STK | | 99 | 0 | 0 | CHF 898,000 | 86.150,36 | 0,07 |
| CH0360674466 | Galenica AG Namens-Aktien | STK | | 1.826 | 1.826 | 0 | CHF 72,100 | 127.579,70 | 0,10 |
| CH0030170408 | Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.) | STK | | 451 | 0 | 0 | CHF 527,000 | 230.320,56 | 0,19 |
| CH0025238863 | Kühne & Nagel Internat. AG Namens-Aktien | STK | | 977 | 0 | 0 | CHF 253,600 | 240.098,46 | 0,20 |
| CH0038863350 | Nestlé S.A. Namens-Aktien | STK | | 3.208 | 455 | 0 | CHF 117,080 | 363.967,52 | 0,30 |
| CH0012005267 | Novartis AG Namens-Aktien | STK | | 1.516 | 0 | 0 | CHF 87,140 | 128.015,43 | 0,10 |
| CH0239229302 | SFS Group AG Nam.-Aktien | STK | | 1.110 | 1.110 | 0 | CHF 109,800 | 118.105,70 | 0,10 |
| CH0002497458 | SGS S.A. Namens-Aktien | STK | | 112 | 0 | 0 | CHF 2.395,000 | 259.937,59 | 0,21 |
| CH0008742519 | Swisscom AG Namens-Aktien | STK | | 1.507 | 306 | 0 | CHF 566,600 | 827.437,84 | 0,68 |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien | STK | | 681 | 291 | 0 | CHF 436,800 | 288.253,97 | 0,24 |
| DKK | | | | | | | | 582.689,64 | 0,48 |
| DK0060534915 | Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B | STK | | 4.256 | 0 | 0 | DKK 759,000 | 434.221,50 | 0,36 |
| DK0060636678 | Tryk AS Navne-Aktier | STK | | 6.820 | 0 | 0 | DKK 161,950 | 148.468,14 | 0,12 |
| GBP | | | | | | | | 1.564.153,63 | 1,28 |
| GB00B1YW4409 | 3i Group PLC Reg.Shares | STK | | 18.331 | 0 | 0 | GBP 12,830 | 276.160,69 | 0,23 |
| GB00B02J6398 | Admiral Group PLC Reg.Shares | STK | | 3.694 | 0 | 0 | GBP 22,070 | 95.730,05 | 0,08 |
| GB0009252882 | GSK PLC Reg.Shares | STK | | 22.419 | 22.419 | 0 | GBP 17,334 | 456.314,30 | 0,37 |
| GB0032089863 | NEXT PLC Reg.Shares | STK | | 999 | 0 | 0 | GBP 65,080 | 76.341,74 | 0,06 |
| GB0002405495 | Schroders PLC Reg.Shares | STK | | 3.235 | 0 | 3.273 | GBP 29,400 | 111.678,78 | 0,09 |
| GB0007908733 | SSE PLC Shares | STK | | 5.930 | 5.930 | 0 | GBP 17,595 | 122.516,06 | 0,10 |
| GB00BP92CJ43 | Tate & Lyle PLC Reg.Shares | STK | | 19.090 | 19.090 | 0 | GBP 7,445 | 166.888,40 | 0,14 |
| GB00BLGZ9862 | Tesco PLC Reg.Shs | STK | | 85.568 | 50.089 | 0 | GBP 2,573 | 258.523,61 | 0,21 |
| JPY | | | | | | | | 2.646.425,76 | 2,17 |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.05.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens *) |
|--------------|---|-------|------------------------------------|-----------------------|--|----------------------|----------------|----------------------|---------------------------------|
| JP3219000001 | Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares | | STK | 18.700 | 0 | 0 | JPY 2.553,000 | 348.170,22 | 0,28 |
| JP3496400007 | KDDI Corp. Reg.Shares | | STK | 23.700 | 5.600 | 3.600 | JPY 4.486,000 | 775.366,10 | 0,63 |
| JP3902400005 | Mitsubishi Electric Corp. Reg.Shares | | STK | 10.500 | 0 | 0 | JPY 1.416,000 | 108.430,57 | 0,09 |
| JP3756600007 | Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares | | STK | 600 | 0 | 0 | JPY 57.420,000 | 251.254,38 | 0,21 |
| JP3735400008 | Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares | | STK | 28.800 | 6.700 | 4.000 | JPY 3.911,000 | 821.446,91 | 0,67 |
| JP3421800008 | Secom Co. Ltd. Reg.Shares | | STK | 1.700 | 0 | 0 | JPY 8.497,000 | 105.344,95 | 0,09 |
| JP3431900004 | Sohgo Security Services Co.Ltd Reg.Shares | | STK | 4.500 | 0 | 0 | JPY 3.565,000 | 116.996,06 | 0,10 |
| JP3165000005 | Sompo Holdings Inc. Reg.Shares | | STK | 2.800 | 2.800 | 0 | JPY 5.848,000 | 119.416,57 | 0,10 |
| NOK | | | | | | | | 1.212.503,22 | 0,99 |
| NO0010161896 | DNB Bank ASA Navne-Aksjer | | STK | 6.836 | 6.836 | 0 | NOK 189,500 | 127.521,62 | 0,10 |
| NO0010582521 | Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer | | STK | 26.566 | 5.788 | 0 | NOK 203,000 | 530.878,04 | 0,43 |
| NO0003733800 | Orkla ASA Navne-Aksjer | | STK | 36.757 | 0 | 0 | NOK 73,300 | 265.226,30 | 0,22 |
| NO0010063308 | Telenor ASA Navne-Aksjer | | STK | 22.971 | 0 | 0 | NOK 127,750 | 288.877,26 | 0,24 |
| NZD | | | | | | | | 242.039,64 | 0,20 |
| NZTELE000154 | Spark New Zealand Ltd. Reg.Shares | | STK | 81.910 | 0 | 0 | NZD 4,860 | 242.039,64 | 0,20 |
| SEK | | | | | | | | 1.533.087,27 | 1,27 |
| SE0007100581 | Assa-Abloy AB Namn-Aktier B | | STK | 5.141 | 0 | 0 | SEK 243,200 | 118.616,14 | 0,10 |
| SE0006993770 | Axfood AB Namn-Aktier ¹⁾ | | STK | 22.229 | 3.135 | 0 | SEK 290,000 | 611.576,14 | 0,50 |
| SE0017859044 | AXFOOD AB Namn-Aktier (Em.05/2022) | | STK | 740 | 740 | 0 | SEK 288,000 | 20.218,87 | 0,02 |
| SE0000190126 | Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria) | | STK | 4.478 | 0 | 0 | SEK 257,100 | 109.224,17 | 0,09 |
| SE0007100599 | Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A | | STK | 24.116 | 0 | 0 | SEK 96,300 | 220.325,20 | 0,18 |
| SE0005190238 | Tele2 AB Namn-Aktier B | | STK | 24.776 | 10.365 | 0 | SEK 118,000 | 277.361,26 | 0,23 |
| SE0000667925 | Telia Company AB Namn-Aktier | | STK | 17.850 | 0 | 0 | SEK 39,880 | 67.534,54 | 0,06 |
| SE0000115420 | Volvo (publ), AB Namn-Aktier A (fria) | | STK | 6.289 | 0 | 0 | SEK 181,400 | 108.230,95 | 0,09 |
| USD | | | | | | | | 42.895.647,70 | 35,09 |
| US0028241000 | Abbott Laboratories Reg.Shares | | STK | 3.369 | 0 | 0 | USD 116,690 | 366.160,86 | 0,30 |
| US00287Y1091 | AbbVie Inc. Reg.Shares | | STK | 5.288 | 1.064 | 0 | USD 150,000 | 738.788,25 | 0,60 |
| IE0084BNMY34 | Accenture PLC Reg.Shares Cl.A | | STK | 1.814 | 0 | 0 | USD 304,150 | 513.880,78 | 0,42 |
| US00846U1016 | Agilent Technologies Inc. Reg.Shares | | STK | 1.564 | 0 | 0 | USD 130,550 | 190.173,89 | 0,16 |
| US00971T1016 | Akamai Technologies Inc. Reg.Shares | | STK | 2.864 | 0 | 0 | USD 102,730 | 274.035,97 | 0,22 |
| IE00BFR3W74 | Allegion PLC Reg.Shares | | STK | 2.155 | 0 | 0 | USD 113,540 | 227.894,29 | 0,19 |
| US03073E1055 | AmerisourceBergens Corp. Reg.Shares | | STK | 2.442 | 766 | 0 | USD 156,860 | 356.775,60 | 0,29 |
| US0311621009 | Amgen Inc. Reg.Shares | | STK | 2.892 | 348 | 0 | USD 255,260 | 687.572,23 | 0,56 |
| US0326541051 | Analog Devices Inc. Reg.Shares | | STK | 1.339 | 0 | 0 | USD 167,550 | 208.959,58 | 0,17 |
| US0367521038 | Anthem Inc. Reg.Shares | | STK | 762 | 762 | 0 | USD 520,550 | 369.449,17 | 0,30 |
| US0378331005 | Apple Inc. Reg.Shares | | STK | 1.450 | 1.450 | 0 | USD 149,640 | 202.093,79 | 0,17 |
| US0530151036 | Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares | | STK | 3.415 | 411 | 0 | USD 224,660 | 714.584,73 | 0,58 |
| US0718131099 | Baxter International Inc. Reg.Shares | | STK | 2.324 | 0 | 0 | USD 76,160 | 164.854,32 | 0,13 |
| US0758871091 | Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares | | STK | 2.528 | 1.912 | 0 | USD 256,460 | 603.856,82 | 0,49 |
| US0865161014 | Best Buy Co. Inc. Reg.Shares | | STK | 1.725 | 0 | 1.542 | USD 83,990 | 134.944,12 | 0,11 |
| US1046741062 | Brady Corp. Reg.N.Vot.Shs Cl.A | | STK | 5.456 | 0 | 0 | USD 49,990 | 254.035,71 | 0,21 |
| US1101221083 | Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares | | STK | 13.087 | 1.576 | 0 | USD 76,140 | 988.090,33 | 0,76 |
| US12541W2098 | C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new) | | STK | 7.273 | 1.404 | 0 | USD 107,450 | 727.875,80 | 0,60 |
| US1273871087 | Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares | | STK | 611 | 0 | 0 | USD 156,240 | 88.914,12 | 0,07 |
| US1423391002 | Carlisle Cos. Inc. Reg.Shares | | STK | 700 | 0 | 0 | USD 253,590 | 165.336,00 | 0,14 |
| US12503M1080 | Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares | | STK | 1.187 | 1.187 | 0 | USD 111,300 | 123.050,44 | 0,10 |
| US12504L1098 | CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A | | STK | 2.954 | 2.954 | 0 | USD 84,050 | 231.251,99 | 0,19 |
| US1567821046 | Cerner Corp. Reg.Shares | | STK | 7.836 | 1.596 | 0 | USD 94,680 | 691.018,94 | 0,57 |
| US17275R1023 | Cisco Systems Inc. Reg.Shares | | STK | 19.693 | 3.954 | 0 | USD 45,620 | 836.766,79 | 0,68 |
| US1924461023 | Cognizant Technology Sol. Corp. Reg.Shs Cl.A | | STK | 8.249 | 4.037 | 0 | USD 74,730 | 574.160,83 | 0,47 |
| US1941621039 | Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares | | STK | 11.481 | 1.382 | 0 | USD 78,860 | 843.283,81 | 0,69 |
| US2310211063 | Cummins Inc. Reg.Shares | | STK | 1.944 | 0 | 0 | USD 207,970 | 376.560,03 | 0,31 |
| US1266501006 | CVS Health Corp. Reg.Shares | | STK | 1.715 | 1.715 | 0 | USD 98,050 | 156.620,64 | 0,13 |
| US28176E1082 | Edwards Lifesciences Corp. Reg.Shares | | STK | 1.507 | 0 | 1.663 | USD 101,120 | 141.934,37 | 0,12 |
| US2855121099 | Electronic Arts Inc. Reg.Shares | | STK | 5.443 | 1.965 | 0 | USD 138,530 | 702.294,78 | 0,57 |
| US5324571083 | Eli Lilly and Company Reg.Shares | | STK | 589 | 0 | 0 | USD 323,480 | 177.459,81 | 0,15 |
| US29082K1051 | Embecka Corp. Reg.Shares | | STK | 505 | 506 | 1 | USD 26,340 | 12.389,23 | 0,01 |
| US2910111044 | Emerson Electric Co. Reg.Shares | | STK | 4.421 | 2.798 | 0 | USD 88,400 | 364.007,26 | 0,30 |
| US3021301094 | Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares | | STK | 6.708 | 616 | 0 | USD 110,650 | 691.324,17 | 0,57 |
| US3434981011 | Flowers Foods Inc. Reg.Shares | | STK | 19.439 | 8.288 | 0 | USD 27,330 | 494.824,08 | 0,40 |
| US3535141028 | Franklin Electric Co. Inc. Reg.Shares | | STK | 7.939 | 1.651 | 0 | USD 74,030 | 547.407,60 | 0,45 |
| US3029411093 | FTI Consulting Inc. Reg.Shares | | STK | 2.657 | 2.657 | 0 | USD 167,080 | 413.478,84 | 0,34 |
| US3703341046 | General Mills Inc. Reg.Shares | | STK | 16.797 | 3.210 | 0 | USD 69,890 | 1.093.412,50 | 0,89 |
| US3755581036 | Gilead Sciences Inc. Reg.Shares | | STK | 8.203 | 988 | 0 | USD 64,800 | 495.090,95 | 0,40 |
| US8064071025 | Henry Schein Inc. Reg.Shares | | STK | 5.605 | 0 | 0 | USD 85,960 | 448.754,99 | 0,37 |
| US4364401012 | Hologic Inc. Reg.Shares | | STK | 3.591 | 3.591 | 0 | USD 77,460 | 259.077,78 | 0,21 |
| US4404521001 | Hormel Foods Corp. Reg.Shares | | STK | 7.229 | 0 | 0 | USD 48,630 | 327.430,98 | 0,27 |
| US4435106079 | Hubbell Inc. Reg.Shares | | STK | 2.651 | 319 | 0 | USD 192,450 | 475.187,40 | 0,39 |
| US4523081093 | Illinois Tool Works Inc. Reg.Shares | | STK | 3.671 | 716 | 295 | USD 206,740 | 706.880,77 | 0,58 |
| US4581401001 | Intel Corp. Reg.Shares | | STK | 6.020 | 0 | 0 | USD 44,550 | 249.793,69 | 0,20 |
| US4606901001 | Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares | | STK | 14.012 | 14.012 | 0 | USD 32,280 | 421.280,08 | 0,34 |
| US4592001014 | Intl Business Machines Corp. Reg.Shares | | STK | 2.261 | 2.261 | 0 | USD 139,270 | 293.288,75 | 0,24 |
| US4612021034 | Intuit Inc. Reg.Shares | | STK | 237 | 0 | 219 | USD 422,480 | 93.259,22 | 0,08 |
| US8326964058 | J.M. Smucker Co. Reg.Shares | | STK | 1.754 | 0 | 0 | USD 125,550 | 205.108,46 | 0,17 |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.05.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|---------------------------------|---|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------------|----------------------|-------------------------|
| JE00BYPZJM29 | Janus Henderson Group PLC Reg.Shares | STK | | 4.613 | 0 | 0 | USD 28,450 | 122.237,09 | 0,10 |
| US46625H1005 | JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares | STK | | 2.205 | 2.205 | 0 | USD 131,270 | 269.594,70 | 0,22 |
| US4878361082 | Kellogg Co. Reg.Shares | STK | | 10.505 | 3.143 | 0 | USD 69,810 | 683.047,59 | 0,56 |
| US4943681035 | Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares | STK | | 4.761 | 687 | 946 | USD 133,430 | 591.682,79 | 0,48 |
| US49926D1090 | Knowles Corp. Reg.Shares | STK | | 14.348 | 14.348 | 0 | USD 19,280 | 257.653,28 | 0,21 |
| US50540R4092 | Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares | STK | | 1.919 | 759 | 0 | USD 257,870 | 460.906,75 | 0,38 |
| US5150981018 | Landstar System Inc. Reg.Shares | STK | | 2.054 | 0 | 0 | USD 152,920 | 292.551,28 | 0,24 |
| US5717481023 | Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares | STK | | 4.808 | 963 | 0 | USD 161,190 | 721.838,14 | 0,59 |
| US5745991068 | Masco Corp. Reg.Shares | STK | | 12.684 | 2.570 | 0 | USD 57,840 | 683.316,31 | 0,56 |
| US58933Y1055 | Merck & Co. Inc. Reg.Shares | STK | | 12.916 | 2.583 | 0 | USD 93,080 | 1.119.751,58 | 0,92 |
| US5926881054 | Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares | STK | | 96 | 0 | 0 | USD 1.326,520 | 118.610,27 | 0,10 |
| US5949181045 | Microsoft Corp. Reg.Shares | STK | | 4.182 | 874 | 264 | USD 273,240 | 1.064.303,71 | 0,87 |
| US6200763075 | Motorola Solutions Inc. Reg.Shares | STK | | 2.186 | 337 | 611 | USD 223,010 | 454.058,45 | 0,37 |
| US68389X1054 | Oracle Corp. Reg.Shares | STK | | 8.819 | 1.829 | 0 | USD 72,780 | 597.817,56 | 0,49 |
| US68622V1061 | Organon & Co. Reg.Shares | STK | | 1.033 | 0 | 0 | USD 38,900 | 37.427,19 | 0,03 |
| US6937181088 | Paccar Inc. Reg.Shares | STK | | 2.197 | 0 | 2.615 | USD 85,670 | 175.305,72 | 0,14 |
| US7043261079 | Paychex Inc. Reg.Shares | STK | | 4.782 | 576 | 0 | USD 124,080 | 552.648,03 | 0,45 |
| US7134481081 | PepsiCo Inc. Reg.Shares | STK | | 3.565 | 429 | 0 | USD 171,770 | 570.353,51 | 0,47 |
| US74051N1028 | Premier Inc. Reg.Shares | STK | | 12.946 | 8.648 | 0 | USD 38,240 | 461.095,37 | 0,38 |
| US7433121008 | Progress Software Corp. Reg.Shares | STK | | 15.418 | 9.358 | 0 | USD 43,350 | 694.323,38 | 0,57 |
| US7433151039 | Progressive Corp. Reg.Shares | STK | | 1.567 | 0 | 0 | USD 120,340 | 175.637,11 | 0,14 |
| US74834L1008 | Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares | STK | | 5.060 | 456 | 446 | USD 145,390 | 685.207,84 | 0,56 |
| US75886F1075 | Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares | STK | | 549 | 549 | 0 | USD 692,800 | 354.256,23 | 0,29 |
| US7703231032 | Robert Half International Inc. Reg.Shares | STK | | 1.335 | 1.335 | 0 | USD 89,370 | 111.124,62 | 0,09 |
| US8330341012 | Snap-on Inc. Reg.Shares | STK | | 2.596 | 2.596 | 0 | USD 222,900 | 538.954,41 | 0,44 |
| US8354951027 | Sonoco Products Co. Reg.Shares | STK | | 6.855 | 1.412 | 4.869 | USD 59,140 | 377.594,84 | 0,31 |
| IE00BFY8C754 | Steris PLC Reg.Shares | STK | | 776 | 0 | 0 | USD 235,000 | 169.850,51 | 0,14 |
| US74144T1088 | T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares | STK | | 1.497 | 382 | 1.673 | USD 129,890 | 181.106,81 | 0,15 |
| US8825081040 | Texas Instruments Inc. Reg.Shares | STK | | 6.364 | 1.282 | 0 | USD 177,970 | 1.054.907,17 | 0,86 |
| US1912161007 | The Coca-Cola Co. Reg.Shares | STK | | 7.053 | 4.399 | 0 | USD 64,680 | 424.894,56 | 0,35 |
| US4278661081 | The Hershey Co. Reg.Shares | STK | | 4.885 | 1.113 | 802 | USD 212,610 | 967.354,21 | 0,79 |
| US4370761029 | The Home Depot Inc. Reg.Shares | STK | | 1.508 | 298 | 1.263 | USD 308,460 | 433.248,90 | 0,35 |
| US5010441013 | The Kroger Co. Reg.Shares | STK | | 5.260 | 0 | 0 | USD 52,960 | 259.460,35 | 0,21 |
| US7427181091 | The Procter & Gamble Co. Reg.Shares | STK | | 7.015 | 598 | 0 | USD 148,720 | 971.704,75 | 0,79 |
| US8725401090 | TJX Companies Inc. Reg.Shares | STK | | 1.701 | 0 | 0 | USD 64,590 | 102.330,92 | 0,08 |
| IE00BK9ZQ967 | Trane Technologies PLC Reg.Shares | STK | | 747 | 0 | 518 | USD 140,500 | 97.753,92 | 0,08 |
| US9113121068 | United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B | STK | | 2.577 | 857 | 0 | USD 182,530 | 438.112,80 | 0,36 |
| US91324P1021 | UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares | STK | | 1.310 | 415 | 0 | USD 507,110 | 618.743,63 | 0,51 |
| US92343V1044 | Verizon Communications Inc. Reg.Shares | STK | | 23.795 | 8.055 | 0 | USD 51,400 | 1.139.163,60 | 0,93 |
| US92532F1003 | Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares | STK | | 2.350 | 283 | 0 | USD 273,730 | 599.138,92 | 0,49 |
| US3848021040 | W.W. Grainger Inc. Reg.Shares | STK | | 1.792 | 358 | 0 | USD 490,390 | 818.496,61 | 0,67 |
| US94106L1098 | Waste Management Inc. (Del.) Reg.Shares | STK | | 1.364 | 0 | 0 | USD 161,000 | 204.539,65 | 0,17 |
| US9418481035 | Waters Corp. Reg.Shares | STK | | 1.515 | 182 | 0 | USD 335,060 | 472.794,58 | 0,39 |
| US9427491025 | Watts Water Technologies Inc. Reg.Shares Cl.A | STK | | 804 | 0 | 1.033 | USD 131,450 | 98.435,99 | 0,08 |
| US9507551086 | Werner Enterprises Inc. Reg.Shares | STK | | 15.655 | 10.725 | 0 | USD 40,770 | 594.471,52 | 0,49 |
| US9884981013 | Yum! Brands, Inc. Reg.Shares | STK | | 6.393 | 1.323 | 0 | USD 119,770 | 713.165,01 | 0,58 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | 28.000.315,49 | 22,90 |
| EUR | | | | | | | | 26.047.838,70 | 21,30 |
| FR0013302197 | 1,0000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 17/27 | EUR | | 500.000 | 500.000 | 0 | % 93,283 | 466.412,50 | 0,38 |
| XS1533922263 | 1,2500 % Avery Dennison Corp. Notes 17/25 | EUR | | 300.000 | 0 | 0 | % 98,178 | 294.532,50 | 0,24 |
| XS2079713322 | 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26 ¹⁾ | EUR | | 500.000 | 0 | 0 | % 93,536 | 467.680,00 | 0,38 |
| DE0001102333 | 1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24 ¹⁾ | EUR | | 500.000 | 0 | 0 | % 102,526 | 512.630,00 | 0,42 |
| DE0001102390 | 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26 ¹⁾ | EUR | | 2.000.000 | 1.000.000 | 0 | % 99,479 | 1.989.580,00 | 1,63 |
| DE0001102507 | 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30 ¹⁾ | EUR | | 3.000.000 | 2.000.000 | 0 | % 92,485 | 2.774.550,00 | 2,27 |
| XS2258986269 | 2,1250 % Cromwell Ereit Lx.Fin. S.à.r.l MTN 20/25 | EUR | | 500.000 | 500.000 | 0 | % 93,500 | 467.500,00 | 0,38 |
| BE0002276450 | 1,3750 % Elia Transm. Belgium S.A./N.V. MTN 17/27 | EUR | | 400.000 | 400.000 | 0 | % 97,186 | 388.742,00 | 0,32 |
| XS1403388694 | 1,3750 % Enagás Financiaciones S.A.U. MTN 16/28 ¹⁾ | EUR | | 500.000 | 500.000 | 0 | % 97,144 | 485.717,50 | 0,40 |
| ES0205032024 | 1,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 17/25 | EUR | | 300.000 | 0 | 0 | % 99,853 | 299.557,50 | 0,24 |
| XS1822829799 | 1,7500 % GlaxoSmithKline Cap. PLC MTN 18/30 | EUR | | 500.000 | 500.000 | 0 | % 97,681 | 488.402,50 | 0,40 |
| XS1577951129 | 1,3750 % Goodman Australia Fin.Pty Ltd. Notes 17/25 Reg.S | EUR | | 400.000 | 0 | 0 | % 95,646 | 382.584,00 | 0,31 |
| XS2047479469 | 0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27 ¹⁾ | EUR | | 500.000 | 0 | 0 | % 88,808 | 444.042,00 | 0,36 |
| FR0013512233 | 2,0000 % Klépierre S.A. MTN 20/29 | EUR | | 700.000 | 700.000 | 0 | % 93,420 | 653.940,00 | 0,53 |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.05.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|---|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-------------|----------------------|-------------------------|
| BE0000335449 | 1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.75 15/31 ¹⁾ | | EUR | 3.000.000 | 1.500.000 | 0 | % 95,834 | 2.875.005,00 | 2,35 |
| ES0000012G34 | 1,2500 % Königreich Spanien Obligaciones 20/30 | | EUR | 3.000.000 | 1.000.000 | 0 | % 94,932 | 2.847.960,00 | 2,33 |
| FR0013321080 | 1,0000 % Legrand S.A. Obl. 18/26 | | EUR | 400.000 | 0 | 0 | % 97,423 | 389.692,00 | 0,32 |
| XS1963837197 | 1,9790 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Bonds 19/30 | | EUR | 500.000 | 500.000 | 0 | % 95,367 | 476.835,00 | 0,39 |
| XS1511787589 | 1,3750 % Morgan Stanley MTN S.G 16/26 | | EUR | 600.000 | 0 | 0 | % 96,861 | 581.166,00 | 0,48 |
| XS1396767854 | 1,2500 % Naturgy Finance B.V. MTN 16/26 | | EUR | 300.000 | 0 | 0 | % 96,763 | 290.289,00 | 0,24 |
| XS1974922525 | 2,0000 % Norsk Hydro ASA Bonds 19/29 | | EUR | 500.000 | 500.000 | 0 | % 92,567 | 462.832,50 | 0,38 |
| XS1861322383 | 1,8750 % Prologis Euro Finance LLC Notes 18/29 | | EUR | 400.000 | 400.000 | 0 | % 94,965 | 379.860,00 | 0,31 |
| FI4000148630 | 0,7500 % Republik Finnland Bonds 15/31 | | EUR | 3.000.000 | 1.500.000 | 0 | % 94,153 | 2.824.590,00 | 2,31 |
| IT0005090318 | 1,5000 % Republik Italien B.T.P. 15/25 | | EUR | 1.000.000 | 500.000 | 0 | % 99,610 | 996.100,00 | 0,81 |
| IT0005422891 | 0,9000 % Republik Italien B.T.P. 20/31 | | EUR | 3.000.000 | 1.000.000 | 0 | % 84,208 | 2.526.240,00 | 2,07 |
| XS2291340433 | 0,7500 % Sagax EURO MTN NL B.V. MTN 21/28 ¹⁾ | | EUR | 500.000 | 0 | 0 | % 82,649 | 413.242,50 | 0,34 |
| XS1652866002 | 1,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA MTN 17/27 | | EUR | 500.000 | 500.000 | 0 | % 96,757 | 483.785,00 | 0,40 |
| XS1405775534 | 1,3750 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 16/28 | | EUR | 400.000 | 0 | 0 | % 96,093 | 384.371,20 | 0,31 |
| USD | | | | | | | | 1.952.476,79 | 1,60 |
| US111021AL54 | 5,1250 % British Telecommunications PLC Notes 18/28 | | USD | 200.000 | 0 | 0 | % 103,410 | 192.632,61 | 0,16 |
| US120568AX84 | 3,2500 % Bunge Ltd. Finance Corp. Notes 16/26 | | USD | 400.000 | 0 | 0 | % 97,075 | 361.662,74 | 0,30 |
| US404119BU21 | 4,5000 % HCA Inc. Notes 16/27 | | USD | 300.000 | 0 | 0 | % 101,820 | 284.504,73 | 0,23 |
| US40480HAA59 | 1,3750 % HCL America Inc. Notes 21/26 144A | | USD | 500.000 | 500.000 | 0 | % 90,746 | 422.605,13 | 0,35 |
| US780641AH94 | 8,3750 % Kon. KPN N.V. Notes 00/30 | | USD | 300.000 | 0 | 0 | % 123,855 | 346.076,47 | 0,28 |
| US501044BZ37 | 7,5000 % The Kroger Co. Bonds 01/31 | | USD | 300.000 | 0 | 0 | % 123,468 | 344.995,11 | 0,28 |
| Sonstige Beteiligungswertpapiere | | | | | | | | 567.337,64 | 0,46 |
| CHF | | | | | | | | 567.337,64 | 0,46 |
| CH0012032048 | Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine | | STK | 1.776 | 746 | 0 | CHF 329,650 | 567.337,64 | 0,46 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | | 10.118.436,07 | 8,25 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | 10.118.436,07 | 8,25 |
| EUR | | | | | | | | 2.230.030,00 | 1,82 |
| XS2338570331 | 0,8750 % EQT AB Notes 21/31 Reg.S | | EUR | 500.000 | 0 | 0 | % 78,578 | 392.887,50 | 0,32 |
| XS1843442622 | 1,7500 % Nasdaq Inc. Notes 19/29 | | EUR | 500.000 | 500.000 | 0 | % 93,451 | 467.252,50 | 0,38 |
| XS2356076625 | 1,1250 % Sirius Real Estate Ltd. Bonds 21/26 | | EUR | 600.000 | 0 | 0 | % 89,810 | 538.860,00 | 0,44 |
| DE000A3H3J22 | 0,3750 % Vantage Towers AG MTN 21/27 | | EUR | 500.000 | 0 | 0 | % 90,482 | 452.410,00 | 0,37 |
| XS1785458172 | 2,1250 % WPC Eurobond B.V. Notes 18/27 | | EUR | 400.000 | 400.000 | 0 | % 94,655 | 378.620,00 | 0,31 |
| USD | | | | | | | | 7.888.406,07 | 6,43 |
| US00287YAR09 | 4,5000 % AbbVie Inc. Notes 15/35 | | USD | 350.000 | 0 | 0 | % 101,975 | 332.429,10 | 0,27 |
| US00973RAE36 | 3,0000 % Aker BP ASA Notes 20/25 144A | | USD | 500.000 | 0 | 0 | % 98,148 | 457.074,47 | 0,37 |
| US03040WAW99 | 3,4500 % American Water Capital Corp. Notes 19/29 | | USD | 600.000 | 0 | 0 | % 97,013 | 542.148,74 | 0,44 |
| US04685A2P53 | 2,4500 % Athene Global Funding MTN 20/27 144A | | USD | 500.000 | 0 | 0 | % 91,994 | 428.417,08 | 0,35 |
| US05723KAG58 | 3,1380 % Bak.Hug.Hldgs LLC/Co-Obli.Inc. Notes 19/29 | | USD | 300.000 | 300.000 | 0 | % 93,586 | 261.498,63 | 0,21 |
| US09261XAB82 | 2,7500 % Blackstone/GSO Secured Len.Fd Notes 21/26 | | USD | 500.000 | 0 | 0 | % 91,472 | 425.988,45 | 0,35 |
| US115236AB74 | 4,5000 % Brown & Brown Inc. Notes 19/29 | | USD | 600.000 | 600.000 | 0 | % 100,480 | 561.521,54 | 0,46 |
| US12527GAD51 | 4,9500 % CF Industries Inc. Notes 13/43 | | USD | 600.000 | 600.000 | 0 | % 96,644 | 540.083,83 | 0,44 |
| US169905AF36 | 3,7000 % Choice Hotels Intl Inc. Notes 19/29 | | USD | 500.000 | 500.000 | 0 | % 92,822 | 432.273,09 | 0,35 |
| US26441YBA47 | 3,3750 % Duke Realty L.P. Notes 17/27 | | USD | 500.000 | 500.000 | 0 | % 97,255 | 452.917,62 | 0,37 |
| US278865BJ87 | 2,7500 % Ecolab Inc. Notes 21/55 | | USD | 25.000 | 475.000 | 450.000 | % 74,049 | 17.242,24 | 0,01 |
| US29446MAJ18 | 1,7500 % Equinor ASA Notes 20/26 | | USD | 500.000 | 0 | 0 | % 93,906 | 437.318,96 | 0,36 |
| US30212PBK03 | 4,6250 % Expedia Group Inc. Notes 20/27 | | USD | 600.000 | 600.000 | 0 | % 100,077 | 559.268,85 | 0,46 |
| US40434LAB18 | 3,0000 % HP Inc. Notes 20/27 | | USD | 400.000 | 0 | 0 | % 94,701 | 352.818,89 | 0,29 |
| US40434LAC90 | 3,4000 % HP Inc. Notes 20/30 | | USD | 400.000 | 0 | 0 | % 89,890 | 334.894,98 | 0,27 |
| US46188BAB80 | 2,3000 % Invitation Homes Op.Partn.LP Notes 21/28 | | USD | 500.000 | 500.000 | 0 | % 87,673 | 408.295,53 | 0,33 |
| US55336VAR15 | 4,0000 % MPLX L.P. Notes 18/28 | | USD | 400.000 | 0 | 0 | % 98,115 | 365.538,12 | 0,30 |
| US871829BL07 | 5,9500 % Sysco Corp. Notes 20/30 | | USD | 199.000 | 0 | 0 | % 110,667 | 205.120,23 | 0,17 |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.05.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) | |
|---|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|--------------------|-------------------------|--------------|
| US38141EC238 | 3,8500 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 14/24 | | USD | 300.000 | 0 | 0 | % 101,209 | 282.797,47 | 0,23 | |
| US95040QAL86 | 2,7500 % Welltower Inc. Notes 20/31 | | USD | 600.000 | 0 | 0 | % 87,817 | 490.758,25 | 0,40 | |
| Neuemissionen | | | | | | | | 406.228,75 | 0,33 | |
| Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen | | | | | | | | 406.228,75 | 0,33 | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | 406.228,75 | 0,33 | |
| USD | | | | | | | | 406.228,75 | 0,33 | |
| US55037AAB44 | 3,1000 % Lundin Energy Finance B.V. Notes 21/31 144A | | USD | 500.000 | 0 | 0 | % 87,229 | 406.228,75 | 0,33 | |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | EUR | 103.466.165,18 | 84,63 |
| Derivate | | | | | | | | | | |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | | | | |
| Aktienindex-Derivate | | | | | | | | | | |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten | | | | | | | | | | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | | | | | 187.895,32 | 0,15 | |
| DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Juni 22 | | XEUR | EUR | Anzahl 6 | | | | 9.060,00 | 0,01 | |
| E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Juni 22 | | XCME | USD | Anzahl -10 | | | | 14.232,52 | 0,01 | |
| FTSE 100 Index Future (FFI) Juni 22 | | IFEU | GBP | Anzahl 14 | | | | 66.660,40 | 0,05 | |
| OMX Index Future (O30) Juni 22 | | XNDX | SEK | Anzahl -29 | | | | -5.131,09 | 0,00 | |
| OMXC25 Index Future (OMW) Juni 22 | | XNDX | DKK | Anzahl 8 | | | | 3.263,75 | 0,00 | |
| S&P Canada 60 Index Future (SXF) Juni 22 | | XMOD | CAD | Anzahl -13 | | | | 22.922,11 | 0,02 | |
| SPI 200 Index Future (YAP) Juni 22 | | XSFE | AUD | Anzahl 3 | | | | 6.722,77 | 0,01 | |
| Swiss Market Index Future (S30) Juni 22 | | XEUR | CHF | Anzahl -11 | | | | -8.488,87 | -0,01 | |
| Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Juni 22 | | XOSE | JPY | Anzahl 11 | | | | 78.653,73 | 0,06 | |
| Summe Aktienindex-Derivate | | | | | | | | EUR | 187.895,32 | 0,15 |
| Zins-Derivate | | | | | | | | | | |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten | | | | | | | | | | |
| Zinsterminkontrakte | | | | | | | | 713.315,22 | 0,57 | |
| 10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Juni 22 | | XEUR | EUR | -500.000 | | | | 78.250,00 | 0,06 | |
| EURO Bobl Future (FGBM) Juni 22 | | XEUR | EUR | -3.900.000 | | | | 103.050,00 | 0,08 | |
| EURO Bund Future (FGBL) Juni 22 | | XEUR | EUR | -3.600.000 | | | | 405.790,00 | 0,33 | |
| EURO-BTP Future (FBTP) Juni 22 | | XEUR | EUR | -600.000 | | | | 109.460,00 | 0,09 | |
| Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 22 | | XCBT | USD | -4.800.000 | | | | 2.095,64 | 0,00 | |
| Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 22 | | XCBT | USD | -5.200.000 | | | | 14.378,52 | 0,01 | |
| Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 22 | | XCBT | USD | -1.000.000 | | | | 291,06 | 0,00 | |
| Summe Zins-Derivate | | | | | | | | EUR | 713.315,22 | 0,57 |
| Devisen-Derivate | | | | | | | | | | |
| Forderungen/ Verbindlichkeiten | | | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte (Kauf) | | | | | | | | -106.573,49 | -0,08 | |
| Offene Positionen | | | | | | | | | | |
| AUD/EUR 800.000,00 | | OTC | | | | | | -155,62 | 0,00 | |
| CAD/EUR 400.000,00 | | OTC | | | | | | 921,95 | 0,00 | |
| GBP/EUR 900.000,00 | | OTC | | | | | | -28.503,98 | -0,02 | |
| JPY/EUR 150.000.000,00 | | OTC | | | | | | -78.835,84 | -0,06 | |
| Devisenterminkontrakte (Verkauf) | | | | | | | | -347.664,48 | -0,29 | |
| Offene Positionen | | | | | | | | | | |
| AUD/EUR 450.000,00 | | OTC | | | | | | 3.015,02 | 0,00 | |
| CAD/EUR 4.100.000,00 | | OTC | | | | | | -68.753,86 | -0,06 | |
| CHF/EUR 1.600.000,00 | | OTC | | | | | | 26.650,49 | 0,02 | |
| GBP/EUR 300.000,00 | | OTC | | | | | | 3.739,31 | 0,00 | |
| SEK/EUR 15.000.000,00 | | OTC | | | | | | -21.974,38 | -0,02 | |
| USD/EUR 13.700.000,00 | | OTC | | | | | | -290.341,06 | -0,23 | |
| Summe Devisen-Derivate | | | | | | | | EUR | -454.237,97 | -0,37 |
| Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | | | | | | | | | | |
| Bankguthaben | | | | | | | | | | |
| EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle | | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | EUR | 14.195.130,17 | | | % 100,000 | 14.195.130,17 | 11,61 | |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | DKK | 410.318,26 | | | % 100,000 | 55.155,49 | 0,05 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | NOK | 464.305,27 | | | % 100,000 | 45.706,31 | 0,04 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | SEK | 1.287.461,18 | | | % 100,000 | 122.142,48 | 0,10 | |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | AUD | 168.984,44 | | | % 100,000 | 113.039,12 | 0,09 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | CAD | 212.449,23 | | | % 100,000 | 156.071,52 | 0,13 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | CHF | 249.789,57 | | | % 100,000 | 242.058,23 | 0,20 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | GBP | 222.853,68 | | | % 100,000 | 261.678,99 | 0,21 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | HKD | 68.506,42 | | | % 100,000 | 8.130,46 | 0,01 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | JPY | 44.311.032,00 | | | % 100,000 | 323.155,13 | 0,26 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | NZD | 32.336,01 | | | % 100,000 | 19.660,73 | 0,02 | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | | USD | 946.587,45 | | | % 100,000 | 881.653,66 | 0,72 | |
| Summe Bankguthaben | | | | | | | | EUR | 16.423.582,29 | 13,44 |
| Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds | | | | | | | | EUR | 16.423.582,29 | 13,44 |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 31.05.2022 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens *) |
|--------------------------------------|--|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------|-----------------------|-------------------------|
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | |
| | Zinsansprüche | | EUR | 242.808,43 | | | | 242.808,43 | 0,20 |
| | Dividendenansprüche | | EUR | 105.887,33 | | | | 105.887,33 | 0,09 |
| | Einschüsse (Initial Margins) | | EUR | 929.631,29 | | | | 929.631,29 | 0,74 |
| | Forderungen aus Wertpapier-Darlehen | | EUR | 973,35 | | | | 973,35 | 0,00 |
| | Forderungen aus Anteilscheingeschäften | | EUR | 154.454,00 | | | | 154.454,00 | 0,13 |
| | Forderungen aus Kapitalmaßnahmen | | EUR | 10.956,44 | | | | 10.956,44 | 0,01 |
| | Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung | | EUR | 33.777,17 | | | | 33.777,17 | 0,03 |
| | Forderungen aus Cash Collateral | | EUR | 620.000,00 | | | | 620.000,00 | 0,51 |
| | Summe Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | EUR | 2.098.488,01 | 1,71 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| | Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen | | EUR | -321,22 | | | | -321,22 | 0,00 |
| | Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften | | EUR | -1.491,28 | | | | -1.491,28 | 0,00 |
| | Verbindlichkeiten aus Derivategeschäften | | EUR | -275,60 | | | | -275,60 | 0,00 |
| | Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten | | EUR | -161.637,64 | | | | -161.637,64 | -0,13 |
| | Summe Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | EUR | -163.725,74 | -0,13 |
| | Fondsvermögen | | | | | | EUR | 122.271.482,31 | 100,00 |
| | Umlaufende Anteile | | | | | | STK | 1.149.465,000 | |
| | Anteilwert | | | | | | EUR | 106,37 | |

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

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

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Nominal in Währung | Wertpapier-Darlehen in EUR | | gesamt |
|--|-------------------------------|----------------------------|----------------------|----------------------|
| | | befristet | unbefristet | |
| Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert) | | | | |
| Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: | | | | |
| Axfood AB Namn-Aktier | STK 22.229 | | 611.576,14 | |
| 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26 | EUR 500.000 | | 467.680,00 | |
| 1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24 | EUR 500.000 | | 512.630,00 | |
| 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26 | EUR 2.000.000 | | 1.989.580,00 | |
| 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30 | EUR 3.000.000 | | 2.774.550,00 | |
| 1,3750 % Enagás Financiaciones S.A.U. MTN 16/28 | EUR 500.000 | | 485.717,50 | |
| 0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27 | EUR 500.000 | | 444.042,00 | |
| 1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.75 15/31 | EUR 3.000.000 | | 2.875.005,00 | |
| 0,7500 % Sagax EURO MTN NL B.V. MTN 21/28 | EUR 500.000 | | 413.242,50 | |
| Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen: | EUR | | 10.574.023,14 | 10.574.023,14 |

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.05.2022

| | | |
|-------------------------------|-------|--------------------------|
| Vereinigtes Königreich, Pfund | (GBP) | 0,85163 = 1 Euro (EUR) |
| Dänemark, Kronen | (DKK) | 7,43930 = 1 Euro (EUR) |
| Norwegen, Kronen | (NOK) | 10,15845 = 1 Euro (EUR) |
| Schweden, Kronen | (SEK) | 10,54065 = 1 Euro (EUR) |
| Schweiz, Franken | (CHF) | 1,03194 = 1 Euro (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar | (USD) | 1,07365 = 1 Euro (EUR) |
| Kanada, Dollar | (CAD) | 1,36123 = 1 Euro (EUR) |
| Japan, Yen | (JPY) | 137,12000 = 1 Euro (EUR) |
| Hongkong, Dollar | (HKD) | 8,42590 = 1 Euro (EUR) |
| Australien, Dollar | (AUD) | 1,49492 = 1 Euro (EUR) |
| Neuseeland, Dollar | (NZD) | 1,64470 = 1 Euro (EUR) |

Marktschlüssel

| Terminbörsen | |
|--------------|---|
| IFEU | London - ICE Futures Europe |
| XSFE | Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24 |
| XEUR | Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich) |
| XOSE | Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options |
| XCME | Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) |
| XCBT | Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT) |
| XMOD | Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options |
| XNDX | Stockholm - Nasdaq Stockholm - Derivatives |
| OTC | Over-the-Counter |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

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 | | | | |
| AU000000WES1 | Wesfarmers Ltd. Reg.Shares | STK | 0 | 4.003 |
| EUR | | | | |
| BE0974256852 | Établissements Fr. Colruyt SA | STK | 0 | 10.912 |
| DE0006048432 | Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien | STK | 0 | 2.131 |
| NL0015000IY2 | Universal Music Group N.V. Aandelen op naam | STK | 0 | 7.006 |
| HKD | | | | |
| HK0016000132 | Sun Hung Kai Properties Ltd. Reg.Shares | STK | 0 | 9.000 |
| JPY | | | | |
| JP3814000000 | Fujifilm Holdings Corp. Reg.Shares | STK | 0 | 2.700 |
| JP3837800006 | Hoya Corp. Reg.Shares | STK | 0 | 500 |
| JP3914400001 | Murata Manufacturing Co. Ltd. Reg.Shares | STK | 0 | 600 |
| USD | | | | |
| US00507V1098 | Activision Blizzard Inc. Reg.Shares | STK | 0 | 1.787 |
| US09247X1019 | Blackrock Inc. Reg.Shares | STK | 74 | 611 |
| US1773761002 | Citrix Systems Inc. Reg.Shares | STK | 0 | 1.172 |
| US2786421030 | eBay Inc. Reg.Shares | STK | 0 | 1.856 |
| US5534981064 | MSA Safety Inc. Reg.Shares | STK | 0 | 1.311 |
| US6267551025 | Murphy USA Inc. Reg.Shares | STK | 0 | 760 |
| US68235P1084 | One Gas Inc. Reg.Shares | STK | 0 | 2.025 |
| US7739031091 | Rockwell Automation Inc. Reg.Shares | STK | 212 | 2.013 |
| US8740541094 | Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares | STK | 0 | 572 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| EUR | | | | |
| XS1485603747 | 1,6000 % Aptiv PLC Notes 16/28 | EUR | 0 | 200.000 |
| XS1829325239 | 3,0000 % Atrium European Real Estat.Ltd Notes 18/25 | EUR | 0 | 500.000 |
| DE000A289NF1 | 1,5000 % Deutsche Wohnen SE Anl. 20/30 | EUR | 0 | 500.000 |
| XS2050448336 | 1,1250 % Fastighets AB Balder MTN 19/27 | EUR | 0 | 400.000 |
| XS2344772426 | 1,7500 % Hammerson Ireland Finance DAC Nts 21/27 Reg.S | EUR | 500.000 | 500.000 |
| BE6321076711 | 1,6250 % Lonza Finance International NV Notes 20/27 | EUR | 0 | 400.000 |
| XS2189613982 | 0,7500 % OMV AG MTN 20/30 | EUR | 0 | 500.000 |
| XS1993969515 | 1,7500 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB MTN 19/25 | EUR | 0 | 600.000 |
| XS1405766624 | 1,3750 % Verizon Communications Inc. Notes 16/28 | EUR | 0 | 500.000 |
| XS2282095970 | 0,5000 % Volkswagen Leasing GmbH MTN 21/29 | EUR | 0 | 500.000 |
| DE000A19B8E2 | 1,7500 % Vonovia Finance B.V. MTN 17/27 | EUR | 0 | 400.000 |
| USD | | | | |
| US47215PAE60 | 3,3750 % JD.com Inc. Notes 20/30 | USD | 0 | 400.000 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| USD | | | | |
| US09857LAR96 | 4,6250 % Booking Holdings Inc. Notes 20/30 | USD | 0 | 550.000 |
| USU27803BB76 | 2,7500 % Ecolab Inc. Notes 21/55 Reg.S | USD | 0 | 475.000 |
| US489170AE03 | 4,6250 % Kennametal Inc. Notes 18/28 | USD | 0 | 300.000 |
| US87612EAR71 | 6,5000 % Target Corp. Notes 07/37 | USD | 0 | 450.000 |
| Nichtnotierte Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| AUD | | | | |
| AU000000AST5 | AusNet Services Ltd. Reg.Shares | STK | 0 | 80.444 |
| GBP | | | | |
| GB0008754136 | Tate & Lyle PLC Reg.Shares | STK | 0 | 49.238 |
| Andere Wertpapiere | | | | |
| SEK | | | | |
| SE0017859036 | Axfood AB Anrechte | STK | 22.229 | 22.229 |

Gattungsbezeichnung

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

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, MSCI EM ESG Screened Index (Net Return) (USD), OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, TOPIX Index (Price) (JPY))

EUR 18.526

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): OMX Stockholm 30 Index, S&P 500 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF))

EUR 17.776

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO Schatz Future (FGBS))

EUR 4.478

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU))

EUR 32.938

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

Volumen in 1.000

SSKM Nachhaltigkeit Invest

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000 |
|--|---------------------------------|---------------------|
| Devisentermingeschäfte | | |
| Devisenterminkontrakte (Verkauf) | | |
| Verkauf von Devisen auf Termin: | | |
| AUD/EUR | EUR | 1.457 |
| CAD/EUR | EUR | 2.304 |
| CHF/EUR | EUR | 1.056 |
| GBP/EUR | EUR | 2.034 |
| JPY/EUR | EUR | 3.629 |
| SEK/EUR | EUR | 1.267 |
| USD/EUR | EUR | 14.284 |
| Devisenterminkontrakte (Kauf) | | |
| Kauf von Devisen auf Termin: | | |
| AUD/EUR | EUR | 846 |
| CAD/EUR | EUR | 4.318 |
| CHF/EUR | EUR | 1.941 |
| GBP/EUR | EUR | 1.236 |
| JPY/EUR | EUR | 2.283 |
| SEK/EUR | EUR | 2.386 |
| USD/EUR | EUR | 23.545 |
| Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes): | | |
| unbefristet | EUR | 40.783 |
| (Basiswert(e): 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30, 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Preferred MTN 19/26, 0,3750 % Vantage Towers AG MTN 21/27, 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26, 0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 19/27, 0,7500 % OMV AG MTN 20/30, 0,8750 % EQT AB Notes 21/31 Reg.S, 1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.75 15/31, 1,1250 % Fastighets AB Balder MTN 19/27, 1,3750 % Enagás Financiaciones S.A.U. MTN 16/28, 1,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 1725, 1,3750 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 16/28, 1,3750 % Verizon Communications Inc. Notes 16/28, 1,5000 % Deutsche Wohnen SE Anl. 20/30, 1,6250 % Lonza Finance International NV Notes 20/27, 1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24, 1,7500 % Hammerson Ireland Finance DAC Nts 21/27 Reg.S, 1,7500 % Nasdaq Inc. Notes 19/29, 1,7500 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB MTN 19/25, 3,0000 % HP Inc. Notes 20/27, 3,3750 % JD.com Inc. Notes 20/30, 5,9500 % Sysco Corp. Notes 20/30, Groupe Bruxelles Lambert SA(GBL) Act.au Porteur, Orkla ASA Navne-Aksjer, Tryg AS Navne-Aktier) | | |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

Anhang.

| | | |
|--------------------|-----|-----------|
| Umlaufende Anteile | STK | 1.149.465 |
| Anteilwert | EUR | 106,37 |

Angaben zu Bewertungsverfahren

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

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

Investmentanteile

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

Derivate

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

Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

Sonstiges

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

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)

| | Marktwert in EUR | in % des Fondsvermögens |
|--------------------------|------------------|-------------------------|
| Aktien | 611.576,14 | 0,50 |
| Verzinsliche Wertpapiere | 9.962.447,00 | 8,15 |

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

| | Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR | Sitzstaat |
|--|---------------------------------------|-------------|
| DekaBank Deutsche Girozentrale | 7.639.820,34 | Deutschland |
| Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme | 2.934.202,80 | Deutschland |

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)

| | absolute Beträge in EUR |
|-------------|-------------------------|
| unbefristet | 10.574.023,14 |

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.

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindex (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX 50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder des GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter www.eurexrepo.com entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag in Höhe von 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR
USD

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

| | absolute Beträge in EUR |
|-----------------------|-------------------------|
| Restlaufzeit 1-7 Tage | 2.979.732,67 |

SSKM Nachhaltigkeit Invest

unbefristet

8.432.912,15

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

| | absolute Beträge in EUR | in % der Bruttoerträge des Fonds |
|-------------------------|-------------------------|----------------------------------|
| Ertragsanteil des Fonds | 5.020,79 | 100,00 |
| Kostenanteil des Fonds | 1.899,10 | 37,82 |
| Ertragsanteil der KVG | 1.899,10 | 37,82 |

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

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

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

10,22% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen

| | absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR |
|--|---|
| Kreditanstalt für Wiederaufbau | 2.840.391,06 |
| Siemens Financieringsmaatschappij N.V. | 2.682.330,73 |
| Spanien, Königreich | 1.654.459,50 |
| NRW.BANK | 1.247.802,28 |
| LfA Förderbank Bayern | 664.762,12 |
| Verizon Communications Inc. | 625.459,21 |
| Bayerische Landesbank | 406.210,48 |
| Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria | 348.112,18 |
| Italien, Republik | 170.279,75 |
| Portugal, Republik | 167.401,22 |

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 | 3 |
| J.P.Morgan AG Frankfurt | 3.307.144,00 EUR (absolut/verwahrter Betrag) |
| Clearstream Banking Frankfurt | 5.125.768,15 EUR (absolut/verwahrter Betrag) |
| Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus | 2.979.732,67 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.

Verwahrart 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% |
| Verwahrart 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.

Frankfurt am Main, den 1. Juni 2022
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2021

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Square
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Mai 2022

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

Überreicht durch:

Stadtparkasse München
Anstalt des öffentlichen Rechts
Sparkassenstraße 2
80331 München



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39
www.deka.de