

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2024.

# **Deka-Nachhaltigkeit StrategieInvest**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2024

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

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds DekaNachhaltigkeit Strategieinvest für den Zeitraum vom 1. März 2024 bis zum 31. August 2024.

Sinkende Inflationszahlen stabilisierten in den vergangenen sechs Monaten die Finanzmärkte. In Deutschland und vielen anderen Ländern der Europäischen Währungsunion fielen die Inflationszahlen zuletzt im August sehr erfreulich aus und bewegten sich letztlich im Zielkorridor der Europäischen Zentralbank (EZB). Auf konjunktureller Seite bot sich ein uneinheitliches Bild. Das deutsche Bruttoinlandsprodukt schrumpfte im zweiten Quartal und bleibt damit schwunglos. Für die USA bot sich ein freundlicheres Bild, denn das US-BIP überraschte weiter positiv und zeugt von einer robusten Konjunktur. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken ist weiterhin auf die Inflationsbekämpfung ausgerichtet. Im ersten Quartal 2024 sorgten die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und zwischenzeitlich wieder steigende Renditen. Die Fed behielt daher über die Berichtsperiode das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei, signalisierte aber zuletzt eine baldige erste Zinssenkung. Die EZB verringerte den Hauptrefinanzierungssatz bereits im Juni von 4,50 Prozent auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger Euroland-Staatsanleihen lag Ende August bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 3,9 Prozent. Damit gingen die Renditen auf Halbjahressicht leicht zurück.

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. Nach der überraschenden Leitzinserhöhung der japanischen Notenbank Anfang August sackten die weltweiten Aktienkurse kurzzeitig ab. Die Märkte konnten sich jedoch dank überzeugender Wachstumsdaten für die USA und die Eurozone sowie solider Unternehmensgewinne rasch in Richtung ihrer historischen Höchststände erholen.

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
Anteilklassen im Überblick	6
Vermögensübersicht zum 31. August 2024	7
Vermögensaufstellung zum 31. August 2024	8
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

**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-Nachhaltigkeit Strategielinvest Anlagepolitik.

Anlageziel dieses Fonds ist es, durch die Nutzung von Chancen und die Vermeidung von Risiken, die sich aus ökonomischen, ökologischen und sozialen Entwicklungen ergeben, ein mittel- bis langfristiges Kapitalwachstum zu erwirtschaften. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds global in Aktien von Unternehmen an. Darüber hinaus können verzinsliche Wertpapiere und Geldmarktinstrumente erworben werden. Der Aktienanteil wird in Abhängigkeit der Schwankungsintensität der lokalen Aktienmärkte gesteuert und kann zwischen 25-100% variieren. Das Währungsrisiko wird nahezu vollständig gesichert. Bei der Zusammenstellung des Portfolios ist ein attraktives Chance-/Risikoverhältnis wichtig, was vor allem durch die Auswahl von Aktien erreicht wird, die niedrige Kursschwankungen erwarten lassen. Die Maximierung der Rendite im Vergleich zum breiten Aktienmarkt steht nicht im Vordergrund.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen finanzmathematischer Analysen, die durch wissenschaftliche Studien fundiert sind. Als Folge orientiert sich der Investitionsprozess an definierten Faktoren, welche eine umfangreiche Risikobewertung ermöglichen. Im Fonds wird die Low-Risk-Kapitalmarktanomalie ausgenutzt. Kern dieser Anomalie ist es, dass risikoarme Aktien attraktive Renditen erwarten lassen. Eine weitere Risikoreduktion wird mit Hilfe der Investitionsgradsteuerung angestrebt. Diese sieht eine Verringerung des Investitionsgrades in besonders schwankungsintensiven Marktphasen vor. 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 Unternehmensführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden die Emittenten nach Kriterien für Umwelt (z.B. Klimaschutz), soziale Verantwortung (z.B. Menschenrechte, Standards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Transparenz und Berichterstattung, Bestechung und Korruption) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Die Ausschlusskriterien orientieren sich beispielsweise an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten.

Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen z.B. den Schutz der internationalen Menschenrechte achten und sicherstellen.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

Performance*	6 Monate
Anteilklasse CF	7,0%
Anteilklasse TF	6,6%
ISIN	
Anteilklasse CF	DE000DK2EAD4
Anteilklasse TF	DE000DK2EAE2

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

Sie sollen unter anderem 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.

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 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.

# Anteilklassen im Überblick.

Für den Fonds DekaNachhaltigkeit StrategieInvest können Anteilklassen gebildet werden, die sich insbesondere hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Verwaltungsvergütung\*, der Vertriebsvergütung\*\*, der erfolgsabhängigen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Es sind Anteile von zwei Anteilklassen erhältlich, die sich hinsichtlich des Ausgabeaufschlags und der Verwaltungsvergütung sowie der Vertriebsvergütung unterscheiden. Die Anteilklassen tragen die Bezeichnung CF und TF.

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

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

## Anteilklassen im Überblick

	Verwaltungsvergütung*	Ausgabeaufschlag	Ertragsverwendung
Anteilklasse CF	1,25% p.a.	3,75%	Ausschüttung
Anteilklasse TF**	1,97% p.a.	keiner	Ausschüttung

\* Der Verwaltungsvergütungssatz wird auf das durchschnittliche Fondsvermögen berechnet, das sich aus den Tageswerten zusammensetzt.

\*\* Die Vertriebsvergütung wird durch die Verwaltungsvergütung abgedeckt und wird dem Sondervermögen nicht gesondert belastet.

# Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

## Vermögensübersicht zum 31. August 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>808.514.785,17</b>	<b>91,19</b>
Australien	10.271.302,61	1,16
Dänemark	5.997.545,15	0,68
Deutschland	58.412.480,60	6,58
Finnland	4.387.795,74	0,50
Frankreich	10.819.482,54	1,22
Großbritannien	54.867.787,05	6,19
Irland	9.188.143,60	1,04
Israel	9.931.081,99	1,12
Italien	9.496.494,91	1,07
Japan	31.041.687,14	3,50
Kanada	77.336.773,75	8,69
Niederlande	26.016.008,93	2,93
Norwegen	18.807.774,52	2,12
Schweden	11.251.865,98	1,26
Schweiz	48.633.205,70	5,47
Singapur	4.890.661,49	0,55
Spanien	15.080.255,33	1,70
USA	402.084.438,14	45,41
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>7.442.737,42</b>	<b>0,84</b>
Schweiz	7.442.737,42	0,84
<b>3. Derivate</b>	<b>7.016.852,92</b>	<b>0,78</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>69.510.005,30</b>	<b>7,82</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>7.336.261,30</b>	<b>0,82</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-12.905.763,00</b>	<b>-1,45</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>886.914.879,11</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>808.514.785,17</b>	<b>91,19</b>
AUD	10.271.302,61	1,16
CAD	77.336.773,75	8,69
CHF	41.285.545,69	4,64
DKK	5.997.545,15	0,68
EUR	124.212.518,05	14,00
GBP	55.857.855,72	6,30
JPY	31.041.687,14	3,50
NOK	18.807.774,52	2,12
SEK	11.251.865,98	1,26
SGD	4.890.661,49	0,55
USD	427.561.255,07	48,29
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>7.442.737,42</b>	<b>0,84</b>
CHF	7.442.737,42	0,84
<b>3. Derivate</b>	<b>7.016.852,92</b>	<b>0,78</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>69.510.005,30</b>	<b>7,82</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>7.336.261,30</b>	<b>0,82</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-12.905.763,00</b>	<b>-1,45</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>886.914.879,11</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

## Vermögensaufstellung zum 31. August 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>815.957.522,59</b>	<b>92,03</b>
<b>Aktien</b>								<b>808.514.785,17</b>	<b>91,19</b>
<b>EUR</b>								<b>124.212.518,05</b>	<b>14,00</b>
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		249.912	0	37.911	EUR 30,950	7.734.776,40	0,87
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		7.832	0	0	EUR 281,300	2.203.141,60	0,25
FR000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		138.280	0	0	EUR 34,410	4.758.214,80	0,54
FR0006174348	Bureau Veritas SA Actions au Porteur	STK		54.092	0	0	EUR 29,900	1.617.350,80	0,18
FR001400AJ45	Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom.	STK		25.449	0	0	EUR 35,680	908.020,32	0,10
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		294.728	117.295	0	EUR 25,830	7.612.824,24	0,86
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		802.672	69.443	0	EUR 12,830	10.298.281,76	1,16
FI0009007884	Elisa Oyj Reg.Shares Cl.A	STK		50.877	0	26.498	EUR 45,000	2.289.465,00	0,26
DE000A0Z2Z25	freenet AG Namens-Aktien	STK		137.251	137.251	0	EUR 26,340	3.615.191,34	0,41
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien	STK		58.507	0	0	EUR 42,000	2.457.294,00	0,28
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK		27.689	0	0	EUR 256,500	7.102.228,50	0,80
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien	STK		123.131	14.450	12.802	EUR 82,400	10.145.994,40	1,14
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK		568.605	16.245	0	EUR 12,865	7.315.103,33	0,82
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B	STK		114.444	0	0	EUR 18,335	2.098.330,74	0,24
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK		2.772.182	254.835	0	EUR 3,702	10.262.617,76	1,16
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK		99.007	0	0	EUR 15,215	1.506.391,51	0,17
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		19.636	0	2.280	EUR 489,700	9.615.749,20	1,08
FR000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		19.509	0	0	EUR 99,780	1.946.608,02	0,22
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder	STK		18.899	0	70.667	EUR 43,830	828.343,17	0,09
IT0003828271	Recordati Ind.Chim.Farm. SpA Azioni nom.	STK		54.978	54.978	0	EUR 52,850	2.905.587,30	0,33
ES0173093024	Redeia Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		451.200	45.370	0	EUR 17,210	7.765.152,00	0,88
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		15.566	0	28.551	EUR 102,100	1.589.288,60	0,18
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK		27.129	0	9.476	EUR 197,640	5.361.775,56	0,60
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom.	STK		646.885	210.984	0	EUR 7,860	5.084.516,10	0,57
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		46.344	0	0	EUR 155,150	7.190.271,60	0,81
<b>AUD</b>								<b>10.271.302,61</b>	<b>1,16</b>
AU000000BxB1	Brambles Ltd. Reg.Shares	STK		183.668	0	0	AUD 18,230	2.056.568,08	0,23
AU0000030678	Coles Group Ltd. Reg.Shares	STK		250.536	0	0	AUD 18,790	2.891.477,68	0,33
AU000000MPL3	Medibank Private Ltd. Reg.Shares	STK		577.212	0	0	AUD 3,860	1.368.502,46	0,15
AU000000NAB4	National Australia Bank Ltd. Reg.Shares	STK		56.891	0	0	AUD 38,170	1.333.793,67	0,15
AU000000TLS2	Telstra Group Ltd. Reg.Shares	STK		1.085.788	0	636.808	AUD 3,930	2.620.960,72	0,30
<b>CAD</b>								<b>77.336.773,75</b>	<b>8,69</b>
CA1363751027	Canadian National Railway Co. Reg.Shares	STK		43.201	13.501	0	CAD 157,780	4.564.083,81	0,51
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK		92.500	0	0	CAD 150,260	9.306.641,31	1,05
CA9611485090	George Weston Ltd. Reg.Shares	STK		18.203	11.803	44.000	CAD 219,580	2.676.354,32	0,30
CA4488112083	Hydro One Ltd. Reg.Shares	STK		236.600	0	0	CAD 45,300	7.176.634,05	0,81
CA45823T1066	Intact Financial Corp. Reg.Shares	STK		47.600	0	0	CAD 251,640	8.020.371,55	0,90
CA53948H11015	Loblaws Companies Ltd. Reg.Shares	STK		89.300	0	10.700	CAD 174,000	10.404.196,98	1,16
CA59162N1096	Metro Inc. Reg.Shares	STK		143.929	0	14.871	CAD 84,480	8.141.605,82	0,92
CA6330671034	National Bank of Canada Reg.Shares	STK		17.500	0	0	CAD 124,000	1.453.006,62	0,16
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)	STK		167.100	0	0	CAD 33,170	3.711.331,78	0,42
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares	STK		62.600	0	0	CAD 160,750	6.738.033,62	0,76
CA85472N1096	Stantec Inc. Reg.Shares	STK		51.400	0	0	CAD 111,540	3.838.854,20	0,43
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK		98.700	0	0	CAD 73,040	4.827.094,22	0,54
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK		44.300	0	0	CAD 80,170	2.378.063,62	0,27
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK		43.800	0	0	CAD 119,050	3.491.494,55	0,39
CA97535P1045	Winpak Ltd. Reg.Shares	STK		20.100	0	0	CAD 45,250	609.007,30	0,07
<b>CHF</b>								<b>41.285.545,69</b>	<b>4,64</b>
CH0531751755	Banque Cantonale Vaudois Namens-Aktien	STK		14.607	0	0	CHF 90,600	1.408.727,89	0,16
CH0360674466	Galenica AG Namens-Aktien	STK		78.572	15.597	0	CHF 73,650	6.159.967,85	0,69
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		115.694	0	0	CHF 102,500	12.623.290,84	1,41
CH0018294154	PSP Swiss Property AG Namens-Aktien	STK		12.046	0	0	CHF 123,300	1.581.043,51	0,18
CH0239229302	SFS Group AG Nam.-Aktien	STK		13.642	0	4.269	CHF 129,000	1.873.292,71	0,21
CH1256740924	SGS S.A. Namen-Aktien	STK		9.647	0	0	CHF 94,980	975.354,14	0,11
CH0008038389	Swiss Prime Site AG Namens-Aktien	STK		8.862	8.862	0	CHF 95,250	898.534,21	0,10
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien	STK		14.895	0	0	CHF 537,500	8.522.300,88	0,96
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK		13.799	2.538	0	CHF 7.243,033,66	8.522.300,88	0,82
<b>DKK</b>								<b>5.997.545,15</b>	<b>0,68</b>
DK0062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		47.972	0	14.136	DKK 932,500	5.997.545,15	0,68
<b>GBP</b>								<b>55.857.855,72</b>	<b>6,30</b>
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares	STK		195.482	0	0	GBP 31,930	7.428.255,51	0,84
GB00BD6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares	STK		213.997	0	0	GBP 24,090	6.135.156,24	0,69
US31488V1070	Ferguson Enterpris.Inc. Reg.Shares	STK		5.350	5.350	0	GBP 155,500	990.068,67	0,11
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares	STK		380.914	0	0	GBP 16,610	7.529.700,62	0,85
GB00BMJ6DW54	Informa PLC Reg.Shares	STK		524.528	241.687	0	GBP 8,294	5.177.425,39	0,58
GB0006776081	Pearson PLC Reg.Shares	STK		304.978	304.978	0	GBP 10,510	3.814.629,56	0,43
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK		185.700	0	0	GBP 35,610	7.869.823,99	0,89
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC Reg.Shares	STK		286.117	0	0	GBP 18,000	6.129.108,50	0,69
GB00BP92CJ43	Tate & Lyle PLC Reg.Shares	STK		225.282	0	0	GBP 6,760	1.812.401,16	0,20
GB00BLGZ9862	Tesco PLC Reg.Shs	STK		264.692	0	0	GBP 3,539	1.114.814,27	0,13
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK		133.933	0	0	GBP 49,290	7.856.471,81	0,89
<b>JPY</b>								<b>31.041.687,14</b>	<b>3,50</b>
JP3219000001	Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares	STK		157.600	0	0	JPY 3.284,000	3.221.852,59	0,36
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares	STK		144.200	0	0	JPY 4.911,000	4.408.405,13	0,50

# Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares		STK	85.000	0	0	JPY 7.902,000	4.181.212,65	0,47
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares		STK	1.099.831	0	5.250.194	JPY 155,700	1.066.009,01	0,12
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares		STK	284.381	0	95.819	JPY 3.754,000	6.645.706,39	0,75
JP3347200002	Shionogi & Co. Ltd. Reg.Shares		STK	61.980	0	30.620	JPY 6.807,000	2.626.356,20	0,30
JP3732000009	SoftBank Corp. Reg.Shares		STK	700.900	0	0	JPY 2.038,000	8.892.145,17	1,00
<b>NOK</b>								<b>18.807.774,52</b>	<b>2,12</b>
NO0010161896	DNB Bank ASA Navne-Aksjer		STK	473.581	0	0	NOK 224,700	9.145.012,41	1,03
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer		STK	283.819	0	0	NOK 186,600	4.551.348,19	0,51
NO0003733800	Orkla ASA Navne-Aksjer		STK	632.405	0	0	NOK 94,050	5.111.413,92	0,58
<b>SEK</b>								<b>11.251.865,98</b>	<b>1,26</b>
SE0007100581	Assa-Abloy AB Namn-Aktier B		STK	107.581	0	0	SEK 331,200	3.145.932,12	0,35
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A		STK	554.397	305.284	0	SEK 105,700	5.173.915,14	0,58
SE0000115420	Volvo (publ), AB Namn-Aktier A (fria)		STK	120.319	0	0	SEK 276,000	2.932.018,72	0,33
<b>SGD</b>								<b>4.890.661,49</b>	<b>0,55</b>
SG1L01001701	DBS Group Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	194.810	17.710	0	SGD 36,240	4.890.661,49	0,55
<b>USD</b>								<b>427.561.255,07</b>	<b>48,29</b>
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares		STK	26.933	0	0	USD 112,760	2.739.954,06	0,31
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	38.720	0	0	USD 195,180	6.818.269,22	0,77
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares		STK	49.185	20.842	0	USD 109,630	4.864.806,52	0,55
US00971T1016	Akamai Technologies Inc. Reg.Shares		STK	21.856	0	0	USD 101,600	2.003.400,94	0,23
US0130911037	Albertsons Companies Inc. Reg.Shares		STK	71.166	0	0	USD 20,120	1.291.825,98	0,15
IE00BFR3W74	Allegion PLC Reg.Shares		STK	14.089	0	0	USD 137,310	1.745.363,22	0,20
US0311001004	AMETEK Inc. Reg.Shares		STK	17.711	0	0	USD 169,380	2.706.504,13	0,31
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	22.457	0	8.706	USD 331,010	6.706.506,29	0,76
IE00BLP1HW54	AON PLC Reg.Shares A		STK	12.571	0	0	USD 343,460	3.895.376,81	0,44
US03820C1053	Applied Industrial Techs Inc. Reg.Shares		STK	20.690	20.690	0	USD 203,430	3.797.335,53	0,43
US0383361039	AptarGroup Inc. Reg.Shares		STK	5.971	5.971	0	USD 152,280	820.339,12	0,09
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	31.282	0	0	USD 273,360	7.714.947,24	0,87
US1046741062	Brady Corp. Reg.N.Vot.Shs ClA		STK	126.320	33.620	0	USD 73,360	8.360.551,43	0,94
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	33.585	0	71.347	USD 49,720	1.506.537,53	0,17
US1152361010	Brown & Brown Inc. Reg.Shares		STK	17.618	0	0	USD 104,650	1.663.410,05	0,19
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	3.839	0	0	USD 265,630	920.023,07	0,10
US1344291091	Campbell Soup Co. Reg.Shares		STK	19.189	0	23.649	USD 49,260	852.805,97	0,10
US14149Y1082	Cardinal Health Inc. Reg.Shares		STK	36.362	0	0	USD 112,200	3.680.815,95	0,42
US12503M1080	Choe Global Markets Inc. Reg.Shares		STK	49.463	0	0	USD 207,320	9.251.776,58	1,04
US03073E1055	Cencora Inc. Reg.Shares		STK	28.492	0	0	USD 237,600	6.107.631,90	0,69
IL0010824113	Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares		STK	57.448	12.419	0	USD 191,610	9.931.081,99	1,12
US16359R1032	Chemed Corp. Reg.Shares		STK	15.650	0	0	USD 580,010	8.189.423,04	0,92
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares		STK	28.882	13.913	0	USD 281,980	7.347.660,01	0,83
US1720621010	Cincinnati Financial Corp. Reg.Shares		STK	17.889	17.889	0	USD 135,610	2.188.674,93	0,25
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	205.831	0	0	USD 50,390	9.357.473,92	1,06
US1924461023	Cognizant Technology Sol.Corp. Reg.Shs ClA		STK	94.443	29.214	0	USD 77,140	6.572.837,44	0,74
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares		STK	92.640	0	0	USD 105,810	8.843.592,93	1,00
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares		STK	21.306	0	1.723	USD 309,310	5.945.650,36	0,67
US2358511028	Danaher Corp. Reg.Shares		STK	3.539	0	0	USD 267,020	852.565,66	0,10
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares ClA		STK	50.443	0	139.485	USD 25,080	1.141.384,37	0,13
US2855121099	Electronic Arts Inc. Reg.Shares		STK	59.912	0	0	USD 150,250	8.121.416,46	0,92
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	19.361	0	0	USD 552,090	9.643.643,53	1,09
US2910111044	Emerson Electric Co. Reg.Shares		STK	32.156	0	0	USD 104,090	3.019.774,49	0,34
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares		STK	57.024	0	0	USD 122,170	6.285.295,99	0,71
US319001044	Fastenal Co. Reg.Shares		STK	135.546	0	0	USD 67,500	8.254.560,63	0,93
US3535141028	Franklin Electric Co. Inc. Reg.Shares		STK	32.419	0	0	USD 102,900	3.009.667,18	0,34
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	10.669	0	0	USD 485,880	4.676.879,94	0,53
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	89.544	0	0	USD 79,450	6.418.504,87	0,72
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares		STK	10.676	0	62.970	USD 70,820	682.131,29	0,08
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	121.165	0	0	USD 80,760	8.828.297,91	1,00
US4435106079	Hubbell Inc. Reg.Shares		STK	9.708	0	0	USD 395,520	3.464.189,97	0,39
US4523081093	Illinois Tool Works Inc. Reg.Shares		STK	9.320	0	0	USD 250,440	2.105.828,94	0,24
US4571871023	Ingredion Inc. Reg.Shares		STK	53.353	53.353	0	USD 133,530	6.427.486,55	0,72
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares		STK	35.992	0	0	USD 198,900	6.458.687,12	0,73
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	24.942	0	0	USD 164,230	3.695.619,51	0,42
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	14.436	0	0	USD 222,210	2.894.102,81	0,33
US4878361082	Kellanova Co. Reg.Shares		STK	23.681	0	26.640	USD 80,530	1.720.525,92	0,19
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares		STK	41.015	0	0	USD 143,220	5.299.682,70	0,60
US5049221055	Labcorp Holdings Inc. Reg.Shares		STK	15.512	15.512	0	USD 229,690	3.214.499,53	0,36
IE00059YS762	Linde plc Reg.Shares		STK	4.089	0	0	USD 472,730	1.743.948,91	0,20
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	39.267	10.588	0	USD 227,060	8.043.995,87	0,91
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares		STK	25.932	0	0	USD 78,860	1.844.999,57	0,21
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	11.452	4.491	0	USD 556,150	5.746.147,42	0,65
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	65.793	0	34.883	USD 117,460	6.972.253,50	0,79
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	25.164	6.062	0	USD 413,120	9.379.061,42	1,06
US6200763075	Motorola Solutions Inc. Reg.Shares		STK	4.633	0	0	USD 437,150	1.827.242,83	0,21
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	38.229	0	0	USD 166,490	5.742.282,76	0,65
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares		STK	75.439	0	0	USD 94,650	6.441.989,67	0,73
US6951561090	Packaging Corp. of America Reg.Shares		STK	21.082	7.212	0	USD 206,550	3.930.526,25	0,44
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares		STK	34.684	0	0	USD 129,550	4.053.872,43	0,46
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares		STK	32.246	0	0	USD 172,090	5.006.508,61	0,56
US7433121008	Progress Software Corp. Reg.Shares		STK	152.109	0	0	USD 58,260	7.995.191,57	0,90

# Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares		STK	64.645	8.847	0	USD 156,230	9.111.772,24	1,03
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	9.639	1.247	0	USD 1.178,930	10.252.351,38	1,16
US7607591002	Republic Services Inc. Reg.Shares		STK	10.309	0	0	USD 205,940	1.915.405,50	0,22
US8318652091	Smith Corp., A.O. Reg.Shares		STK	25.961	25.961	0	USD 82,100	1.922.950,29	0,22
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares		STK	32.803	0	0	USD 281,140	8.320.313,44	0,94
US86333M1080	Stride Inc. Reg.Shares		STK	27.776	27.776	0	USD 81,900	2.052.376,76	0,23
US87901J1051	TEGNA Inc. Reg.Shares		STK	54.975	0	0	USD 13,760	682.475,64	0,08
US88162G1031	Tetra Tech Inc. Reg.Shares		STK	18.453	9.266	0	USD 235,900	3.927.339,14	0,44
US1255231003	The Cigna Group Reg.Shares		STK	18.893	18.893	0	USD 361,060	6.154.372,59	0,69
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares		STK	119.140	0	0	USD 72,050	7.744.529,95	0,87
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	4.660	0	0	USD 367,060	1.543.215,08	0,17
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares		STK	123.192	0	0	USD 52,500	5.835.059,55	0,66
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	40.001	0	0	USD 170,030	6.136.205,37	0,69
US8947E1091	The Travelers Companies Inc. Reg.Shares		STK	18.669	7.678	0	USD 226,330	3.812.120,87	0,43
US8725401090	TJX Companies Inc. Reg.Shares		STK	75.851	57.335	0	USD 117,370	8.031.966,68	0,91
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	11.456	0	0	USD 591,570	6.114.242,08	0,69
US92343E1029	Verisign Inc. Reg.Shares		STK	5.202	0	0	USD 182,000	854.171,78	0,10
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	133.290	133.290	0	USD 41,250	4.960.494,86	0,56
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	23.721	3.652	2.497	USD 493,350	6.114.242,93	1,18
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares CIA		STK	18.590	0	0	USD 274,320	4.600.874,05	0,52
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	10.250	0	0	USD 968,040	8.952.011,91	1,01
US94106L1098	Waste Management Inc. Reg.Shares		STK	9.933	0	0	USD 209,880	1.880.853,52	0,21
US9427491025	Watts Water Technologies Inc. Reg.Shares CIA		STK	4.015	0	0	USD 194,500	704.544,84	0,08
IE00BDB6Q211	Willis Towers Watson PLC Reg.Shares		STK	6.849	0	0	USD 291,860	1.803.454,66	0,20
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	30.500	0	0	USD 135,250	3.721.693,43	0,42
US98956P1021	Zimmer Biomet Holdings Inc. Reg.Shares		STK	19.318	0	0	USD 114,670	1.998.552,02	0,23
US98980L1017	Zoom Video Communications Inc. Reg.Shs CIA		STK	50.750	50.750	0	USD 69,940	3.202.323,17	0,36
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>								<b>7.442.737,42</b>	<b>0,84</b>
<b>CHF</b>								<b>7.442.737,42</b>	<b>0,84</b>
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	24.396	0	0	CHF 286,600	7.442.737,42	0,84
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 815.957.522,59</b>	<b>92,03</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>1.229.372,22</b>	<b>0,14</b>
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Sep.24		XEUR	EUR	Anzahl 240				395.800,00	0,04
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 24		XCME	USD	Anzahl 152				494.670,75	0,06
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 24		IFEU	GBP	Anzahl 51				66.346,53	0,01
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 24		XMOD	CAD	Anzahl 33				66.951,77	0,01
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 24		XSFE	AUD	Anzahl 7				18.779,73	0,00
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 24		XEUR	CHF	Anzahl 34				96.621,75	0,01
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 24		XOSE	JPY	Anzahl 14				90.201,69	0,01
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR 1.229.372,22</b>	<b>0,14</b>
<b>Devisen-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>								<b>4.134,41</b>	<b>0,00</b>
<b>Offene Positionen</b>									
AUD/EUR 500.000,00			OTC					6.904,16	0,00
CHF/EUR 2.000.000,00			OTC					-13.246,80	0,00
DKK/EUR 9.000.000,00			OTC					90,96	0,00
JPY/EUR 1.200.000.000,00			OTC					6.538,87	0,00
SEK/EUR 5.000.000,00			OTC					2.280,00	0,00
SGD/EUR 500.000,00			OTC					1567,22	0,00
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>5.783.346,29</b>	<b>0,64</b>
<b>Offene Positionen</b>									
AUD/EUR 17.900.000,00			OTC					7.724,90	0,00
CAD/EUR 113.000.000,00			OTC					275.904,19	0,03
CHF/EUR 46.200.000,00			OTC					-1.177.894,29	-0,13
DKK/EUR 70.000.000,00			OTC					7.646,10	0,00
GBP/EUR 44.900.000,00			OTC					-440.432,68	-0,05
JPY/EUR 6.460.000.000,00			OTC					-1.883.601,61	-0,21
NOK/EUR 201.000.000,00			OTC					230.671,18	0,03
SEK/EUR 120.000.000,00			OTC					116.093,81	0,01
SGD/EUR 6.910.000,00			OTC					-48.735,66	-0,01
USD/EUR 456.000.000,00			OTC					8.695.970,35	0,97
<b>Summe Devisen-Derivate</b>								<b>EUR 5.787.480,70</b>	<b>0,64</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	55.593.969,04			% 100,000	55.593.969,04	6,25
<b>EUR-Guthaben bei</b>									
Bayerische Landesbank			EUR	44.273,27			% 100,000	44.273,27	0,00
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	23.787.508,62			% 100,000	3.189.229,84	0,36

# Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	3.298.721,80			% 100,000	283.486,67	0,03
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	1.639.788,77			% 100,000	144.780,93	0,02
	<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	2.578.907,83			% 100,000	1.584.013,02	0,18
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	3.112.413,91			% 100,000	2.084.035,95	0,23
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	1.039.799,11			% 100,000	1.106.846,33	0,12
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	409.889,33			% 100,000	487.806,69	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	122.569,59			% 100,000	14.185,31	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	581.636.819,00			% 100,000	3.620.747,13	0,41
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SGD	219.555,59			% 100,000	152.094,21	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	1.335.108,71			% 100,000	1.204.536,91	0,14
	<b>Summe Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>69.510.005,30</b>	<b>7,82</b>
	<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>						<b>EUR</b>	<b>69.510.005,30</b>	<b>7,82</b>
	<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								
	Dividendenansprüche		EUR	832.180,46				832.180,46	0,09
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	3.272.924,21				3.272.924,21	0,37
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	55.607,35				55.607,35	0,01
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	295.549,28				295.549,28	0,03
	Forderungen aus Cash Collateral		EUR	2.880.000,00				2.880.000,00	0,32
	<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>7.336.261,30</b>	<b>0,82</b>
	<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-273.223,49				-273.223,49	-0,03
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-1.182.539,51				-1.182.539,51	-0,13
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-11.450.000,00				-11.450.000,00	-1,29
	<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-12.905.763,00</b>	<b>-1,45</b>
	<b>Fondsvermögen</b>								
	<b>Umlaufende Anteile Klasse CF</b>						<b>EUR</b>	<b>886.914.879,11</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile Klasse TF</b>						<b>STK</b>	<b>4.010.114,000</b>	
	<b>Anteilwert Klasse CF</b>						<b>STK</b>	<b>1.935.368,000</b>	
	<b>Anteilwert Klasse TF</b>						<b>EUR</b>	<b>151,22</b>	
							<b>EUR</b>	<b>144,95</b>	

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

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.08.2024

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,84027	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45870	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,63625	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,32600	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,93943	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10840	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,49346	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,44355	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	160,64000	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,64060	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,62809	= 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)
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options

### 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>CAD</b>				
CA05534B7604	BCE Inc. Reg.Shares new	STK	0	19.828
<b>CHF</b>				
CH0025238863	Kuehne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien	STK	0	8.834
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK	0	6.445
<b>USD</b>				
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A	STK	0	17.172
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares	STK	0	13.283

# Deka-Nachhaltigkeit StrategieInvest

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares	STK	0	44.106
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares	STK	0	66.697
US8326964058	J.M. Smucker Co. Reg.Shares	STK	0	19.285
US5150981018	Landstar System Inc. Reg.Shares	STK	0	35.637
US5535301064	MSC Industrial Direct Co. Inc. Reg.Shares CIA	STK	35.277	47.664
IE00BDVJJQ56	nVent Electric PLC Reg.Shares	STK	0	22.829
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares	STK	0	9.594
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares	STK	0	15.685
US9038453031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares	STK	0	14.830
<b>Andere Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES0644580957	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	552.360	552.360
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>EUR</b>				
ES0144583301	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK	16.245	16.245
<b>GBP</b>				
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC Reg.Shares	STK	0	5.350
<b>USD</b>				
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares	STK	0	15.512

## 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, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))

##### Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, S&P 500 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

Volumen in 1.000

EUR 157.608

EUR 21.292

#### Devisentermingeschäfte

##### Devisenterminkontrakte (Verkauf)

##### Verkauf von Devisen auf Termin:

AUD/EUR	EUR	10.906
CAD/EUR	EUR	74.727
CHF/EUR	EUR	43.001
DKK/EUR	EUR	8.049
GBP/EUR	EUR	50.278
JPY/EUR	EUR	39.225
NOK/EUR	EUR	16.855
SEK/EUR	EUR	11.205
SGD/EUR	EUR	4.320
USD/EUR	EUR	398.246

##### Devisenterminkontrakte (Kauf)

##### Kauf von Devisen auf Termin:

AUD/EUR	EUR	21.784
CAD/EUR	EUR	150.163
CHF/EUR	EUR	86.102
DKK/EUR	EUR	16.092
GBP/EUR	EUR	94.498
HKD/EUR	EUR	193
JPY/EUR	EUR	76.232
NOK/EUR	EUR	33.351
SEK/EUR	EUR	19.916
SGD/EUR	EUR	8.367
USD/EUR	EUR	794.455

# Deka-Nachhaltigkeit Strategielinvest

## Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF	STK	4.010,114
Umlaufende Anteile Klasse TF	STK	1.935,368
Anteilwert Klasse CF	EUR	151,22
Anteilwert Klasse TF	EUR	144,95

### 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)

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

---

Frankfurt am Main, den 2. September 2024  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2023

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

### Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Peter Scherkamp, München

Dr. Bernd Türk, Frankfurt am Main

### 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: 31. August 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)

