

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2024.

## **Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2024

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

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

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

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

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

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

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

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen Anlagepolitik.

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

Um dies zu erreichen, kann der quantitativ und aktiv gemanagte Fonds 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 65%.

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

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

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

Performance*	6 Monate
	3,8%
ISIN	DE000DK0V6D3

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

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

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

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

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

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>22.745.398,73</b>	<b>59,37</b>
Australien	317.337,08	0,82
Belgien	131.554,98	0,35
Dänemark	340.186,80	0,89
Deutschland	718.572,22	1,87
Finnland	75.140,83	0,20
Frankreich	650.655,31	1,69
Großbritannien	741.152,10	1,95
Irland	380.844,62	1,00
Israel	81.973,55	0,21
Italien	500.688,97	1,30
Japan	994.410,17	2,59
Kanada	611.482,01	1,59
Liberia	26.207,47	0,07
Neuseeland	24.841,31	0,06
Niederlande	436.067,35	1,15
Schweden	375.173,63	0,98
Schweiz	470.224,05	1,22
Spanien	218.830,50	0,58
USA	15.650.055,78	40,85
<b>2. Anleihen</b>	<b>865.196,02</b>	<b>2,25</b>
Deutschland	297.049,50	0,77
Frankreich	196.750,00	0,51
USA	371.396,52	0,97
<b>3. Investmentanteile</b>	<b>13.199.418,09</b>	<b>34,38</b>
Deutschland	5.442.249,60	14,19
Irland	4.809.202,16	12,51
Luxemburg	2.947.966,33	7,68
<b>4. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>46.689,91</b>	<b>0,12</b>
Schweiz	46.689,91	0,12
<b>5. Derivate</b>	<b>-101.160,99</b>	<b>-0,24</b>
<b>6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>990.098,73</b>	<b>2,57</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>615.726,15</b>	<b>1,62</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-28.791,95</b>	<b>-0,07</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>38.332.574,69</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>22.745.398,73</b>	<b>59,37</b>
AUD	335.229,25	0,87
CAD	611.482,01	1,59
CHF	409.285,99	1,06
DKK	340.186,80	0,89
EUR	2.690.394,09	7,03
GBP	757.799,01	1,99
JPY	994.410,17	2,59
NZD	24.841,31	0,06
SEK	375.173,63	0,98
USD	16.206.596,47	42,31
<b>2. Anleihen</b>	<b>865.196,02</b>	<b>2,25</b>
EUR	493.799,50	1,28
USD	371.396,52	0,97
<b>3. Investmentanteile</b>	<b>13.199.418,09</b>	<b>34,38</b>
EUR	10.300.484,65	26,84
USD	2.898.933,44	7,54
<b>4. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>46.689,91</b>	<b>0,12</b>
CHF	46.689,91	0,12
<b>5. Derivate</b>	<b>-101.160,99</b>	<b>-0,24</b>
<b>6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>990.098,73</b>	<b>2,57</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>615.726,15</b>	<b>1,62</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-28.791,95</b>	<b>-0,07</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>38.332.574,69</b>	<b>100,00</b>

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









# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>USD</b>									
US35802XAJ28	4,7500 % Fresenius Med.CUS Fin.II Inc. Notes 14/24 144A		USD	200.000	0	0	% 99,529	186.070,29	0,49
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>								<b>46.689,91</b>	<b>0,12</b>
<b>CHF</b>									
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	179	0	0	CHF 251,000	46.689,91	0,12
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>482.375,73</b>	<b>1,25</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>482.375,73</b>	<b>1,25</b>
<b>EUR</b>									
XS2063659945	0,2500 % Santander Consumer Bank AG MTN 19/24		EUR	300.000	0	0	% 99,017	297.049,50	0,77
<b>USD</b>									
US281020AQ02	3,5500 % Edison International Notes 19/24		USD	200.000	0	0	% 99,131	185.326,23	0,48
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>13.199.418,09</b>	<b>34,38</b>
<b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>5.442.249,60</b>	<b>14,19</b>
<b>EUR</b>									
DE000ETFL599	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	53.000	2.000	13.000	EUR 87,950	4.661.350,00	12,15
DE0005424568	Deka-Vega Plus I (A)		ANT	11.420	0	0	EUR 68,380	780.899,60	2,04
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>951.477,50</b>	<b>2,48</b>
<b>EUR</b>									
LU1685588219	Deka-MultiFactor Global Corporates I		ANT	1.880	0	0	EUR 83,440	156.867,20	0,41
LU1685587591	Deka-MultiFactor Global Corporates HY I		ANT	9.285	0	0	EUR 85,580	794.610,30	2,07
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>6.805.690,99</b>	<b>17,71</b>
<b>EUR</b>									
IE00BH4G7D40	iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shs Hgd Dis.		ANT	700.000	100.000	200.000	EUR 4,014	2.809.660,00	7,32
IE00BKLC5874	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	246.500	60.000	90.000	EUR 4,451	1.097.097,55	2,85
<b>USD</b>									
IE00BKF09C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	215.600	114.300	130.000	USD 4,478	902.444,61	2,34
LU1974695790	UBSLF5-JPM DL EM IG ESG D.B.U.E Act. Nom.A-acc.		ANT	166.700	73.500	95.000	USD 12,813	1.996.488,83	5,20
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 36.856.702,75</b>	<b>96,12</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>-11.970,91</b>	<b>-0,02</b>
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep.24		XEUR	EUR	Anzahl -24				-13.320,00	-0,03
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) Sep. 24		XIOM	USD	Anzahl 1				3.267,90	0,01
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) Sep. 24		XCME	USD	Anzahl 4				-542,16	0,00
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 24		XCME	USD	Anzahl -13				-26.126,38	-0,07
ESTX Mid Index Future (FMCE) Sep. 24		XEUR	EUR	Anzahl 13				-4.095,00	-0,01
MDAX Mini Future (FSMX) Sep. 24		XEUR	EUR	Anzahl 12				-5.129,88	-0,01
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) Sep. 24		IFUS	USD	Anzahl 42				30.622,55	0,08
OMX Index Future (O30) Juli 24		XNDX	SEK	Anzahl -10				-8,78	0,00
OMXC25 Index Future (OMW) Juli 24		XNDX	DKK	Anzahl -4				-606,05	0,00
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 24		XOSE	JPY	Anzahl 1				3.966,89	0,01
<b>Optionsrechte</b>								<b>-20.061,07</b>	<b>-0,05</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindizes</b>									
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juli 24 4900		XEUR		Anzahl -42			EUR 77,000	-32.340,00	-0,08
S & P 500 Index (S500) Put Juli 24 5450		XCBO		Anzahl 4			USD 32,840	12.278,93	0,03
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR -32.031,98</b>	<b>-0,07</b>
<b>Zins-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>3.185,35</b>	<b>0,01</b>
10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 24		XEUR	EUR	600.000				-2.252,83	-0,01
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 24		XEUR	EUR	500.000				4.750,00	0,01
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 24		XEUR	EUR	300.000				4.800,00	0,01
EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 24		XEUR	EUR	300.000				1.245,00	0,00
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 24		XEUR	EUR	700.000				-8.960,00	-0,02
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 24		XCBT	USD	600.000				4.206,39	0,01
Long Gilt Future (FLG) Sep. 24		IFEU	GBP	500.000				3.664,19	0,01
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 24		XEUR	EUR	600.000				-9.540,00	-0,02
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 24		XCBT	USD	-1.800.000				-16.562,68	-0,04
Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 24		XCBT	USD	1.000.000				2.555,97	0,01
Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) Sep. 24		XCBT	USD	200.000				2.687,42	0,01
US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 24		XCBT	USD	800.000				16.591,89	0,04
<b>Summe Zins-Derivate</b>								<b>EUR 3.185,35</b>	<b>0,01</b>
<b>Devisen-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>								<b>-2.235,53</b>	<b>-0,01</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
	JPY/EUR 23.000.000,00	OTC						-2.235,53	-0,01	
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>-70.078,83</b>	<b>-0,17</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
	CAD/EUR 130.000,00	OTC						-1.364,39	0,00	
	GBP/EUR 60.000,00	OTC						-477,70	0,00	
	SEK/EUR 3.000.000,00	OTC						2.224,86	0,01	
	USD/EUR 4.400.000,00	OTC						-70.461,60	-0,18	
<b>Summe Devisen-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-72.314,36</b>	<b>-0,18</b>	
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	491.486,73			%	100,000	491.486,73	1,28
<b>EUR-Guthaben bei</b>										
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	2.441,79			%	100,000	2.441,79	0,01
	Landesbank Saar		EUR	3.811,14			%	100,000	3.811,14	0,01
	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-		EUR	5.402,66			%	100,000	5.402,66	0,01
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	485.344,98			%	100,000	65.075,79	0,17
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	275.952,43			%	100,000	24.151,27	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	239.063,18			%	100,000	20.982,69	0,05
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	28.917,10			%	100,000	17.931,92	0,05
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	79.958,75			%	100,000	54.520,37	0,14
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	18.584,30			%	100,000	19.312,68	0,05
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	19.480,65			%	100,000	23.026,09	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	305.144,93			%	100,000	36.528,12	0,10
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	15.463.804,00			%	100,000	89.814,46	0,23
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD	53.880,53			%	100,000	30.560,98	0,08
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	112.384,67			%	100,000	105.052,04	0,27
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>990.098,73</b>	<b>2,57</b>	
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>990.098,73</b>	<b>2,57</b>	
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
	Zinsansprüche		EUR	4.001,52				4.001,52	0,01	
	Dividendenansprüche		EUR	14.111,73				14.111,73	0,04	
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	584.184,11				584.184,11	1,53	
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	13.428,79				13.428,79	0,04	
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>615.726,15</b>	<b>1,62</b>	
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-106,65				-106,65	0,00	
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-28.685,30				-28.685,30	-0,07	
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-28.791,95</b>	<b>-0,07</b>	
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>38.332.574,69</b>	<b>100,00</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>359.274,000</b>		
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>106,69</b>		

\*) 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)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06980	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46659	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	172,17500	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,35370	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,61261	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,76305	= 1 Euro (EUR)

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

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

### OTC

Over-the-Counter

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>AUD</b>				
AU000000MGR9	Mirvac Group Reg.Stapled Units	STK	0	64.176
<b>CAD</b>				
CA11284V1058	Brookfield Renewable Corp. Reg.Shs Cl.A Sub.Vot.	STK	0	3.700
CA3759161035	Gildan Activewear Inc. Reg.Shares (Sub.Vtg)	STK	0	2.900
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)	STK	0	2.200
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK	0	1.000
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.200
<b>DKK</b>				
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK	0	58
<b>EUR</b>				
AT0000730007	Andritz AG Inhaber-Aktien	STK	0	2.212
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK	0	1.887
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien	STK	0	1.201
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK	0	1.837
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	807
ES0173093024	Redeia Corporacion S.A. Acciones Port.	STK	0	4.882
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK	0	1.245
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	1.469
AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien	STK	0	3.159
<b>GBP</b>				
GB00031743007	Burberry Group PLC Reg.Shares	STK	0	3.184
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC Reg.Shares	STK	0	12.498
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC Reg.Shares	STK	0	4.106
<b>HKD</b>				
HK0000063609	Swire Properties Ltd. Reg.Shares	STK	0	16.000
<b>JPY</b>				
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares	STK	0	2.700
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.600
JP3304200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.500
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares	STK	0	30.000
JP3326000001	Sankyu Inc. Reg.Shares	STK	0	1.200
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	11.700
<b>SEK</b>				
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK	0	10.645
<b>USD</b>				
US0326541051	Analog Devices Inc. Reg.Shares	STK	0	695
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares	STK	0	259
US2371941053	Darden Restaurants Inc. Reg.Shares	STK	0	720
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares	STK	0	686
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares	STK	0	1.486
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares	STK	0	657
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares	STK	0	2.281
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	350
US5950171042	Microchip Technology Inc. Reg.Shares	STK	0	1.508
US60770K1079	Moderna Inc. Reg.Shares	STK	0	400
US6819191064	Omnicom Group Inc. Reg.Shares	STK	0	1.066
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK	0	4.084
US82968B1035	Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares	STK	7.153	7.153
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares	STK	0	883
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	0	441
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares	STK	0	395
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares	STK	0	338
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS1713474671	1,2500 % Celanese US Holdings LLC Notes 17/25	EUR	0	300.000
XS1584122177	1,1250 % Essity AB MTN 17/24	EUR	0	300.000
XS2106056653	0,2500 % Raiffeisen Bank Intl AG Pref. MTN 20/25	EUR	0	300.000
XS2063261155	0,2500 % Swedbank AB Non-Preferred MTN 19/24	EUR	0	300.000
XSO203712939	4,9000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Notes 04/24	EUR	0	200.000

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS1395004408	3,8750 % LKQ It.Bondco di LKQ It.Bondco Notes 16/24 Reg.S	EUR	0	300.000
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>SEK</b>				
SE0016844831	Volvo Car AB Namn-Aktier B	STK	6.206	6.206
SE0021628914	Volvo Car AB Namn-Aktier IL B	STK	6.206	6.206
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
FR0013420023	0,2500 % HSBC Continental Europe S.A. MTN 19/24	EUR	0	300.000
XS2168625460	0,2500 % PepsiCo Inc. Notes 20/24	EUR	0	300.000
<b>Gattungsbezeichnung</b>				
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>				
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>				
(Basiswert(e): ESTX Mid Index (Price) (EUR), MDAX Performance-Index, MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, Russell 2000 Index, S&P/ASX 200 Index, Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))		<b>EUR</b>		<b>6.191</b>
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>				
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), OMX Stockholm 30 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), TOPIX Index (Price) (JPY))		<b>EUR</b>		<b>12.535</b>
<b>Zinsterminkontrakte</b>				
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>				
(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), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY), US Treasury Long Bond Future (US))		<b>EUR</b>		<b>23.151</b>
<b>Optionsrechte</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>				
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>				
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)		<b>EUR</b>		<b>12.450</b>
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>				
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>				
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))		<b>EUR</b>		<b>7.724</b>
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>				
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>				
CAD/EUR		<b>EUR</b>		<b>339</b>
CHF/EUR		<b>EUR</b>		<b>176</b>
GBP/EUR		<b>EUR</b>		<b>292</b>
JPY/EUR		<b>EUR</b>		<b>572</b>
SEK/EUR		<b>EUR</b>		<b>253</b>
USD/EUR		<b>EUR</b>		<b>5.362</b>
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>				
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>				
CAD/EUR		<b>EUR</b>		<b>787</b>
CHF/EUR		<b>EUR</b>		<b>52</b>
GBP/EUR		<b>EUR</b>		<b>584</b>
JPY/EUR		<b>EUR</b>		<b>703</b>
SEK/EUR		<b>EUR</b>		<b>580</b>
USD/EUR		<b>EUR</b>		<b>8.838</b>
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>				
<b>unbefristet</b>				
(Basiswert(e): Andritz AG Inhaber-Aktien)		<b>EUR</b>		<b>108</b>

# Deka-ESG Sigma Plus Ausgewogen

## Anhang.

Umlaufende Anteile  
Anteilwert

STK  
EUR

359.274  
106,69

### 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	16,57	100,00
Kostenanteil des Fonds	5,47	33,01
Ertragsanteil der KVG	5,47	33,01

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.

### 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 Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 2024

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



**Deka Investment GmbH**

Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

