

Jahresbericht zum 31. Dezember 2022. **Deka Portfolio**

Ein Investmentfonds mit Teilfonds gemäß Teil I
des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010
über Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW).



.Deka
Investments

Bericht des Vorstands.

31. Dezember 2022

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Umbrellafonds Dekafonds bestehend aus den zwei Teilfonds Dekafonds Renten (liquidiert am 30.06.2022) und Dekafonds Nachhaltigkeit Globale Aktien für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022.

An den internationalen Finanzmärkten bildete bis in das erste Quartal 2022 hinein die Corona-Pandemie und ihre Auswirkungen den primären Einflussfaktor. Die von Impffortschritten und hoher Liquidität am Markt getriebene Erholung der globalen Wirtschaft sowie die starke Nachfrage an den Aktienmärkten fand im Februar mit dem Einmarsch Russlands in die Ukraine eine abrupte Zäsur. Die als Reaktion hierauf initiierten Sanktionsmaßnahmen des Westens gegen den russischen Aggressor setzten eine Vergeltungsspirale in Gang, in deren Folge Russland u.a. einen Lieferstopp bzw. reduzierte Liefermengen von Gas an verschiedene europäische Länder veranlasste. Exorbitante Preissteigerungen sowie wachsende Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im Winter sorgten für große Verunsicherung, insbesondere in Europa.

In der Geld- und Fiskalpolitik rückte im Laufe des Berichtszeitraums die sprunghafte Inflationsentwicklung in den Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu einer scharfen Zinswende zwang. Während die Fed zum Stichtag mittlerweile bei einem Leitzinsintervall von 4,25 bis 4,50 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen seit Juli 2022 bislang erst auf 2,50 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in den kommenden Monaten in Aussicht gestellt, wobei die Zinsschritte zuletzt gemäßiger ausfielen. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo merklich an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,6 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,9 Prozent.

Angesichts zahlreicher Belastungsfaktoren und Unsicherheiten wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode starke Schwankungen auf. Zwischen Februar und September kam es zu einer ausgeprägten Korrekturphase, ehe in den letzten Monaten eine Gegenbewegung einsetzte. Stark unter Druck geriet der Euro, der zeitweise unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, ehe zum Ende des Berichtszeitraums eine deutliche Erholung festzustellen war. Explodierte der Ölpreis im ersten und zweiten Quartal noch regelrecht, so befand er sich im letzten Halbjahr 2022 hingegen auf Talfahrt und lag zuletzt deutlich unter 100 US-Dollar pro Barrel (Brent).

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Tätigkeitsbericht. 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 Anteilhaber 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 International S.A.
Der Vorstand



Holger Hildebrandt



Eugen Lehnertz

Inhalt.

Tätigkeitsbericht	
Deka Portfolio Renten	5
Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien	6
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022	
Deka Portfolio Renten	8
Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien	13
Fondszusammensetzung	22
Anhang	23
Ökologische und/oder soziale Merkmale	27
Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien	27
BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE	44
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	46

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

Jahresbericht 01.01.2022 bis 30.06.2022

Deka Portfolio Renten

Tätigkeitsbericht.

Das Anlageziel des Teilfonds Deka Portfolio Renten war mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs durch die Vereinnahmung laufender Zinserträge sowie durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement verfolgte die Strategie, weltweit in fest- oder variabel verzinsliche Wertpapiere zu investieren. Der Fokus lag dabei auf europäischen Rentenpapieren mit guten bis sehr guten Ratings. Neben Staats- und Unternehmensanleihen aus den etablierten Volkswirtschaften kamen zeitweise in gewissem Umfang auch Staatsanleihen aus Ländern der Emerging Markets in Betracht. Weiterhin konnten Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Dem Fonds lag ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der fundamental orientierte Investmentansatz kombinierte gezielt „Top-Down“ sowie „Bottom-Up“-Elemente. Die Basis stellte die Analyse makroökonomischer sowie (geo)politischer Parameter dar, ergänzt durch qualitative sowie quantitative fundamentale Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände, z.B. Bonitätsanalyse der Emittenten, relativer Vergleich der Wertpapiere mit anderen korrespondierenden Ausstellern. Um den Erfolg des Wertpapierauswahlprozesses zu bewerten, wurde der Index 100% iBoxx Euro Sov. Eurozone in EUR¹⁾ verwendet. Die initiale und kontinuierliche Wertpapierauswahl erfolgte im Rahmen des beschriebenen Investmentansatzes unabhängig von diesem Referenzwert und damit verbundenen quantitativen oder qualitativen Einschränkungen.

Die Verwaltungsgesellschaft hatte auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigten nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten (Angaben gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852).

Liquidation des Teilfonds per 30. Juni 2022

Der Vorstand der Deka International S.A. hat beschlossen, den Teilfonds Deka Portfolio Renten zum 30. Juni 2022 außerplanmäßig zu liquidieren. Bis zu diesem Termin wurden alle umlaufenden Anteilscheine zurückgegeben.

Der Deka Portfolio Renten verzeichnete im Berichtszeitraum vom 1. Januar 2022 bis zur Liquidation am 30. Juni 2022 eine Wertentwicklung von minus 12,6 Prozent.

Wichtige Kennzahlen

Deka Portfolio Renten

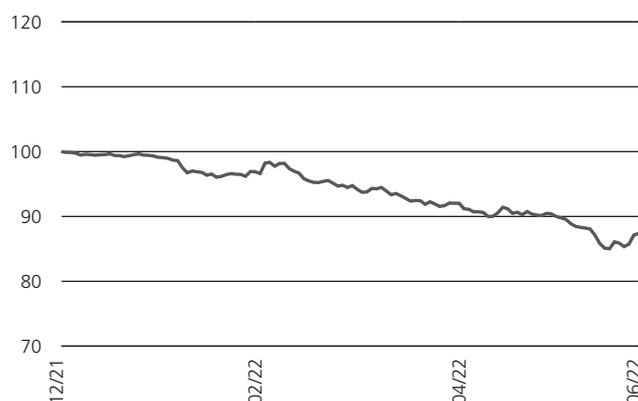
Performance*	01.01.2022 - 30.06.2022
	-12,6%
ISIN	LU0133819176

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

Wertentwicklung im Berichtszeitraum

Deka Portfolio Renten

Index: 31.12.2021 = 100



■ Deka Portfolio Renten

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

1) Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Index-Marke stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

Jahresbericht 01.01.2022 bis 31.12.2022

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Tätigkeitsbericht.

Ziel der Anlagepolitik des Teilfonds Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien 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. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel weltweit durch eine breit gestreute Anlage hauptsächlich in Aktien zu erreichen. Dabei investiert der Teilfonds nur in Wertpapiere, die nach Grundsätzen der Nachhaltigkeit ausgewählt werden. Dazu werden die Aktien weltweit nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Menschenrechte, Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung und Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet. Nicht investiert werden soll in Unternehmen mit Verstößen gegen Menschenrechte, Arbeitsrechte, Kinderarbeit oder Korruption sowie in Branchen, die den Mindeststandards des Fonds nicht entsprechen. Durch die Nachhaltigkeitsanalyse werden die jeweils am nachhaltigsten wirtschaftenden Unternehmen ausgewählt (Best-in-Class-Ansatz). Bei der Zusammenstellung des Portfolios ist ein attraktives Chance/Risiko-Verhältnis 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. Die Anlageentscheidungen für die Aktienauswahl basieren auf finanzmathematischen Analysen, die wissenschaftlich fundiert sind. Währungsrisiken werden nicht abgesichert. Weiterhin konnten Geschäfte in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen einer Gesamtunternehmenseinschätzung, wobei in erster Linie Bilanzdaten und betriebswirtschaftliche Kennzahlen wie z.B. Eigenkapitalquote und Nettoverschuldung sowie qualitative Bewertungskriterien wie z.B. die Qualität der Produkte und des Geschäftsmodells des Unternehmens analysiert werden. Ergänzend wird die Markt- und Branchenattraktivität auf Basis volkswirtschaftlicher Daten bewertet. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Die Verwaltungsgesellschaft hat auf eigene Verantwortung, Kosten und Kontrolle die Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main, mit der Ausführung der täglichen Anlagepolitik des Fonds beauftragt.

Details zu den ökologischen und/oder sozialen Merkmalen gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 finden Sie im Anhang dieses Jahresberichts.

Wichtige Kennzahlen

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

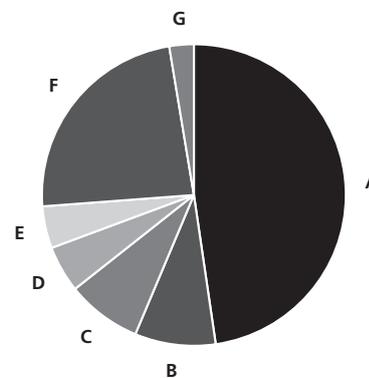
Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
	-3,8%	3,5%	5,0%

ISIN LU0133819333

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

Fondsstruktur

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien



A USA	47,7%
B Kanada	8,6%
C Schweiz	8,0%
D Großbritannien	5,0%
E Japan	4,5%
F Sonstige Länder	2,6%
G Barreserve, Sonstiges	23,6%

Geringfügige Abweichungen zur Vermögensaufstellung des Berichts resultieren aus der Zuordnung von Zins- und Dividendenansprüchen zu den jeweiligen Wertpapieren sowie aus rundungsbedingten Differenzen.

Deutlicher Anstieg des Fondsvolumens

An den internationalen Finanzmärkten bestimmte bis zum Beginn des Jahres 2022 die Corona-Pandemie das Marktgeschehen. Mit dem völkerrechtswidrigen Überfall Russlands auf die Ukraine Ende Februar kam ein weiterer Krisenherd hinzu. Explodierende Energie- und Rohstoffpreise als Folge der wechselseitigen Sanktionsmaßnahmen sorgten für massive Verunsicherung und rückläufige Kurse. Gleichzeitig sorgten stark gestiegene Inflationsraten für Belastungen, da die großen Notenbanken mit einem raschen Wechsel in der Geldpolitik entgegenzusteuern versuchten. Gut gefüllte Gasspeicher und leicht gesunkene Inflationszahlen ließen zuletzt jedoch leichte Hoffnungsschimmer aufkommen. Daneben führte die Null-Covid-Politik in China mit damit einhergehenden Lockdown-Maßnahmen zu wiederholten Beeinträchtigungen im internationalen Handel, die sich auch an den Finanzmärkten niederschlugen.

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Der Investitionsgrad wurde in der ganzen Berichtsperiode auf einem hohen Niveau gehalten und per saldo erhöht. Zum Stichtag waren 97,4 Prozent des Fondsvermögens direkt in Aktien weltweit angelegt. Aktien-Derivate (Futures auf Aktienindizes) befanden sich zum Stichtag ebenfalls im Portfolio. Der wirtschaftliche Investitionsgrad erhöhte sich hierdurch um 2,2 Prozentpunkte.

Zum Ende des Berichtsjahres waren 47,7 Prozent des Fondsvermögens in US-amerikanischen Aktien investiert, womit sich im Stichtagsvergleich das Niveau noch etwas erhöht hat. Dahinter folgten Kanada, die Schweiz, Großbritannien und Japan als größte Länderengagements.

Auf Branchenebene bildeten zuletzt die Bereiche Pharma/Biotechnologie, Telekommunikation und Lebensmittel und Getränke die größten Positionen. Auf Einzeltitelebene wurden u. a. Unilever, Novartis, Quest Diagnostics und Swisscom stärker berücksichtigt. Das Technologieunternehmen Meta Platforms (früher Facebook) war hingegen weiterhin nicht im Portfolio vertreten und auch Apple wurde nur relativ defensiv berücksichtigt. Eine aktive Steuerung des Investitionsgrads findet im Teilfonds nicht statt.

Der Teilfonds Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von minus 3,8 Prozent. Das Fondsvolumen erhöhte sich deutlich von 308,7 Mio. Euro auf 700,3 Mio. Euro.

Wertentwicklung im Berichtszeitraum Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Index: 31.12.2021 = 100



■ Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

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

Deka Portfolio Renten

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022.**)

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Fondsvermögen							0,00	100,00
	Umlaufende Anteile							0,000	
	Anteilwert							0,00	
	Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								0,00
	Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00

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

**) Dieser Teilfonds wurde zum 30. Juni 2022 liquidiert.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte per: 30.06.2022

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	973,81	100,00
Kostenanteil des Fonds	321,35	33,00
Ertragsanteil der KVG	321,35	33,00

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften gerechnet.

Der Ertragsanteil der KVG entspricht maximal dem Kostenanteil des Fonds. Der Kostenanteil der KVG ist auf Ebene des Sondervermögens im Einzelnen nicht bestimmbar.

Geschäftsbedingt gibt es bei Principalgeschäften keine expliziten Kosten durch Dritte. Sofern diese Geschäfte getätigt werden, sind Ertrags- und Kostenanteile Dritter über die in den Wertpapierleihesätzen enthaltenen Margen abgedeckt und damit bereits im Ertragsanteil des Fonds berücksichtigt. Bei Agencygeschäften werden Erträge und Kosten Dritter über eine Gebührenaufteilung (Fee split) definiert. Hier beträgt der Ertragsanteil des Agenten zwischen 20% und 35% vom Bruttogleihesatz.

Kosten Dritter als Agent der KVG werden nicht auf Ebene des Sondervermögens offengelegt.

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				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS2410368042	0,7500 % A.P.Moeller-Maersk A/S MTN 21/31	EUR	0	100.000
FR00140085A9	1,1250 % Agence Française Développement MTN 22/37	EUR	300.000	300.000
XS2383811424	1,7500 % Bc Cred. Social Cooperativo SA FLR MTN 21/28	EUR	0	100.000
DE0001102515	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/35	EUR	0	350.000
DE0001102531	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 21/31	EUR	0	250.000
DE0001102549	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 21/36	EUR	0	1.000.000
DE0001030559	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 14/30	EUR	250.000	650.000
DE0001030567	0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflation-Ind. Anl. 15/26	EUR	100.000	400.000
XS2408458227	1,6250 % Deutsche Lufthansa AG MTN 21/23	EUR	0	300.000
XS2387735470	0,8750 % DSV Finance B.V. MTN 21/36	EUR	0	150.000
AT0000A2RZL4	0,7500 % Erste & Steiermaerkische Bank FLR Pref. MTN 21/28	EUR	0	200.000
EU000A1G0EP6	0,1250 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 22/30	EUR	150.000	150.000
EU000A3KWCF4	0,0000 % Europaeische Union MTN 21/28	EUR	0	100.000
EU000A3K4C42	0,4000 % Europaeische Union MTN 21/37	EUR	100.000	350.000
EU000A3KTGW6	0,7000 % Europaeische Union MTN 21/51	EUR	100.000	100.000
EU000A3K4DD8	1,0000 % Europaeische Union MTN 22/32	EUR	300.000	300.000
EU000A1Z99N4	0,0000 % Europaeischer Stabilitaets.(ESM) MTN 21/26	EUR	100.000	100.000
DE000A14I2Q6	0,3750 % FMS Wertmanagement MTN IHS S.50107 15/30	EUR	0	300.000
GR0124038721	1,7500 % Griechenland Notes 22/32	EUR	200.000	200.000
BE0000355645	1,4000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. 22/53	EUR	175.000	175.000
ES0000012H41	0,1000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/31	EUR	0	140.000
ES0000012I32	0,5000 % Koenigreich Spanien Bonos 21/31	EUR	0	500.000
ES0000012K20	0,7000 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32	EUR	575.000	575.000
ES0000012K61	2,5500 % Koenigreich Spanien Bonos 22/32	EUR	375.000	375.000
ES0000012H58	1,4500 % Koenigreich Spanien Obligaciones 21/71	EUR	0	50.000
BE0000337460	1,0000 % Koenigreich Belgien Obl. Lin. S.77 16/26	EUR	0	300.000
NL0014555419	0,0000 % Koenigreich Niederlande Anl. 20/30	EUR	0	400.000
ES0000012B39	1,4000 % Koenigreich Spanien Bonos 18/28	EUR	0	400.000
ES0000012G34	1,2500 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/30	EUR	0	200.000
ES0000012G42	1,2000 % Koenigreich Spanien Obligaciones 20/40	EUR	0	425.000
DE000A3MP7J5	0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 22/25	EUR	100.000	100.000
PTRAAHOM0000	1,0950 % Região Autónoma Acores Notes 21/36	EUR	0	200.000
PTRAAIOM0009	2,1630 % Região Autónoma Acores Notes 22/32	EUR	200.000	200.000

Deka Portfolio Renten

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
FR0014008181	0,1000 % Rep. Frankreich Inflation-Ind.-Lkd OAT 22/53	EUR	150.000	150.000
FR0012993103	1,5000 % Rep. Frankreich OAT 15/31	EUR	0	500.000
FR0013313582	1,2500 % Rep. Frankreich OAT 17/34	EUR	0	150.000
FR0014002JM6	0,5000 % Rep. Frankreich OAT 20/44	EUR	0	200.000
FR0013480613	0,7500 % Rep. Frankreich OAT 20/52	EUR	0	200.000
FI4000507231	0,1250 % Republik Finnland Bonds 21/31	EUR	100.000	100.000
FI4000517677	0,5000 % Republik Finnland Bonds 22/43	EUR	200.000	200.000
IE00BFZRQ242	1,3500 % Republik Irland Treasury Bonds 18/31	EUR	0	400.000
IE00BMQ5JL65	0,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 21/31	EUR	0	300.000
IE00BMD03L28	0,3500 % Republik Irland Treasury Bonds 22/32	EUR	375.000	375.000
IT0005367492	1,7500 % Republik Italien B.T.P. 19/24	EUR	0	150.000
IT0005419848	0,5000 % Republik Italien B.T.P. 20/26	EUR	0	260.000
IT0005402117	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 20/36	EUR	0	250.000
IT0005421703	1,8000 % Republik Italien B.T.P. 20/41	EUR	0	275.000
IT0005438004	1,5000 % Republik Italien B.T.P. 20/45	EUR	0	100.000
IT0005454241	0,0000 % Republik Italien B.T.P. 21/26	EUR	0	850.000
IT0005449969	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/31	EUR	0	175.000
IT0005433195	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 21/37	EUR	0	150.000
IT0005480980	2,1500 % Republik Italien B.T.P. 22/52	EUR	250.000	250.000
IT0005451361	0,3220 % Republik Italien FLR C.C.T.eu 21/29	EUR	0	150.000
IT0005482994	0,1000 % Republik Italien Inflation-Ind. Lkd B.T.P. 21/33	EUR	230.000	230.000
XS2471549654	2,8750 % Republik Kroatien Notes 22/32	EUR	200.000	200.000
XS2420426038	0,2500 % Republik Lettland MTN 21/30	EUR	0	125.000
XS2317123052	0,0000 % Republik Lettland MTN 21/31	EUR	0	100.000
XS2487342649	2,1250 % Republik Litauen MTN 22/32	EUR	500.000	500.000
AT0000A2VB47	0,0000 % Republik Oesterreich MTN 22/28	EUR	200.000	200.000
AT0000A1VGK0	0,5000 % Republik Österreich Bundesanl. 17/27	EUR	0	500.000
AT0000A2CQD2	0,0000 % Republik Österreich MTN 20/30	EUR	0	400.000
PTOTEUOE0019	4,1250 % Republik Portugal Obr. 17/27	EUR	0	250.000
PTOTENOE0034	0,9000 % Republik Portugal Obr. 20/35	EUR	0	200.000
PTOTECOEO037	1,0000 % Republik Portugal Obr. 21/52	EUR	0	80.000
PTOTEYOE0031	1,6500 % Republik Portugal Obr. 22/32	EUR	200.000	200.000
PTOTEPOEO032	1,1500 % Republik Portugal Obr. 22/42	EUR	250.000	250.000
SI0002104048	0,4875 % Republik Slowenien Bonds 20/50	EUR	0	100.000
SI0002104121	0,6875 % Republik Slowenien Bonds 21/81	EUR	0	50.000
XS2105097393	1,2500 % Republik Zypern MTN 20/40	EUR	0	125.000
XS2434393968	0,9500 % Republik Zypern MTN 22/32	EUR	200.000	200.000
SK4000019857	1,0000 % Slowakei Anl. 21/51	EUR	0	175.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
FR0014004JA7	0,7500 % Action Logement Services SAS MTN 21/41	EUR	0	200.000
FR0014009N55	1,3750 % Action Logement Services SAS MTN 22/32	EUR	300.000	300.000
XS2326548562	2,5000 % Hapag-Lloyd AG Anl. 21/28 Reg.S	EUR	0	100.000
XS2341724172	2,3750 % MAHLE GmbH MTN 21/28	EUR	0	200.000

Deka Portfolio Renten

Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres		EUR	13.831.583,37
Mittelzuflüsse		0,00	
Mittelrückflüsse	-12.142.013,09		
Mittelzuflüsse /-rückflüsse (netto)		-12.142.013,09	
Ertragsausschüttung		-10.408,02	
Ertragsausgleich		-1.737.600,60	
Ordentlicher Aufwandsüberschuss		-140,03	
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)*)		-25.522,81	
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses*)		84.101,18	
Fondsvermögen am Ende des Rumpfgeschäftsjahres		0,00	

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

Anzahl des Anteilumlaufs am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres	177.886,000
Anzahl der ausgegebenen Anteile	0,000
Anzahl der zurückgezahlten Anteile	177.886,000
Anzahl des Anteilumlaufs am Ende des Rumpfgeschäftsjahres	0,000

Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich Geschäftsjahr

	Fondsvermögen am Ende	Anteilwert	Anteilumlauf
	des Geschäftsjahres		
	EUR	EUR	Stück
2019	21.473.556,96	77,94	275.506,000
2020	13.940.311,84	80,45	173.274,000
2021	13.831.583,37	77,76	177.886,000
2022 ¹⁾	0,00	0,00	0,000

Vergangenheitsbezogene Werte gewähren keine Rückschlüsse für die Zukunft.

¹⁾ Rumpfgeschäftsjahr vom 01.01.2022 bis 30.06.2022 (Tag der Liquidation).

Deka Portfolio Renten

Ertrags- und Aufwandsrechnung

für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 30.06.2022 (Tag der Liquidation) (inkl. Ertragsausgleich)

	EUR
Erträge	
Wertpapierzinsen	-7.021,94
davon Gewinne und Verluste aus Markttrenditepapieren	-49.053,39
Zinsen aus Liquiditätsanlagen	-1.013,68
davon aus negativen Einlagezinsen	-1.108,25
davon aus positiven Einlagezinsen	94,57
Erträge aus Wertpapierleihe	973,81
Sonstige Erträge ^{***)}	4.868,36
Ordentlicher Ertragsausgleich	2.193,42
Erträge insgesamt	-0,03
Aufwendungen	
Verwaltungsvergütung	36.092,60
Verwahrstellenvergütung ^{**)}	4.812,36
Taxe d'Abonnement	3.318,12
Zinsen aus Kreditaufnahmen	1.097,42
Aufwendungen aus Wertpapierleihe	321,35
Sonstige Aufwendungen ^{****)}	10.958,96
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	113,24
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-56.460,81
Aufwendungen insgesamt	140,00
Ordentlicher Aufwandsüberschuss	-140,03
Netto realisiertes Ergebnis ¹⁾	-1.704.469,18
Außerordentlicher Ertragsausgleich	1.678.946,37
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)	-25.522,81
Aufwandsüberschuss	-25.662,84
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses ^{*)}	84.101,18
Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	58.438,34

Die vorgenannten Aufwendungen betragen bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen (Gesamtkostenquote / laufende Kosten (Ongoing Charges)) 0,45% (annualisiert 0,91%).

Transaktionskosten im Rumpfgeschäftsjahr gesamt: 16.907,61 EUR
- davon aus EMIR-Kosten: 1.749,95 EUR

*) Ergebnis-Zusammensetzung:
Netto realisiertes Ergebnis aus: Wertpapier-, Devisen- und Finanztermingeschäften
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses aus: Wertpapier- und Finanztermingeschäften

***) In diesem Betrag enthalten ist die seit 1. April 2007 zu entrichtende gesetzliche Mehrwertsteuer i.H.v. 14% auf 20% der Verwahrstellenvergütung.

****) In dieser Position enthalten sind ausschließlich Ersatzleistungen aus Zinsen.

*****) In dieser Position enthalten sind im Wesentlichen Prüfungskosten.

Deka Portfolio Renten

Relativer VaR

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Verwaltungsgesellschaft den **relativen Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an. Die Limitauslastung berechnet sich als Verhältnis des VaR des Fonds zum VaR eines Referenzportfolios.

Zusammensetzung des Referenzportfolios:

100% iBoxx Euro Sov. Eurozone in EUR

Maximalgrenze: 200,00%

Limitauslastung für das Marktrisiko

minimale Auslastung:	0,00%
maximale Auslastung:	153,13%
durchschnittliche Auslastung:	96,89%

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 30.06.2022 (Tag der Liquidation) auf Basis der Methode einer historischen Simulation berechnet. Der VaR wird mit einem Konfidenzintervall von 99%, einer Haltedauer von 20 Tagen sowie einer Zeitreihe von einem Jahr berechnet.

Die Verwaltungsgesellschaft berechnet die Hebelwirkung in Übereinstimmung mit der Pressemitteilung 12/29 der CSSF v. 31.07.2012 sowohl nach dem Ansatz der Summe der Nominalen („Bruttomethode“) als auch auf Grundlage des Commitment-Ansatzes („Nettomethode“). Anteilinhaber sollten beachten, dass Derivate für verschiedene Zwecke eingesetzt werden können, insbesondere für Absicherungs- und Investmentzwecke. Die Berechnung der Hebelwirkung nach der Bruttomethode unterscheidet nicht zwischen den unterschiedlichen Zielsetzungen des Derivateeinsatzes und liefert daher keine Indikation über den Risikogehalt des Fonds. Eine Indikation des Risikogehaltes des Fonds wird dagegen durch die Nettomethode gegeben, da sie auch den Einsatz von Derivaten zu Absicherungszwecken angemessen berücksichtigt.

Hebelwirkung im Rumpfgeschäftsjahr

(Nettomethode)	(Bruttomethode)
0,1	0,4

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteil bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								681.339.520,54	97,28
Aktien								675.001.075,10	96,37
EUR								98.125.584,40	14,02
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		311.375	242.919	0	EUR 27,130	8.447.603,75	1,21
FR0006174348	Bureau Veritas SA Actions au Porteur	STK		83.664	67.106	0	EUR 24,840	2.078.213,76	0,30
FR001400AJ45	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom.	STK		16.296	16.296	0	EUR 26,465	431.273,64	0,06
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port.	STK		110.867	110.867	0	EUR 49,760	5.516.741,92	0,79
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		199.042	183.226	0	EUR 18,814	3.744.776,19	0,53
FI0009007884	Elisa Oyj Reg.Shares Cl.A	STK		129.092	91.541	15.508	EUR 49,790	6.427.490,68	0,92
DE000A02ZZZ5	freenet AG Namens-Aktien	STK		151.276	91.315	0	EUR 20,580	3.113.260,08	0,44
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK		16.950	10.267	0	EUR 185,950	3.151.852,50	0,45
DE0006048408	Henkel AG & Co. KGaA	STK		663	0	0	EUR 60,350	40.012,05	0,01
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien Inhaber-Vorzugsaktien	STK		40.970	40.970	6.653	EUR 65,240	2.672.882,80	0,38
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK		155.905	155.905	0	EUR 10,975	1.711.057,38	0,24
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins SGPS, S.A. Acções Nominativas	STK		79.361	69.189	0	EUR 20,320	1.612.615,52	0,23
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B	STK		76.481	48.480	0	EUR 20,870	1.596.158,47	0,23
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK		1.856.118	1.925.467	126.208	EUR 2,922	5.423.576,80	0,77
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		10.179	8.844	0	EUR 337,100	3.431.340,90	0,49
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK		206.421	206.421	0	EUR 9,064	1.870.999,94	0,27
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		30.382	25.489	845	EUR 182,050	5.531.043,10	0,79
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder	STK		128.840	81.824	1	EUR 38,580	4.970.647,20	0,71
FI0009014377	Orion Corp. Reg.Shares Cl.B	STK		55.279	32.164	16.350	EUR 52,020	2.875.613,58	0,41
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		21.077	21.077	0	EUR 59,800	1.260.404,60	0,18
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder	STK		36.534	17.006	0	EUR 57,420	2.097.782,28	0,30
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		335.740	253.415	0	EUR 16,460	5.526.280,40	0,79
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		90.102	72.845	4.250	EUR 90,720	8.174.053,44	1,17
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK		20.988	20.988	0	EUR 96,520	2.025.761,76	0,29
FR0000120966	Société Bic S.A. Actions Port.	STK		6.805	6.805	0	EUR 64,000	435.520,00	0,06
ES0178430E18	Telefónica S.A. Acciones Port.	STK		1.155.507	1.155.507	0	EUR 3,411	3.941.434,38	0,56
FI0009005987	UPM Kymmene Corp. Reg.Shares	STK		21.004	0	0	EUR 35,270	740.811,08	0,11
FR0000127771	Vivendi SE Actions Porteur	STK		354.694	315.505	0	EUR 9,000	3.192.246,00	0,46
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		61.518	43.884	0	EUR 98,900	6.084.130,20	0,87
AUD								16.808.944,71	2,40
AU0000008XB1	Brambles Ltd. Reg.Shares	STK		51.546	0	53.616	AUD 12,070	396.231,18	0,06
AU00000030678	Coles Group Ltd. Reg.Shares	STK		380.252	332.648	0	AUD 16,720	4.049.059,79	0,58
AU000000DXS1	DEXUS Reg.Stapled Secs (Units)	STK		118.212	30.448	0	AUD 7,750	583.458,11	0,08
AU000000MPL3	Medibank Private Ltd. Reg.Shares	STK		859.409	0	0	AUD 2,950	1.614.612,55	0,23
AU000000NAB4	National Australia Bank Ltd. Reg.Shares	STK		271.886	370.048	98.162	AUD 30,060	5.205.017,95	0,74
AU000000TSL2	Telstra Group Ltd. Reg.Shares	STK		1.952.144	3.511.242	1.952.144	AUD 3,990	4.960.565,13	0,71
CAD								59.929.339,96	8,56
CA0636711016	Bank of Montreal Reg.Shares	STK		25.100	20.700	0	CAD 123,450	2.145.224,88	0,31
CA0553487604	BCE Inc. Reg.Shares new	STK		84.000	28.300	0	CAD 59,720	3.473.018,49	0,50
CA1360691010	Canadian Imperial Bk of Comm. Reg.Shares	STK		24.200	12.100	0	CAD 54,960	920.810,15	0,13
CA1363751027	Canadian National Railway Co. Reg.Shares	STK		17.300	17.300	0	CAD 163,040	1.952.757,34	0,28
CA1366812024	Canadian Tire Corp. Ltd. Reg.Shares Cl.A	STK		6.500	14.500	15.200	CAD 142,350	640.588,06	0,09
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK		87.900	43.600	0	CAD 116,920	7.115.176,73	1,02
CA19239C1068	Cogeco Communications Inc. Reg.Shares (Sub. Vtg.)	STK		20.000	2.900	19.100	CAD 75,700	1.048.175,21	0,15
CA9611485090	George Weston Ltd. Reg.Shares	STK		41.400	21.700	8.700	CAD 168,750	4.836.733,21	0,69
CA3759161035	Gildan Activewear Inc. Reg.Shares (Sub.Vtg)	STK		14.400	14.400	0	CAD 36,830	367.174,25	0,05
CA39138C1068	Great-West Lifeco Inc. Reg.Shares	STK		14.000	0	0	CAD 31,530	305.604,69	0,04
CA4488112083	Hydro One Ltd. Reg.Shares	STK		170.100	46.900	35.800	CAD 36,470	4.294.850,86	0,61
CA45823T1066	Intact Financial Corp. Reg.Shares	STK		26.100	6.400	0	CAD 197,750	3.573.263,22	0,51
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares	STK		27.700	11.900	0	CAD 120,220	2.305.496,69	0,33
CA59162N1096	Metro Inc. Reg.Shares	STK		109.200	71.700	17.900	CAD 75,110	5.678.431,75	0,81
CA6330671034	National Bank of Canada Reg.Shares	STK		15.900	15.500	17.100	CAD 91,700	1.009.425,96	0,14
CA6665111002	Northland Power Inc. Reg.Shares	STK		125.500	125.500	0	CAD 37,610	3.267.797,00	0,47
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares Cl.B (Sub.Vtg)	STK		29.900	0	0	CAD 28,930	598.863,21	0,09
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares	STK		37.940	4.200	5.700	CAD 128,660	3.379.472,24	0,48
CA85472N1096	Stantec Inc. Reg.Shares	STK		10.700	10.700	0	CAD 64,480	477.657,74	0,07
CA85853F1053	Stella-Jones Inc. Reg.Shares	STK		5.200	0	0	CAD 48,520	174.675,56	0,02
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK		62.800	20.000	18.500	CAD 63,360	2.754.754,00	0,39
CA87971M1032	TELUS Corp. Reg.Shares	STK		134.200	149.800	81.000	CAD 26,410	2.453.742,17	0,35
CA0641491075	The Bank of Nova Scotia Reg.Shares	STK		50.900	11.400	14.500	CAD 66,630	2.347.986,56	0,34
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK		28.280	20.300	0	CAD 88,540	1.733.512,32	0,25
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK		45.500	35.000	0	CAD 97,590	3.074.147,67	0,44
CHF								45.668.720,78	6,51
CH0009002962	Barry Callebaut AG Namens-Aktien	STK		1.457	1.457	0	CHF 1.827,000	2.698.845,72	0,39
CH0360674466	Galenica AG Namens-Aktien	STK		41.275	38.522	0	CHF 76,050	3.182.484,22	0,45
CH0030170408	Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.)	STK		3.067	1.596	2.276	CHF 438,800	1.364.458,57	0,19

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG Namens-Aktien		STK	3.302	0	0	CHF 218,500	731.490,13	0,10
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien		STK	35.424	24.617	0	CHF 107,820	3.872.370,34	0,55
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien		STK	115.518	98.576	0	CHF 84,500	9.896.607,10	1,40
CH0018294154	PSP Swiss Property AG Namens-Aktien		STK	35.075	25.856	0	CHF 109,800	3.904.630,83	0,56
CH0239229302	SFS Group AG Nam.-Aktien		STK	5.774	5.774	0	CHF 87,400	511.644,34	0,07
CH0002497458	SGS S.A. Namens-Aktien		STK	1.045	788	362	CHF 2.166,000	2.294.852,10	0,33
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien		STK	851	0	0	CHF 480,200	414.315,97	0,06
CH0008038389	Swiss Prime Site AG Namens-Aktien		STK	45.100	34.867	0	CHF 80,750	3.692.317,44	0,53
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien		STK	16.513	9.420	0	CHF 508,400	8.511.605,40	1,22
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien		STK	10.185	4.324	0	CHF 444,800	4.593.098,62	0,66
DKK								9.813.048,54	1,40
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B		STK	58.853	47.393	10.390	DKK 943,900	7.469.942,34	1,07
DK0060636678	Tryg AS Navne-Aktier		STK	104.403	65.735	0	DKK 166,900	2.343.106,20	0,33
GBP								34.730.497,86	4,93
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares		STK	124.890	77.363	0	GBP 13,370	1.886.393,91	0,27
GB00BD6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares		STK	123.623	123.623	0	GBP 19,290	2.694.044,84	0,38
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares		STK	305.713	305.713	0	GBP 14,458	4.993.389,46	0,71
GB0031638363	Intertek Group PLC Reg.Shares		STK	4.044	0	0	GBP 40,600	185.485,73	0,03
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares		STK	275.282	261.028	0	GBP 23,070	7.174.617,01	1,02
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC Reg.Shares		STK	198.014	198.014	0	GBP 16,060	3.592.648,69	0,51
GB0007908733	SSE PLC Shares		STK	80.959	208.973	128.014	GBP 17,175	1.570.851,73	0,22
GB00BP92CJ43	Tate & Lyle PLC Reg.Shares		STK	167.599	167.600	1	GBP 7,172	1.357.953,87	0,19
GB00BLGZ9862	Tesco PLC Reg.Shs		STK	538.898	1.220.251	861.284	GBP 2,255	1.372.860,57	0,20
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares		STK	208.645	182.669	0	GBP 42,010	9.902.252,05	1,40
JPY								31.636.226,27	4,51
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares		STK	42.200	0	0	JPY 2.006,500	602.128,36	0,09
JP3219000001	Kamigumi Co. Ltd. Reg.Shares		STK	50.600	15.900	0	JPY 2.687,000	966.842,31	0,14
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares		STK	184.660	136.800	82.700	JPY 3.982,000	5.228.914,63	0,75
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares		STK	137.000	131.200	0	JPY 5.532,000	5.389.397,33	0,77
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares		STK	219.700	133.500	71.100	JPY 3.762,000	5.877.414,40	0,84
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares		STK	32.100	0	0	JPY 3.083,000	703.746,13	0,10
JP3421800008	Secom Co. Ltd. Reg.Shares		STK	18.900	11.300	0	JPY 7.543,000	1.013.779,20	0,14
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares		STK	305.800	305.800	0	JPY 2.333,500	5.074.377,24	0,72
JP3732000009	SoftBank Corp. Reg.Shares		STK	410.000	410.000	0	JPY 1.488,000	4.338.346,67	0,62
JP3431900004	Sohgo Security Services Co.Ltd Reg.Shares		STK	12.200	0	0	JPY 3.595,000	311.886,22	0,04
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares		STK	51.100	22.300	19.200	JPY 5.860,000	2.129.393,78	0,30
NOK								10.539.735,67	1,50
NO0010161896	DNB Bank ASA Navne-Aksjer		STK	184.791	164.672	0	NOK 194,900	3.422.673,45	0,49
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer		STK	223.349	87.749	0	NOK 192,700	4.090.143,43	0,58
NO0003733800	Orkla ASA Navne-Aksjer		STK	447.602	182.409	0	NOK 71,160	3.026.918,79	0,43
NZD								1.874.289,89	0,27
SE0010161896	Spark New Zealand Ltd. Reg.Shares		STK	584.414	296.846	0	NZD 5,400	1.874.289,89	0,27
SEK								13.780.179,38	1,96
SE0007100581	Assa-Abloy AB Namn-Aktier B		STK	28.122	0	0	SEK 226,500	572.155,27	0,08
SE0006993770	Axfood AB Namn-Aktier		STK	92.019	28.940	15.535	SEK 288,900	2.387.946,24	0,34
SE0000190126	Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria)		STK	42.914	28.027	0	SEK 256,300	987.977,60	0,14
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A		STK	326.107	203.587	0	SEK 105,450	3.088.916,72	0,44
SE0005190238	Tele2 AB Namn-Aktier B		STK	612.732	460.486	45.548	SEK 85,840	4.724.542,55	0,67
SE0000667925	Telia Company AB Namn-Aktier		STK	545.648	292.160	0	SEK 26,890	1.317.961,92	0,19
SE0000115420	Volvo (publ), AB Namn-Aktier A (fria)		STK	39.100	0	0	SEK 199,500	700.679,08	0,10
USD								352.094.507,64	50,31
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares		STK	7.219	0	0	USD 110,310	746.149,35	0,11
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	18.922	4.589	0	USD 162,560	2.882.136,63	0,41
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A		STK	5.244	0	0	USD 268,380	1.318.702,01	0,19
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares		STK	54.713	54.713	0	USD 72,080	3.695.210,16	0,53
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares		STK	11.953	0	0	USD 151,090	1.692.179,69	0,24
US00971T1016	Akamai Technologies Inc. Reg.Shares		STK	15.968	0	0	USD 84,700	1.267.265,96	0,18
IE00BFR3W74	Allegion PLC Reg.Shares		STK	14.438	0	0	USD 106,740	1.444.002,92	0,21
US03073E1055	AmerisourceBergen Corp. Reg.Shares		STK	22.883	18.180	0	USD 166,050	3.560.292,48	0,51
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	19.555	8.854	0	USD 263,160	4.821.826,00	0,69
US0017441017	AMN Healthcare Services Inc. Reg.Shares		STK	18.972	18.972	0	USD 103,000	1.830.982,43	0,26
US0326541051	Analog Devices Inc. Reg.Shares		STK	1.274	0	0	USD 163,980	195.746,56	0,03
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	11.897	16.770	4.873	USD 129,610	1.444.806,91	0,21
US04621X1081	Assurant Inc. Reg.Shares		STK	14.342	14.342	0	USD 126,630	1.701.688,88	0,24
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	24.593	12.137	0	USD 240,620	5.544.687,43	0,79
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares		STK	17.333	10.457	0	USD 256,900	4.172.263,01	0,60
US1046741062	Brady Corp. Reg.N.Vot.Shs Cl.A		STK	8.648	0	0	USD 47,700	387.083,59	0,06
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	57.021	0	0	USD 72,100	3.852.156,57	0,55
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)		STK	32.082	10.278	0	USD 92,250	2.773.075,19	0,40
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	1.886	0	0	USD 161,930	286.155,99	0,04
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares		STK	56.238	56.238	0	USD 126,870	6.685.326,83	0,95
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	59.518	59.518	0	USD 77,550	4.324.779,48	0,62
IL0010824113	Check Point Software Techs Ltd Reg.Shares		STK	23.987	23.987	0	USD 126,100	2.834.163,22	0,40
US16359R1032	Chemed Corp. Reg.Shares		STK	8.686	8.686	0	USD 517,150	4.208.915,34	0,60

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares		STK	18.759	18.759	0	USD 222,080	3.903.489,08	0,56
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	98.050	30.857	0	USD 47,500	4.363.902,55	0,62
US1924461023	Cognizant Technology Sol. Corp. Reg.Shs C.I.A		STK	38.771	37.694	17.607	USD 57,130	2.075.415,54	0,30
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares		STK	100.199	64.169	19.779	USD 79,370	7.451.669,83	1,06
US20602D1019	Concentrix Corp. Reg.Shares		STK	7.418	7.418	0	USD 134,160	932.489,00	0,13
US2244411052	Crane Holdings Co. Reg.Shares		STK	32.350	32.350	0	USD 100,560	3.048.129,30	0,44
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares		STK	14.796	5.046	0	USD 241,730	3.351.264,54	0,48
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares		STK	27.020	19.486	0	USD 93,450	2.365.911,45	0,34
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares C.I.A		STK	113.120	113.120	0	USD 22,340	2.367.862,08	0,34
US2855121099	Electronic Arts Inc. Reg.Shares		STK	63.339	46.941	0	USD 122,190	7.251.714,60	1,04
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	11.283	11.283	0	USD 512,880	5.422.183,22	0,77
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares		STK	722	0	0	USD 367,020	248.290,88	0,04
US2910111044	Emerson Electric Co. Reg.Shares		STK	5.827	0	0	USD 96,360	526.108,90	0,08
US2021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares		STK	28.269	0	0	USD 105,210	2.786.771,13	0,40
US3119001044	Fastenal Co. Reg.Shares		STK	7.656	0	0	USD 47,560	341.175,32	0,05
US3434981011	Flowers Foods Inc. Reg.Shares		STK	289.591	259.890	30.650	USD 28,950	7.855.384,82	1,12
US3535141028	Franklin Electric Co. Inc. Reg.Shares		STK	20.895	0	0	USD 80,380	1.573.708,22	0,22
US3029411093	FTI Consulting Inc. Reg.Shares		STK	17.562	17.562	0	USD 159,330	2.621.835,05	0,37
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	3.935	3.935	0	USD 340,220	1.254.406,84	0,18
US6687711084	Gen Digital Inc. Reg.Shares		STK	65.730	65.730	0	USD 21,250	1.308.749,12	0,19
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares		STK	82.171	84.832	44.236	USD 84,380	6.496.686,79	0,93
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	74.520	56.122	0	USD 85,260	5.953.221,08	0,85
US8064071025	Henry Schein Inc. Reg.Shares		STK	90.925	79.476	0	USD 80,610	6.867.617,01	0,98
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares		STK	109.464	109.464	0	USD 15,920	1.632.857,23	0,23
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	109.305	102.457	0	USD 76,100	7.793.966,27	1,11
US4404521001	Hormel Foods Corp. Reg.Shares		STK	91.630	72.270	10.006	USD 45,510	3.907.314,41	0,56
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares		STK	30.784	30.784	0	USD 27,040	779.947,87	0,11
US4435106079	Hubbell Inc. Reg.Shares		STK	761	0	0	USD 235,340	167.808,61	0,02
US4523081093	Illinois Tool Works Inc. Reg.Shares		STK	7.768	0	3.041	USD 221,970	1.615.612,99	0,23
US4606901001	Interpublic Group of Comp.Inc. Reg.Shares		STK	134.513	134.513	0	USD 33,580	4.232.322,83	0,60
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares		STK	32.504	19.880	0	USD 141,060	4.296.101,42	0,61
US8326964058	J.M. Smucker Co. Reg.Shares		STK	45.029	49.551	9.918	USD 158,560	6.689.902,31	0,96
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	34.516	34.516	0	USD 133,220	4.308.476,48	0,62
US4878361082	Kellogg Co. Reg.Shares		STK	94.771	93.388	29.272	USD 71,470	6.346.482,43	0,91
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc. Reg.Shares		STK	39.595	39.595	0	USD 35,830	1.329.293,84	0,19
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares		STK	26.487	13.214	5.675	USD 137,240	3.406.020,97	0,49
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares		STK	22.937	13.399	0	USD 235,490	5.061.076,72	0,72
US5150981018	Landstar System Inc. Reg.Shares		STK	27.545	21.544	0	USD 164,780	4.252.860,25	0,61
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares		STK	3.841	0	0	USD 202,260	727.927,53	0,10
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	41.686	26.636	0	USD 166,780	6.514.304,13	0,93
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares		STK	38.688	0	13.777	USD 47,230	1.712.095,80	0,24
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	41.710	0	0	USD 110,820	4.331.039,78	0,62
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	391	0	0	USD 1.467,110	537.493,57	0,08
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	32.554	22.969	7.144	USD 241,010	7.351.454,24	1,05
US6092071058	Mondelez International Inc. Reg.Shares C.I.A		STK	44.361	25.500	0	USD 66,970	2.783.655,35	0,40
US6200763075	Motorola Solutions Inc. Reg.Shares		STK	6.152	0	0	USD 258,810	1.491.870,81	0,21
US5534981064	MSA Safety Inc. Reg.Shares		STK	3.760	0	0	USD 144,700	509.788,71	0,07
IE00BDVJJQ56	nVent Electric PLC Reg.Shares		STK	40.377	40.377	0	USD 38,190	1.444.832,64	0,21
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	67.234	67.234	0	USD 87,000	5.480.775,83	0,78
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares		STK	10.090	9.216	0	USD 98,590	932.090,04	0,13
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares		STK	31.058	26.387	0	USD 116,460	3.389.097,85	0,48
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares		STK	31.257	25.108	7.657	USD 181,980	5.329.724,86	0,76
US74051N1028	Premier Inc. Reg.Shares		STK	149.701	115.483	0	USD 34,950	4.902.365,85	0,70
US7433121008	Progress Software Corp. Reg.Shares		STK	124.458	86.110	0	USD 50,450	5.883.257,06	0,84
US7433151039	Progressive Corp. Reg.Shares		STK	21.627	15.550	0	USD 130,560	2.645.697,93	0,38
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares		STK	58.945	40.641	0	USD 156,790	8.659.626,66	1,24
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	7.364	7.368	926	USD 721,290	4.976.884,10	0,71
US7703231032	Robert Half International Inc. Reg.Shares		STK	17.420	17.420	0	USD 73,870	1.205.730,05	0,17
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares		STK	34.839	39.475	4.636	USD 230,210	7.514.908,59	1,07
US87901J1051	TEGNA Inc. Reg.Shares		STK	82.780	56.668	0	USD 21,270	1.649.782,71	0,24
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares		STK	24.852	572	0	USD 165,020	3.842.658,27	0,55
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares		STK	87.242	77.325	0	USD 63,950	5.227.571,70	0,75
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares		STK	31.422	26.217	11.181	USD 233,250	6.867.352,07	0,98
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	5.084	0	1.665	USD 320,410	1.526.319,46	0,22
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares		STK	86.744	57.212	9.582	USD 44,620	3.626.626,64	0,52
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	21.971	15.277	27.463	USD 152,590	3.141.302,31	0,45
US89417E1091	The Travelers Companies Inc. Reg.Shares		STK	20.020	20.020	0	USD 189,440	3.553.608,62	0,51
US8725401090	TJX Companies Inc. Reg.Shares		STK	1.813	0	0	USD 79,340	134.779,50	0,02
US9038453031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares		STK	13.782	13.782	0	USD 464,830	6.002.611,44	0,86
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	9.300	5.199	0	USD 529,880	4.617.366,13	0,66
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	130.665	77.541	24.467	USD 39,260	4.806.660,01	0,69
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	10.599	13.587	11.983	USD 289,080	2.870.891,47	0,41
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	13.715	9.799	2.705	USD 562,220	7.224.968,19	1,03
US94106L1098	Waste Management Inc. Reg.Shares		STK	13.353	12.441	0	USD 158,870	1.987.717,13	0,28

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares		STK	13.577	9.792	0	USD 345,880	4.400.105,65	0,63	
US9427491025	Watts Water Technologies Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	3.547	0	0	USD 149,080	495.466,63	0,07	
US9507551086	Werner Enterprises Inc. Reg.Shares		STK	122.821	62.139	0	USD 40,690	4.682.676,50	0,67	
IE00BDB6Q211	Willis Towers Watson PLC Reg.Shares		STK	31.625	31.625	0	USD 245,240	7.267.008,67	1,04	
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	16.312	0	0	USD 129,990	1.986.785,55	0,28	
Sonstige Beteiligungswertpapiere								6.338.445,44	0,91	
CHF								6.338.445,44	0,91	
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	21.308	15.730	0	CHF 293,400	6.338.445,44	0,91	
Summe Wertpapiervermögen							EUR	681.339.520,54	97,28	
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) März 23		XEUR	EUR	Anzahl 115				-556.314,49	-0,08	
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) März 23		XCME	USD	Anzahl 48				-157.837,50	-0,02	
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) März 23		XOSE	JPY	Anzahl 16				-344.965,88	-0,05	
Summe der Aktienindex-Derivate								EUR	-556.314,49	-0,08
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds										
Bankguthaben										
EUR-Guthaben bei										
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	13.895.160,08			% 100,000	13.895.160,08	1,97	
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			CZK	0,05			% 100,000	0,00	0,00	
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	322.884,50			% 100,000	43.418,00	0,01	
DekaBank Deutsche Girozentrale			HUF	0,52			% 100,000	0,00	0,00	
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	300.529,16			% 100,000	28.560,08	0,00	
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	1.580.161,05			% 100,000	141.938,71	0,02	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	2.745.331,97			% 100,000	1.748.401,93	0,25	
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	187.296,22			% 100,000	129.669,26	0,02	
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	177.558,95			% 100,000	180.020,73	0,03	
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	117.527,84			% 100,000	132.774,31	0,02	
DekaBank Deutsche Girozentrale			HKD	1.656.618,65			% 100,000	199.045,83	0,03	
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	50.085.335,00			% 100,000	356.162,38	0,05	
DekaBank Deutsche Girozentrale			NZD	183.218,17			% 100,000	108.815,54	0,02	
DekaBank Deutsche Girozentrale			SGD	173.938,65			% 100,000	121.516,45	0,02	
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	1.796.785,23			% 100,000	1.683.565,45	0,24	
Summe der Bankguthaben								EUR	18.769.048,75	2,68
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR	18.769.048,75	2,68
Sonstige Vermögensgegenstände										
Dividendenansprüche			EUR	502.857,88				502.857,88	0,07	
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	466.619,20				466.619,20	0,07	
Einschüsse (Initial Margins)			JPY	12.800.000,00				91.022,22	0,01	
Einschüsse (Initial Margins)			USD	552.000,00				517.217,15	0,07	
Forderungen aus Anteilschneidgeschäften			EUR	106.441,92				106.441,92	0,02	
Summe der sonstigen Vermögensgegenstände								EUR	1.684.158,37	0,24
Sonstige Verbindlichkeiten										
Verwaltungsvergütung			EUR	-719.146,08				-719.146,08	-0,10	
Verbindlichkeiten aus Anteilschneidgeschäften			EUR	-78.637,38				-78.637,38	-0,01	
Kostenpauschale			EUR	-103.557,04				-103.557,04	-0,01	
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	-2.347,28				-2.347,28	0,00	
Summe der sonstigen Verbindlichkeiten								EUR	-903.687,78	-0,12
Fondsvermögen										
Umlaufende Anteile								EUR	700.332.725,39	100,00
Anteilwert								STK	12.263.237,000	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								EUR	57,11	
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)										97,28
										-0,08

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

Zusätzliche Angaben zu den Derivaten **)

Instrumentenart	Kontrahent	Counterparty Exposure in EUR
Aktienindex-Terminkontrakte	CME Globex	-344.965,88
Aktienindex-Terminkontrakte	Eurex Deutschland	-157.837,50
Aktienindex-Terminkontrakte	Osaka Exchange - Futures and Options	-53.511,11

***) Zu diesen Geschäften wurden keine Sicherheiten hinterlegt

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

In-/ ausländische Aktien und Derivate per: 29./30.12.2022

Alle anderen Vermögenswerte per: 30.12.2022

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.12.2022

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88517	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43665	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,52270	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,13270	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,98633	= 1 Euro (EUR)
Tschechische Republik, Kronen	(CZK)	24,14550	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	400,24000	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06725	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,44442	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,43140	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	140,62500	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,32280	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,57020	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,68375	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)

Aus den zum Stichtag noch laufenden, nachfolgend aufgeführten Geschäften ergeben sich zum 31.12.2022 folgende Verpflichtungen aus Derivaten:

Finanztermingeschäfte
- gekaufte Terminkontrakte
auf Indices

EUR

15.242.717,15

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.

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				
AU000000ANN9	Ansell Ltd. Reg.Shares	STK	0	11.188
AU000000ASX7	ASX Ltd. Reg.Shares	STK	0	700
AU000000MTS0	Metcash Ltd. Reg.Shares	STK	64.213	397.066
AU000000WES1	Wesfarmers Ltd. Reg.Shares	STK	0	16.457
CAD				
CA1367178326	Canadian Utilities Ltd. Reg.Shs Cl.A (Non Voting)	STK	99.000	99.000
CA7751092007	Rogers Communications Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	0	34.700
CA8934631091	TransAlta Renewables Inc. Reg.Shares	STK	0	49.600
CHF				
CH0012829898	Emmi AG Namens-Aktien	STK	0	274
DKK				
DK0010253921	Schouw & Co. AS Navne-Aktier	STK	0	1.644
EUR				
DE000A1DAH00	Brenntag SE Namens-Aktien	STK	0	42.569
ES0130960018	Enagas S.A. Acciones Port.	STK	0	16.151
BE0974256852	Établissements Fr. Colruyt SA	STK	0	25.143
FR0014008VX5	EuroAPI SAS Actions Nom.	STK	3.037	3.037
BE0003797140	Groupe Bruxelles Lambert SA(GBL) Act.au Porteur	STK	0	7.544
IT0005211237	Italgas S.P.A. Azioni nom.	STK	68.380	68.380
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	3.938
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE Namens-Aktien	STK	0	20.110
IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom.	STK	0	132.632
DE0008303504	TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien	STK	0	7.759
GBP				
GB00B02J6398	Admiral Group PLC Reg.Shares	STK	0	13.754
GB00BJFFLV09	Croda International PLC Reg.Shares	STK	0	4.757
GB00BMX86B70	Haleon PLC Reg.Shares	STK	285.553	285.553
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg.Shares	STK	149.850	149.850

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
GB0032089863	NEXT PLC Reg.Shares	STK	0	12.242
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC Reg.Shares	STK	0	20.390
HKD				
HK0066009694	MTR Corporation Ltd. Reg.Shares	STK	0	85.000
HK0016000132	Sun Hung Kai Properties Ltd. Reg.Shares	STK	0	128.500
HK0000063609	Swire Properties Ltd. Reg.Shares	STK	0	151.600
JPY				
JP3837800006	Hoya Corp. Reg.Shares	STK	0	6.900
JP3902400005	Mitsubishi Electric Corp. Reg.Shares	STK	0	45.000
JP3914400001	Murata Manufacturing Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	6.300
JP3188220002	Otsuka Holdings Company Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.200
JP3939000000	Yamada Holdings Co. Ltd. Ltd. Reg.Shares	STK	0	201.100
NOK				
NO0010716418	Entra ASA Navne-Aksjer	STK	4.572	4.572
NO0010063308	Telenor ASA Navne-Aksjer	STK	50.401	187.146
SEK				
SE0009922164	Essity AB Namn-Aktier B	STK	0	28.016
SGD				
SG1J26887955	Singapore Exchange Ltd. Reg.Shares	STK	0	144.000
USD				
US0718131099	Baxter International Inc. Reg.Shares	STK	0	10.958
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares	STK	0	12.512
US09247X1019	Blackrock Inc. Reg.Shares	STK	0	2.457
US2058871029	ConAgra Brands Inc. Reg.Shares	STK	0	22.102
US2786421030	eBay Inc. Reg.Shares	STK	0	9.402
US28176E1082	Edwards Lifesciences Corp. Reg.Shares	STK	0	7.414
US29082K1051	Embeckta Corp. Reg.Shares	STK	2.349	2.349
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	10.122	10.122
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares	STK	0	25.172
US4612021034	Intuit Inc. Reg.Shares	STK	0	1.131
US46266C1053	IQVIA Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	2.440
JE00BYPZJM29	Janus Henderson Group PLC Reg.Shares	STK	0	12.146
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle Inc. Reg.Shares	STK	8.629	8.629
US49926D1090	Knowles Corp. Reg.Shares	STK	17.767	17.767
US68389X1054	Oracle Corp. Reg.Shares	STK	0	14.451
US7739031091	Rockwell Automation Inc. Reg.Shares	STK	0	5.189
US8354951027	Sonoco Products Co. Reg.Shares	STK	0	17.328
US8448951025	Southwest Gas Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	1.080
IE00BFY8C754	Steris PLC Reg.Shares	STK	6.978	8.622
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares	STK	0	11.953
IE00BK9ZQ967	Trane Technologies PLC Reg.Shares	STK	0	1.888
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	0	6.463
US92343X1000	Verint Systems Inc. Reg.Shares	STK	14.508	14.508
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06784309G2	Telefónica S.A. Anrechte	STK	665.131	665.131
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
AUD				
AU000000ANZ3	Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Reg.Shares	STK	75.609	75.609
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
AUD				
AU000000AST5	AusNet Services Ltd. Reg.Shares	STK	0	333.465
AU0000245342	Telstra Group Ltd. Reg.Def.Shares	STK	1.952.144	1.952.144
EUR				
FR0000121261	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom.	STK	0	4.074
GBP				
GB0009252882	GSK PLC Reg.Shares	STK	272.634	285.553
GB0002405495	Schroders PLC Reg.Shares	STK	0	30.727
GB0008754136	Tate & Lyle PLC Reg.Shares	STK	0	74.622
SEK				
SE0017859044	AXFOOD AB Namn-Aktier (Em.05/2022)	STK	2.620	2.620
SE0000652216	ICA Gruppen AB Aktier	STK	0	7.983
USD				
US1567821046	Cerner Corp. Reg.Shares	STK	15.253	58.908
US1773761002	Citrix Systems Inc. Reg.Shares	STK	19.042	19.042
US2243991054	Crane Co. Reg.Shares	STK	10.517	10.517
Andere Wertpapiere				
AUD				
AU0000232860	Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Anrechte	STK	5.040	5.040
SEK				
SE0017859036	Axfood AB Anrechte	STK	78.614	78.614

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Geschäftsjahres		EUR
Mittelzuflüsse	443.098.188,01	308.728.437,04
Mittelrückflüsse	-25.875.460,97	
Mittelzuflüsse /-rückflüsse (netto)		417.222.727,04
Ertragsausschüttung		-3.206.117,04
Ertragsausgleich		-2.618.877,93
Ordentlicher Ertragsüberschuss		5.073.265,82
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)*)		1.539.243,37
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses*)		-26.405.952,91
Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		700.332.725,39

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

Anzahl des Anteilumlaufs am Beginn des Geschäftsjahres	5.145.550,000
Anzahl der ausgegebenen Anteile	7.560.125,000
Anzahl der zurückgezahlten Anteile	442.438,000
Anzahl des Anteilumlaufs am Ende des Geschäftsjahres	12.263.237,000

Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich Geschäftsjahr

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende	Anteilwert	Anteilumlauf
	des Geschäftsjahres		
	EUR	EUR	Stück
2019	18.242.204,09	52,72	346.011,000
2020	122.647.511,60	49,11	2.497.296,000
2021	308.728.437,04	60,00	5.145.550,000
2022	700.332.725,39	57,11	12.263.237,000

Vergangenheitsbezogene Werte gewähren keine Rückschlüsse für die Zukunft.

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Ertrags- und Aufwandsrechnung

für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 31.12.2022 (inkl. Ertragsausgleich)

	EUR
Erträge	
Dividenden	10.323.038,80
Zinsen aus Liquiditätsanlagen	15.447,34
davon aus negativen Einlagezinsen	-39.253,59
davon aus positiven Einlagezinsen	54.700,93
Sonstige Erträge***)	27.028,52
Ordentlicher Ertragsausgleich	5.262.252,52
Erträge insgesamt	15.627.767,18
Aufwendungen	
Verwaltungsvergütung	5.891.881,34
Taxe d'Abonnement	218.590,36
Zinsen aus Kreditaufnahmen	155,81
Kostenpauschale**)	848.430,92
Sonstige Aufwendungen****)	32.384,24
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	18.461,24
Ordentlicher Aufwandsausgleich	3.563.058,69
Aufwendungen insgesamt	10.554.501,36
Ordentlicher Ertragsüberschuss	5.073.265,82
Netto realisiertes Ergebnis*) *****)	619.559,27
Außerordentlicher Ertragsausgleich	919.684,10
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)	1.539.243,37
Ertragsüberschuss	6.612.509,19
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses*)	-26.405.952,91
Ergebnis des Geschäftsjahres	-19.793.443,72

Gemäß Art. 15 Grundreglement in Verbindung mit Art. 6 Sonderreglement beträgt die Ausschüttung EUR 1,02 je Anteil und wird per 24. Februar 2023 mit Beschlussfassung vom 14. Februar 2023 vorgenommen.

Die vorgenannten Aufwendungen betragen bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen (Gesamtkostenquote / laufende Kosten (Ongoing Charges)) 1,48%.

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt: 554.489,56 EUR
- davon aus EMIR-Kosten: 0,00 EUR

- *) Ergebnis-Zusammensetzung:
Netto realisiertes Ergebnis aus: Wertpapier-, Devisen-, Devisentermin-, Finanztermin- und Optionsgeschäften
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses aus: Wertpapier-, Devisen-, Finanztermin- und Optionsgeschäften
- ***) In dieser Position enthalten sind im Wesentlichen Erträge aus REITs.
- ****) In dieser Position enthalten sind im Wesentlichen Researchkosten.
- *****) In diesem Betrag enthalten sind Schadensersatzzahlungen (abzüglich einer marktüblichen Gebühr) aus den Class-Action-Verfahren gegen Ageas SAVV (Fortis), Bank of New York Mellon, Equifax Inc. (N.D. Ga.), General Motors Company und The Southern Company.

Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Relativer VaR

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Verwaltungsgesellschaft den **relativen Value at Risk-Ansatz** im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an. Die Limitauslastung berechnet sich als Verhältnis des VaR des Fonds zum VaR eines Referenzportfolios.

Zusammensetzung des Referenzportfolios:

100% MSCI World Net Return in EUR

Maximalgrenze: 200,00%

Limitauslastung für das Marktrisiko

minimale Auslastung:	52,71%
maximale Auslastung:	78,79%
durchschnittliche Auslastung:	66,10%

Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 31.12.2022 auf Basis der Methode einer historischen Simulation berechnet. Der VaR wird mit einem Konfidenzintervall von 99%, einer Haltedauer von 20 Tagen sowie einer Zeitreihe von einem Jahr berechnet.

Die Verwaltungsgesellschaft berechnet die Hebelwirkung in Übereinstimmung mit der Pressemitteilung 12/29 der CSSF v. 31.07.2012 sowohl nach dem Ansatz der Summe der Nominalen („Bruttomethode“) als auch auf Grundlage des Commitment-Ansatzes („Nettomethode“). Anteilhaber sollten beachten, dass Derivate für verschiedene Zwecke eingesetzt werden können, insbesondere für Absicherungs- und Investmentzwecke. Die Berechnung der Hebelwirkung nach der Bruttomethode unterscheidet nicht zwischen den unterschiedlichen Zielsetzungen des Derivateeinsatzes und liefert daher keine Indikation über den Risikogehalt des Fonds. Eine Indikation des Risikogehaltes des Fonds wird dagegen durch die Nettomethode gegeben, da sie auch den Einsatz von Derivaten zu Absicherungszwecken angemessen berücksichtigt.

Hebelwirkung im Geschäftsjahr

(Nettomethode)	(Bruttomethode)
0,0	0,0

Fondszusammensetzung.

	Deka Portfolio Renten (Liquidation am 30.06.2022) in EUR	Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien in EUR	Gesamt in EUR
Vermögensaufstellung			
Wertpapiervermögen	0,00	681.339.520,54	681.339.520,54
Derivate	0,00	-556.314,49	-556.314,49
Bankguthaben/Geldmarktfonds	0,00	18.769.048,75	18.769.048,75
Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	1.684.158,37	1.684.158,37
Sonstige Verbindlichkeiten	0,00	-903.687,78	-903.687,78
Fondsvermögen	0,00	700.332.725,39	700.332.725,39
Ertrags- und Aufwandsrechnung			
Erträge			
Wertpapierzinsen	-7.021,94	0,00	-7.021,94
Zinsen aus Liquiditätsanlagen	-1.013,68	15.447,34	14.433,66
Dividenden	0,00	10.323.038,80	10.323.038,80
Erträge aus Wertpapierleihe	973,81	0,00	973,81
Sonstige Erträge	4.868,36	27.028,52	31.896,88
Ordentlicher Ertragsausgleich	2.193,42	5.262.252,52	5.264.445,94
Erträge insgesamt	-0,03	15.627.767,18	15.627.767,15
Aufwendungen			
Verwaltungsvergütung	36.092,60	5.891.881,34	5.927.973,94
Aufwendungen aus Wertpapierleihe	321,35	0,00	321,35
Kostenpauschale	0,00	848.430,92	848.430,92
Verwahrstellenvergütung	4.812,36	0,00	4.812,36
Taxe d' Abonnement	3.318,12	218.590,36	221.908,48
Zinsen aus Kreditaufnahmen	1.097,42	155,81	1.253,23
Sonstige Aufwendungen	10.958,96	32.384,24	43.343,20
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-56.460,81	3.563.058,69	3.506.597,88
Aufwendungen insgesamt	140,00	10.554.501,36	10.554.641,36
Ordentlicher Ertrags-/ Aufwandsüberschuss	-140,03	5.073.265,82	5.073.125,79
Netto realisiertes Ergebnis	-1.704.469,18	619.559,27	-1.084.909,91
Außerordentlicher Ertragsausgleich	1.678.946,37	919.684,10	2.598.630,47
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)	-25.522,81	1.539.243,37	1.513.720,56
Ertrags-/ Aufwandsüberschuss	-25.662,84	6.612.509,19	6.586.846,35
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses	84.101,18	-26.405.952,91	-26.321.851,73
Ergebnis des Geschäftsjahres	58.438,34	-19.793.443,72	-19.735.005,38
Entwicklung des Fondsvermögens			
Fondsvermögen am Beginn des Geschäftsjahres	13.831.583,37	308.728.437,04	322.560.020,41
Mittelzuflüsse	0,00	443.098.188,01	443.098.188,01
Mittelrückflüsse	-12.142.013,09	-25.875.460,97	-38.017.474,06
Mittelzuflüsse / -rückflüsse (netto)	-12.142.013,09	417.222.727,04	405.080.713,95
Ertragsausschüttung	-10.408,02	-3.206.117,04	-3.216.525,06
Ertragsausgleich	-1.737.600,60	-2.618.877,93	-4.356.478,53
Ordentlicher Ertrags-/ Aufwandsüberschuss	-140,03	5.073.265,82	5.073.125,79
Netto realisiertes Ergebnis (inkl. Ertragsausgleich)	-25.522,81	1.539.243,37	1.513.720,56
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses	84.101,18	-26.405.952,91	-26.321.851,73
Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	0,00	700.332.725,39	700.332.725,39

Anhang.

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft des Fonds Deka Portfolio hat beschlossen, den Teilfonds Deka Portfolio Renten zum 30. Juni 2022 zu liquidieren. Der Jahresabschluss des betroffenen Teilfonds wurde daher nicht unter der Annahme der Unternehmensfortführung aufgestellt.

Angaben zu Bewertungsverfahren

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.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen für die Tätigkeit als Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf die Hauptverwaltung und die Anlagenverwaltung ein Entgelt („Verwaltungsvergütung“), das anteilig monatlich nachträglich auf das durchschnittliche Netto-Fondsvermögen während des betreffenden Monats zu berechnen und auszuzahlen ist.

Die Verwaltungsgesellschaft kann dem Fondsvermögen bis zur Höhe von jährlich 0,10% des durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens die an Dritte gezahlten Vergütungen und Entgelte belasten für

- die Verwaltung von Sicherheiten für Derivate-Geschäfte (sog. Collateral-Management), sowie
- Leistungen im Rahmen der Erfüllung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (europäische Marktinfrastrukturverordnung – sog. EMIR), unter anderem für das zentrale Clearing von OTC-Derivaten und Meldungen an Transaktionsregister einschließlich Kosten für Rechtsträger-Kennungen.

Die Verwahrstelle hat gegen das Fondsvermögen Anspruch auf die folgenden mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbarten Honorare:

a) ein Entgelt für die Tätigkeit als Verwahrstelle, das anteilig monatlich nachträglich auf das durchschnittliche Netto-Fondsvermögen des Fonds während des betreffenden Monats zu berechnen und auszuzahlen ist;

b) Bearbeitungsgebühren für jede Transaktion für Rechnung des Fonds in Höhe der in Luxemburg banküblichen Gebühren.

Die tatsächlich erhobene, gestaffelte Verwahrstellenvergütung ergibt sich für den Teilfonds Deko Portfolio Renten derzeit wie folgt:

- 0,080% für die ersten 75 Mio. Euro des durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens,
- 0,070% für die 75 Mio. übersteigenden Beträge bis zu einem durchschnittlichen Netto-Fondsvermögen von 225 Mio. Euro,
- 0,060% für die 225 Mio. übersteigenden Beträge bis zu einem durchschnittlichen Netto-Fondsvermögen von 1.000 Mio. Euro
- 0,050% für die 1.000 Mio. Euro übersteigenden Beträge des durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Teilfonds Deko Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien eine jährliche Kostenpauschale, die anteilig auf das durchschnittliche Netto-Teilfondsvermögen des betreffenden Monats zu berechnen und zum betreffenden Monatsende auszuführen ist. Für die Berechnung werden die Tageswerte zugrunde gelegt. Die Kostenpauschale umfasst die folgenden Vergütungen und Kosten, die dem Teilfonds nicht separat belastet werden:

- Vergütung der Verwahrstelle
- Kosten gemäß Artikel 17 Absatz 1 Buchstaben b) bis i) des Grundreglements
- Kosten, die im Zusammenhang mit der Verwendung eines Vergleichsmaßstabes entstehen können
- Kosten und Auslagen, die der Verwahrstelle aufgrund einer zulässigen und marktüblichen Beauftragung Dritter gemäß

Artikel 4 Absatz 3 des Grundreglements mit der Verwahrung von Vermögenswerten des Fonds entstehen.

Die Verwahrstelle erhält aus dem Teilfondsvermögen des Teilfonds Deko Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien:

- eine bankübliche Bearbeitungsgebühr für Geschäfte für Rechnung des jeweiligen Teilfonds.

Die Steuer auf das Fondsvermögen („Taxe d’abonnement“, derzeit 0,05% p.a.) ist vierteljährlich nachträglich auf das Fondsvermögen (soweit es nicht in Luxemburger Investmentfonds, die der „Taxe d’abonnement“ unterliegen, angelegt ist) zu berechnen und auszuführen.

Die Verwaltungsgesellschaft kann dem Fondsvermögen der jeweiligen Teilfonds die Kosten für die Bereitstellung von Anlysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte in Bezug auf ein oder mehrere Finanzinstrumente oder sonstige Vermögenswerte oder in Bezug auf die Emittenten oder potenziellen Emittenten von Finanzinstrumenten oder in engem Zusammenhang mit einer bestimmten Branche oder einen bestimmten Markt bis zu einer Höhe von 0,20% p.a. bei Deko Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien und bis zu einer Höhe von 0,10% p.a. bei Deko Portfolio Renten des jährlichen durchschnittlichen Netto-Fondsvermögens des jeweiligen Teilfonds, der aus den Tageswerten errechnet wird, belasten.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für die Anbahnung, Vorbereitung und Durchführung von Wertpapierdarlehensgeschäften, Wertpapierpensionsgeschäften und diesen vergleichbaren zulässigen Geschäften für Rechnung des Fonds eine pauschale Vergütung in Höhe von bis zu 49 Prozent der Erträge aus diesen Geschäften.

Die Ertragsverwendung sowie weitere Modalitäten entnehmen Sie bitte der nachfolgenden Tabelle.

Deko Portfolio				
	Verwaltungsvergütung	Verwahrstellenvergütung	Kostenpauschale	Ertragsverwendung
Deko Portfolio Renten	bis zu 3,00% p.a., zuletzt 0,60% p.a.	gestaffelte Vergütungsstruktur, siehe oben		Ausschüttung
Deko Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien	bis zu 1,50% p.a., derzeit 1,25% p.a.		bis zu 0,28% p.a., derzeit 0,18% p.a.	Ausschüttung

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka International S.A. unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme. Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung“ (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft.

Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka International S.A. umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter und den Vorstand der Deka International S.A. findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlageerfolgsprämien, werden bei der Deka International S.A. nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka International S.A. - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Deka International S.A. bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeiters werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt. Für Mitarbeiter im Unternehmenserfolgsmodell wird zur Bemessung der variablen Vergütung ausschließlich der Unterneh-

menserfolg der Deka-Gruppe (ohne individuelle Zielvorgaben) herangezogen.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeiter erfolgt durch den Vorstand. Die Vergütung des Vorstands wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

Die variable Vergütung des Vorstands der Kapitalverwaltungsgesellschaft und von Mitarbeitern, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitern (zusammen als **„risikorelevante Mitarbeiter“**) unterliegt folgenden Regelungen:

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für den Vorstand der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitern unterhalb der Vorstandsebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
- Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 100 TEUR

nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka International S.A. war im Geschäftsjahr 2021 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2021 fand im

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka International S.A.* gezahlten	
Mitarbeitervergütung	1.715.311,36 EUR
davon feste Vergütung	1.508.936,81 EUR
davon variable Vergütung	206.374,55 EUR
Zahl der Mitarbeiter der KVG	22
Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka International S.A.* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**	< 500.000,00 EUR
davon Vorstand	< 500.000,00 EUR
davon weitere Risktaker	0 EUR
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktion	0 EUR
davon Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Vorstand und Risktaker	0 EUR
* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt	
** weitere Risktaker: alle sonstigen Risktaker, die nicht Vorstand oder Risktaker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risktaker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risktaker oder Vorstand befinden	

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall

Das Auslagerungsunternehmen (Deka Investment GmbH) hat folgende Informationen veröffentlicht:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten	
Mitarbeitervergütung	52.919.423,38 EUR
davon feste Vergütung	43.285.414,31 EUR
davon variable Vergütung	9.634.009,07 EUR
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens	455

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (ungeprüft)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien

Unternehmenskennung (LEI-Code):
529900ZZIDFL1MW1179

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17,25% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum überwiegend in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Investmentanteile (im Folgenden „Zielfonds“), die nach Grundsätzen der Nachhaltigkeit ausgewählt wurden. Bei der Auswahl der Investitionen wurden sowohl ökologische als auch soziale und die verantwortungsvolle Unternehmens- und Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dies erfolgte durch die Anwendung von Ausschlusskriterien sowie einer Analyse und Bewertung der Unternehmen und/oder Staaten anhand von ESG-Kriterien und unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitschancen und -risiken im Rahmen der ESG-Strategie. Die ESG-Strategie zielte darauf ab

- sofern Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen getätigt werden, nur in Unternehmen zu investieren, die verantwortungsvolle Geschäftspraktiken anwenden und keine Umsätze bzw. nur einen geringen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern

erwirtschaften. Als kontrovers werden Geschäftsfelder erachtet, die mit hohen negativen Auswirkungen auf Umwelt und/ oder soziale Belange verbunden sind, da zum Beispiel die Produktion zum Klimawandel, zur sozialen Ungleichheit oder zu Konflikten beiträgt

- sofern Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten getätigt werden, in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten zu investieren, die Verfahrensweisen verantwortungsvoller Staatsführung anwenden, indem sie beispielsweise politische Rechte und bürgerliche Freiheiten achten
- sofern Investitionen in Zielfonds getätigt werden, in Zielfonds zu investieren, die eine gute Nachhaltigkeitsbewertung aufweisen.

Hierzu wurden im Rahmen der ESG-Strategie Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen ausgeschlossen, die

- Umsätze aus der Herstellung oder dem Vertrieb gemäß internationalen Konventionen (z.B. Chemiewaffenkonventionen) verbotener geächteter Waffen und/oder Atom- und/oder Handfeuerwaffen generierten
- Umsätze aus der unkonventionellen Förderung von Erdöl und/oder Erdgas (inklusive Fracking) generierten
- Umsätze aus der Förderung von Kohle generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus dem Abbau von Uran generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung wesentlicher Komponente für Kernkraftwerke generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung oder dem Vertrieb in den Geschäftsfeldern Rüstungsgüter generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Herstellung in den Geschäftsfeldern Tabak und/oder Alkohol generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% in den Geschäftsfeldern Glücksspiel generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% in den Geschäftsfeldern Pornografie generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 5% aus der Energiegewinnung durch Kernspaltung (Atomenergie) generierten
- ihre Umsätze zu mehr als 10% aus der Verstromung von Kohle generierten
- gegen den UN Global Compact verstießen
- eine ESG-Bewertung von schlechter als „B“ von MSCI ESG Research LLC aufwiesen.

Zudem wurden im Rahmen der ESG-Strategie Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten ausgeschlossen, die

- als „unfrei“ („not free“) nach dem Freedom-House-Index klassifiziert waren
- einen Corruption Perceptions-Index von weniger als 40 aufwiesen
- als Atommacht nach SIPRI (Stockholm International Peace Research Institute) galten
- die UN-Biodiversitäts-Konventionen nicht berücksichtigten
- eine ESG-Bewertung von schlechter als „B“ von MSCI ESG Research LLC aufwiesen

Im Rahmen der ESG-Strategie wurden Zielfonds ausgeschlossen,

- die eine ESG-Bewertung von schlechter als „BBB“ von MSCI ESG Research LLC erhielten
- die bezüglich ihrer ESG-Bewertung zu den schlechtesten 50% ihrer Vergleichsgruppe gehörten
- deren Fondsmanager oder die Kapitalverwaltungsgesellschaften, welche die Zielfonds verwalten, nicht die Principles for Responsible Investment (PRI) der Vereinten Nationen zugrunde legten.

Die Bewertung des MSCI ESG Ratings umfasst eine siebenstufige Skala mit den Kategorien AAA, AA, A, BBB, BB, B und CCC, wobei CCC die niedrigste Bewertung und AAA die höchste Bewertung darstellt.

Darüber hinaus tätigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungs-Verordnung ((EU) 2019/2088). Mit den nachhaltigen Investitionen wurde angestrebt einen Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen bis 2030 (UN Sustainable Development Goals, SDGs) zu leisten. Die SDGs umfassen 17 Zielsetzungen, die darauf ausgerichtet sind durch eine wirtschaftlich nachhaltige Entwicklung

weltweit Armut zu reduzieren und Wohlstand zu fördern. Dabei werden gleichzeitig soziale Bedürfnisse wie Bildung, Gesundheit und Beschäftigung wie auch Klimawandel und Umweltschutz berücksichtigt. Dies erfolgte durch direkte Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente oder indirekte Investitionen über Zielfonds in Unternehmen und Staaten, die mit ihren (Geschäfts-) Tätigkeiten zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs beitragen. Weitere Details zu den Zielen der nachhaltigen Investitionen sind im Abschnitt „Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“ zu finden.

Mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt tätigte, wurden keine Umweltziele gemäß Artikel 9 der EU Taxonomie (Verordnung (EU) 2020/852) verfolgt.

Inwieweit die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale des Finanzprodukts erfüllt wurden, wird anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Details zur Ausprägung der Nachhaltigkeitsindikatoren im Berichtszeitraum finden sich im folgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

1. Einhaltung der in der Anlagestrategie vereinbarten Ausschlusskriterien

Während des Berichtszeitraums investierte das Finanzprodukt nicht in gemäß der ESG-Strategie ausgeschlossene Unternehmen, Staaten und Zielfonds. Damit hielt das Finanzprodukt die im Rahmen der ESG-Strategie festgelegten Ausschlusskriterien während des Berichtszeitraums vollumfänglich und dauerhaft ein. Durch die Einhaltung der Ausschlusskriterien wurde erreicht, dass das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Unternehmen angelegt wurde, die keine verantwortungsvollen Geschäftspraktiken anwendeten und damit gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstießen und/ oder Umsätze bzw. einen gewissen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschafteten. Zudem wurde das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Staaten angelegt, die keine Verfahrensweisen verantwortungsvoller Staatsführung anwenden, indem sie beispielsweise politische Rechte und bürgerliche Freiheiten nicht achteten. Abschließend wurde das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Zielfonds angelegt, deren ESG-Bewertung nicht den Mindeststandards des Finanzprodukts entsprachen. Eine ausführliche Auflistung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen, Staaten und/ oder Zielfonds geführt haben, findet sich im vorherigen Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“ wieder.

2. Ökologische Wirkung

Der Indikator „ökologische Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 32,52 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

Der Indikator berechnet sich aus der Summe der Umsätze der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen in den Geschäftsfeldern alternative Energien, Energieeffizienz, nachhaltiges Bauen, nachhaltige Landwirtschaft, nachhaltige Wasserwirtschaft und Vermeidung von Umweltverschmutzung durch eine Minimierung der Abfallerzeugung, jeweils gewichtet mit dem Anteil der Investition am Fondsvermögen. Dabei handelt es sich um Geschäftsfelder, in denen Produkte oder Dienstleistungen angeboten werden, die zur Erreichung von Umweltzielen (basierend auf den SDGs) beitragen. Es werden sowohl direkte Investitionen in Unternehmen über Aktien und Anleihen als auch indirekte Investitionen über Zielfonds berücksichtigt. Die Gesamtsumme wird mit 1.000 Euro investiertem Kapital ins Verhältnis gesetzt. Die Berechnung des Indikators basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt den Durchschnitt der Datenlage an den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum wider.

Hinweis: Der Indikator dient lediglich zur Veranschaulichung. Die Investitionen in die Unternehmen sind nicht zweckgebunden an die Bereitstellung von Produkten bzw. Dienstleistungen,

die zur Erreichung von Umweltzielen beitragen, d.h. es besteht kein kausaler Zusammenhang zwischen einer Investition in den Fonds und den Umsätzen der investierten Unternehmen.

3. Soziale Wirkung

Der Indikator „soziale Wirkung“ betrug im Berichtszeitraum 134,40 Euro pro 1.000 Euro investiertes Kapital.

Der Indikator berechnet sich aus der Summe der Umsätze der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen in den Geschäftsfeldern nahrhafte Nahrung, erschwingliche Immobilien, Behandlung von Krankheiten, Sanitärprodukte, Konnektivität, Finanzierung von kleineren und mittleren Unternehmen und hochwertige Bildung, jeweils gewichtet mit dem Anteil der Investition am Fondsvermögen. Dabei handelt es sich um Geschäftsfelder, in denen Produkte oder Dienstleistungen angeboten werden, die zur Erreichung von sozialen Zielen (basierend auf den SDGs) beitragen. Es werden sowohl direkte Investitionen in Unternehmen über Aktien und Anleihen als auch indirekte Investitionen über Zielfonds berücksichtigt. Die Gesamtsumme wird mit 1.000 Euro investiertem Kapital ins Verhältnis gesetzt. Die Berechnung des Indikators basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt den Durchschnitt der Datenlage an den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum wider.

Hinweis: Der Indikator dient lediglich zur Veranschaulichung. Die Investitionen in die Unternehmen sind nicht zweckgebunden an die Bereitstellung von Produkten bzw. Dienstleistungen, die zur Erreichung von Umweltzielen beitragen, d.h. es besteht kein kausaler Zusammenhang zwischen einer Investition in den Fonds und den Umsätzen der investierten Unternehmen.

4. Durchschnittlicher MSCI Government ESG Score

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten oder staatsnahe Emittenten. Daher ist der Indikator „Government ESG Score“ für den Berichtszeitraum nicht relevant.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen verfolgten das Ziel, einen Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der 17 SDGs zu leisten.

Dazu wurde im Berichtsjahr teilweise direkt und indirekt in Unternehmen investiert, die Produkte oder Dienstleistungen anbieten, die zur Erreichung eines oder mehrerer SDGs beitragen. Dazu wurden bestimmte Geschäftsfelder mit Beitrag zu den SDGs identifiziert. Dies umfasst die Geschäftsfelder alternative Energien, Energieeffizienz, nachhaltiges Bauen, nachhaltige Landwirtschaft, nachhaltige Wasserwirtschaft, Vermeidung von Umweltverschmutzung durch eine Minimierung der Abfallerzeugung, nahrhafte Nahrung, erschwingliche Immobilien, Behandlung von Krankheiten, Sanitärprodukte, Konnektivität, Finanzierung von kleineren und mittleren Unternehmen und hochwertige Bildung. Der positive Beitrag der Unternehmen zu den nachhaltigen Investitionszielen wurde an den Umsätzen gemessen, die die Unternehmen in diesen Geschäftsfeldern erwirtschafteten. Dabei wurde jeweils nur der Umsatzanteil der Unternehmen als nachhaltige Investition gewertet, der in den zuvor genannten Geschäftsfeldern mit Beitrag zu den SDGs erfolgte. Die Daten zur Messung des Beitrags zu den nachhaltigen Investitionszielen basieren auf internem Research sowie dem externen Researchanbieter MSCI ESG Research LLC.

Sofern darüber hinaus in Staaten investiert wurde, wurden die Staaten ausgewählt, die im Vergleich zum Rest der Welt fortschrittlicher bei der Erreichung der SDGs sind. Der positive Beitrag von Staaten wird anhand deren Nachhaltigkeitsbewertung im Vergleich zum Rest

der Welt gemessen. Dazu wurde eine Kennzahl herangezogen, die den Fortschritt von Staaten bei der Erreichung der SDGs misst. Zur Berechnung der Kennzahl werden jedem SDG quantitative Indikatoren mit einem Optimalwert zugrunde gelegt, an dem die Leistung der Staaten gemessen wird. Die Kennzahl wird vom UN Sustainable Development Solutions Network (SDSN) in Zusammenarbeit mit der Cambridge University Press und der Bertelsmann Stiftung bereitgestellt und basiert unter anderem auf Daten öffentlicher Institutionen wie der Weltgesundheitsorganisation oder der Weltbank. Die Messung des Beitrags der nachhaltigen Investitionen in Staaten erfolgte auf Basis der Nachhaltigkeitsbewertung unter Anwendung eines Best-In-Class-Ansatz. Hierbei wurde nur der Anteil der Nachhaltigkeitsbewertung, der in der oberen Hälfte liegt zum Anteil nachhaltiger Investitionen angerechnet. Staaten, deren Nachhaltigkeitsbewertung in der unteren Hälfte liegt, wurden nicht als nachhaltig bewertet.

Zudem konnten nachhaltige Investitionen in der Form von Staats- oder Unternehmensanleihen getätigt werden, deren Mittelverwendung an die Finanzierung von ökologischen und/oder sozialen Projekten z.B. aus den Bereichen Erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Gesundheitswesen, Bildung oder Sanitäreinrichtungen gebunden ist (sogenannte Green Bonds, Social Bonds oder Sustainability Bonds) und die damit zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs beitragen.

Mit den nachhaltigen Investitionen, die dieses Finanzprodukt tätigte, wurden keine Umweltziele gemäß Artikel 9 der EU Taxonomie (Verordnung (EU) 2020/852) verfolgt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Damit die nachhaltigen Investitionen den ökologischen oder sozialen Anlagezielen trotz eines positiven Beitrags nicht gleichzeitig erheblich schaden, wurden die nachteiligen Auswirkungen der Unternehmen und Staaten, in die der Fonds investierte, auf Nachhaltigkeitsfaktoren aus den Bereichen Umwelt und Soziales berücksichtigt. Hierzu wurden die von der EU entwickelten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (nachfolgend auch Principal Adverse Impacts oder PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1) herangezogen. Diese PAI-Indikatoren sollen dazu dienen, die negativen Effekte zu messen, die Unternehmen und Staaten auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung haben.

Die Auswahl der Emittenten erfolgte unter Berücksichtigung von definierten Schwellenwerten für die einbezogenen PAI-Indikatoren. Dadurch wurden negative Effekte in Bezug auf die nachhaltigen Anlageziele begrenzt. Eine Auflistung der PAI-Indikatoren findet sich im darauffolgenden Abschnitt „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Darüber hinaus berücksichtigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum grundsätzlich bei allen Anlageentscheidungen in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Zielfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Informationen hierzu finden sich im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei den nachhaltigen Investitionen wurden für ausgewählte Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) Schwellenwerte festgelegt. Investitionen des Finanzprodukts wurden nur als nachhaltig bewertet, wenn die nachteiligen

Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren der Unternehmen, Staaten und/ oder Zielfonds bei diesen Indikatoren definierte Schwellenwerte nicht überschritten.

Folgende PAI-Indikatoren werden bei den nachhaltigen Investitionen in Unternehmen berücksichtigt:

- Treibhausgasemissionsintensität (PAI 3 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (PAI 5 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anzahl der Fälle von schwerwiegenden Menschenrechtsverletzungen und sonstigen Vorfällen (PAI 14, aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 3)

Folgende PAI-Indikatoren werden bei den nachhaltigen Investitionen in Staaten berücksichtigt:

- Treibhausgasemissionsintensität (PAI 15 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI 16 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

Folgende PAI-Indikatoren werden bei den nachhaltigen Investitionen in Zielfonds berücksichtigt:

- CO₂-Fußabdruck der Unternehmen (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Treibhausgasemissionsintensität der Staaten (PAI 15 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts in Unternehmen, hielten die Unternehmen einen definierten Schwellenwert bei der CO₂-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und Energieverbrauchsintensität ein und waren nicht an der Herstellung oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen beteiligt. Zudem wurden keinem der Unternehmen bei den nachhaltigen Investitionen Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren und/ oder UN Global Compact Verstöße vorgeworfen.

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts in Staaten, hielten die Staaten einen definierten Schwellenwert bei der CO₂-Intensität ein. Zudem verstießen die Staaten bei den nachhaltigen Investitionen nicht gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen und waren deshalb von der EU sanktioniert.

Bei allen nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, überstieg der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck der Unternehmen bzw. die CO₂-Intensität der Staaten im Zielfonds einen festgelegten Schwellenwert nicht. Zudem überstieg der Anteil des Sondervermögens im Zielfonds, das in Unternehmen investiert wurde, die gegen den UN Global Compact verstießen, einen definierten Schwellenwert nicht. Die nachhaltigen Investitionen in Zielfonds, enthielten zudem keine Unternehmen, die an der Herstellung oder dem Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren.

Die Bewertung erfolgte hauptsächlich auf Basis von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Lagen bei einem Unternehmen, Staat oder Zielfonds keine Daten

für mindestens einen der oben genannten PAI-Indikatoren vor, wurde die Investition nicht als nachhaltig eingestuft.

Verschlechterte sich die Bewertung für einen Emittenten oder Zielfonds im Laufe des Berichtszeitraums, sodass die definierten Schwellenwerte bzw. Ausprägungen bei mindestens einem der oben genannten Indikatoren nicht mehr eingehalten wurden, wurde die Investition nicht mehr als nachhaltig eingestuft und nicht mehr dem Anteil nachhaltiger Investitionen angerechnet.

Weitere PAI-Indikatoren wurden bei der allgemeinen PAI-Berücksichtigung bei allen Anlageentscheidungen des Finanzprodukts in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Zielfonds berücksichtigt. Informationen hierzu finden sich im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte definieren Leitlinien für die Anwendung guter Unternehmensführung in Bezug auf die Bekämpfung von Bestechung und Korruption, den Umgang mit Beschäftigten, Umweltschutz sowie die Achtung der Menschenrechte.

Die nachhaltigen Investitionen in Unternehmen standen insofern im Einklang mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, als dass mit den nachhaltigen Investitionen nicht in Wertpapiere von Unternehmen investiert wurde, denen Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren oder schwere UN Global Compact Verstöße vorgeworfen wurden. Investitionen in Zielfonds wurden nur als nachhaltige Investitionen bewertet, wenn höchstens 3% des Zielfonds in Unternehmen mit Verstößen gegen den UN Global Compact investiert wurden.

Der UN Global Compact umfasst 10 Prinzipien, die den Bereichen Menschenrechte, Arbeitnehmerrechte, Umwelt und Korruption zuzuordnen sind. Ist ein Unternehmen in eine oder mehrere ESG-Kontroversen verwickelt, bei denen glaubhafte Anschuldigungen bestehen, dass das Unternehmen oder dessen Geschäftsführung gegen diese Prinzipien verstoßen hat, so wird dies als „schwerer Verstoß“ gegen globale Normen wie die ILO („International Labour Organization“) Kernarbeitsnormen oder die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte gewertet. Dazu gehören z.B. Unternehmen, die Kinder- bzw. Zwangsarbeit anwenden.

Die Bewertung erfolgte hauptsächlich auf Basis von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Lagen bei einem Unternehmen, Staat oder Zielfonds keine Daten zur Überprüfung der Einhaltung der Prinzipien des UN Global Compact vor, wurde die Investition nicht als nachhaltig eingestuft.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Finanzprodukt berücksichtigte im Berichtszeitraum bei Anlageentscheidungen in Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Zielfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts oder PAI). PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-)Tätigkeiten von Unternehmen und Staaten in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Im Rahmen der PAI-Berücksichtigung wurden im Berichtsjahr systematische Verfahrensweisen zur Messung und Bewertung, sowie Maßnahmen zum Umgang mit den PAI im Investitionsprozess angewendet.

Die Messung und Bewertung der PAI der Unternehmen, Staaten und Zielfonds im Anlageuniversum erfolgte unter Verwendung von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Die PAI-Informationen für Unternehmen und Staaten wurden dem Portfoliomanagement des Finanzprodukts zur Berücksichtigung im Investitionsprozess zur Verfügung gestellt.

Durch die Anwendung verbindlicher, nachhaltigkeitsbezogener Ausschlusskriterien im Rahmen der ESG-Strategie wurde das Anlageuniversum des Fonds im Berichtsjahr eingeschränkt und die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen, die mit den Investitionen des Finanzprodukts im Berichtszeitraum verbunden waren, grundsätzlich begrenzt. Es wurde nicht in Unternehmen investiert, die Verfahrensweisen guter Unternehmensführung nicht achteten indem sie gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstießen und/ oder Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern wie der Herstellung von geächteten Waffen erwirtschafteten bzw. bei ihren Umsätzen bestimmte Schwellenwerte in kontroversen Geschäftsfeldern wie der Rüstungsgüterindustrie überschritten. Zudem wurde nicht in Zielfonds investiert, die eine Mindest-ESG-Bewertung nicht einhielten. Eine ausführliche Beschreibung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen, Staaten und Zielfonds geführt haben, findet sich im Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“. Die Einhaltung der Ausschlusskriterien wurde durch interne Kontrollsysteme dauerhaft geprüft.

Zudem wurden Unternehmen, die in umweltbezogene und/oder soziale Kontroversen verwickelt waren, anlassbezogen identifiziert und auch aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Um darüber hinaus spezifische, als besonders relevant erachtete PAI gezielt zu begrenzen, wurden je nach Höhe bzw. Ausprägung der PAI weitere Emittenten und Zielfonds aus dem Anlageuniversum

ausgeschlossen. Hierfür hat die Gesellschaft für eine Auswahl an PAI-Indikatoren Schwellenwerte definiert.

Für Unternehmen waren seit dem 01.06.2022 für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

- Treibhausgasemissionsintensität (PAI 3 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (PAI 5 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anzahl der Fälle von schwerwiegenden Menschenrechtsverletzungen und sonstigen Vorfällen (PAI 14, aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 3)

Für Staaten waren seit dem 01.06.2022 für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

- Treibhausgasemissionsintensität der Länder (PAI 15, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI 16, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen und Staaten, die die festgelegten Schwellenwerte überschritten bzw. Ausprägungen nicht einhielten, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger bis 31.08.2022 veräußert.

Seit dem 01.09.2022 wurde dann nicht mehr in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen investiert, deren CO₂-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und/ oder Energieverbrauchsintensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt. Zudem wurde seit dem 01.09.2022 nicht in Unternehmen investiert, die gegen den UN Global Compact verstießen, denen in den letzten drei Jahren Menschenrechtsverletzungen vorgeworfen wurden und/oder die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt waren. Darüber hinaus wurde seit dem 01.09.2022 nicht in Staaten investiert, deren CO₂-Intensität einen festgelegten Schwellenwert überschritt und/ oder die gegen soziale Bestimmungen und internationale Normen verstießen und deshalb von der EU sanktioniert waren.

Verschlechterte sich die Bewertung für ein Unternehmen oder Staat seit Einführung der jeweiligen Schwellenwerte, sodass der Schwellenwert bzw. die Ausprägung für einen oder mehrerer der zuvor genannten PAI-Indikatoren nicht mehr eingehalten wurde, wurden die Portfoliomanager auf die Änderung aufmerksam gemacht und es galten interne Verkaufsfristen für die Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der betroffenen Unternehmen und Staaten.

Für weitere PAI-Indikatoren erfolgte die Bewertung der Unternehmen und Staaten im Anlageuniversum seit dem 01.09.2022 auf kontinuierlicher Basis durch Nachhaltigkeitsanalysten. Auf Basis dieser Bewertung wurden gegebenenfalls weitere Unternehmen und Staaten aus dem Anlageuniversum des Finanzprodukts ausgeschlossen. Folgende PAI-Indikatoren für Unternehmen wurden im Rahmen dieser Maßnahme betrachtet:

- Treibhausgasemissionen (PAI 1, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- CO₂-Fußabdruck (PAI 2, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (PAI 4, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (PAI 5, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Emissionen in Wasser (PAI 8, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (PAI 9, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-

Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (PAI 12, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)
- Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress (PAI 8, Tabelle 2, (EU) 2022/1288)

Für Zielfonds waren seit dem 01.12.2022 für folgende PAI-Indikatoren Schwellenwerte festgelegt:

- CO₂-Fußabdruck (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Treibhausgasemissionsintensität der Länder (PAI 15, Tabelle 1, (EU) 2022/1288)

Zielfonds, bei denen die festgelegten Schwellenwerte überstritten wurden, vorausgesetzt einer ausreichenden Datenverfügbarkeit bei den PAI-Indikatoren, konnten seit dem 01.12.2022 nicht mehr für das Sondervermögen erworben werden. Bereits vor dem 01.12.2022 gehaltene Zielfonds, bei denen die festgelegten Schwellenwerte überschritten wurden, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger bis zum Berichtsstichtag 31.12.2022 veräußert.

Darüber hinaus wurde im Rahmen der Mitwirkungspolitik der Verwaltungsgesellschaft Maßnahmen ergriffen, um auf eine Reduzierung der PAI der Unternehmen im Anlageuniversum hinzuwirken. Dazu nutzte die Verwaltungsgesellschaft zum einen ihr Stimmrecht auf Hauptversammlungen. Zum anderen trat die Verwaltungsgesellschaft mit Unternehmen, die bestimmte Schwellenwerte bei PAI-Indikatoren oder anderen ESG-Kennzahlen überschritten und/ oder in ESG-Kontroversen verwickelt waren, in Dialog. In den Gesprächen wurden die Unternehmen auf Missstände aufmerksam gemacht und auf Lösungswege hingewiesen. Die Schwerpunkte sowie die Ergebnisse der Engagementaktivitäten sind im Engagement-Bericht der Verwaltungsgesellschaft des Fonds zu finden. Der aktuelle Engagement-Bericht sowie die Abstimmungsergebnisse auf Hauptversammlungen sind unter folgendem Link abrufbar: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.01.2022 - 31.12.2022

In der Tabelle werden die fünfzehn Investitionen aufgeführt, auf die im Berichtszeitraum der größte Anteil aller getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel, mit Angabe der Sektoren und Länder, in die investiert wurde.

Die Angaben zu den Hauptinvestitionen beziehen sich auf den Durchschnitt der Anteile am Sondervermögen zu den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Abweichungen zu der Vermögensaufstellung im Hauptteil des Jahresberichts, die stichtagsbezogen zum Ende des Berichtszeitraums erfolgt, sind daher möglich.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Microsoft Corp. Reg.Shares (US5949181045)	Software & Dienste	1,56%	Vereinigte Staaten
Sanofi S.A. Actions Port. (FR0000120578)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,26%	Frankreich
Verizon Communications Inc. Reg.Shares (US92343V1044)	Telekommunikationsdienste	1,17%	Vereinigte Staaten
Flowers Foods Inc. Reg.Shares (US3434981011)	Lebensmittel, Getränke & Tabak	1,16%	Vereinigte Staaten
General Mills Inc. Reg.Shares (US3703341046)	Lebensmittel, Getränke & Tabak	1,15%	Vereinigte Staaten
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder (NL0011794037)	Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	1,14%	Niederlande
Swisscom AG Namens-Aktien (CH0008742519)	Telekommunikationsdienste	1,12%	Schweiz
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine (CH0012032048)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,04%	Schweiz
Elisa Oyj Reg.Shares Cl.A (FI0009007884)	Telekommunikationsdienste	1,00%	Finnland
Electronic Arts Inc. Reg.Shares (US2855121099)	Medien & Unterhaltung	1,00%	Vereinigte Staaten
Metro Inc. Reg.Shares (CA59162N1096)	Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	0,98%	Kanada
The Hershey Co. Reg.Shares (US4278661081)	Lebensmittel, Getränke & Tabak	0,98%	Vereinigte Staaten
Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares (US50540R4092)	Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	0,97%	Vereinigte Staaten
Hologic Inc. Reg.Shares (US4364401012)	Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	0,95%	Vereinigte Staaten
George Weston Ltd. Reg.Shares (CA9611485090)	Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	0,94%	Kanada



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale beitrugen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale) betrug im Berichtszeitraum 97%. Darunter fallen alle Investitionen, die die im Rahmen der verbindlichen Elemente der ESG-Anlagestrategie definierten Ausschlusskriterien des Fonds einhielten.

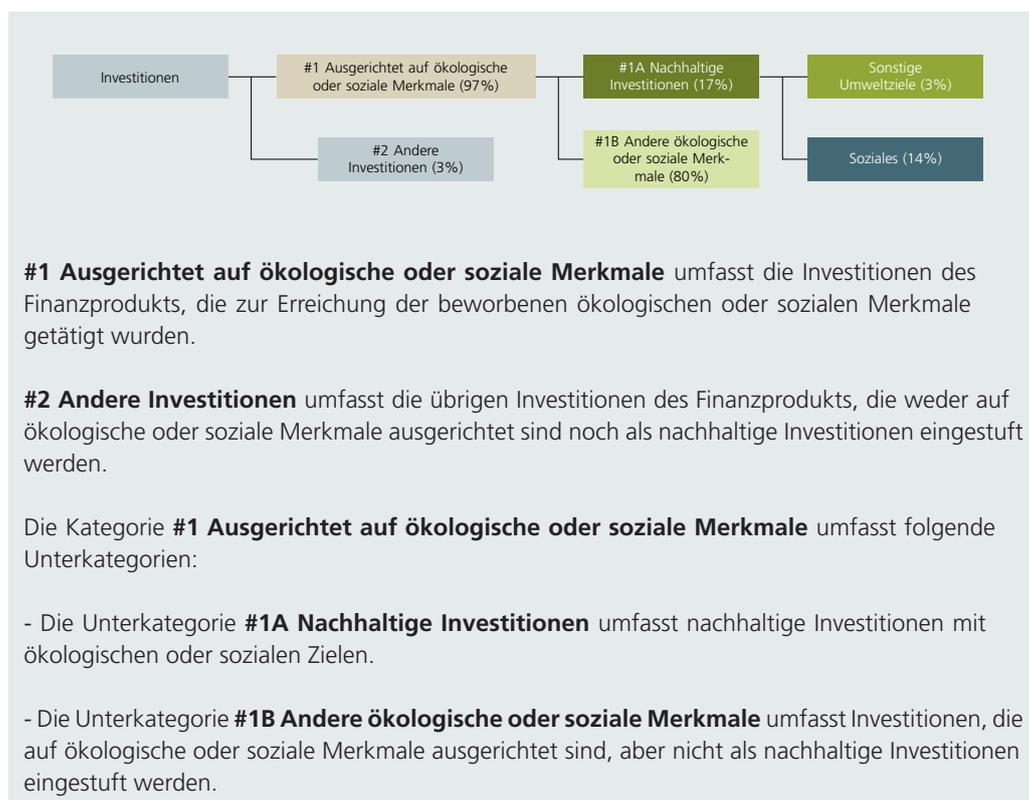
Nachhaltige Investitionen (#2 nachhaltige Investitionen) im Sinne des Artikel 2 Nr.17 der Offenlegungsverordnung ((EU) 2019/2088) sind alle Investitionen des Finanzprodukts in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beitragen, vorausgesetzt, dass diese Investitionen keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Der Anteil nachhaltiger Investitionen betrug im Berichtszeitraum 17%. Dabei wurden sowohl nachhaltige Investitionen mit Umweltziel als auch nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel getätigt.

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen wurde bei Unternehmen auf Basis deren Umsatzes, der zu den SDGs beiträgt, angerechnet. Bei Staaten fand eine Anrechnung zum Anteil der nachhaltigen Investitionen auf Basis deren Nachhaltigkeitsbewertung, die den Fortschritt bei der Erreichung der SDGs misst, (zwischen 0 und 100%) statt. Bei Wertpapieren, deren Mittelverwendung an die Finanzierung von nachhaltigen Wirtschaftsaktivitäten gebunden war

(z.B. Green Bonds, Social Bonds oder Sustainability Bonds), wurde die komplette Investition in das Wertpapier als nachhaltig angerechnet.

Eine Beschreibung der Investitionen, die nicht auf die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds ausgerichtet waren, findet sich im Abschnitt „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“.

Die Angaben in der Grafik stellen den Durchschnitt der Vermögensallokation aus den letzten drei Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums dar und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Geringfügige Abweichungen in der prozentualen Gewichtung der Investitionen resultieren aus rundungsbedingten Differenzen. Aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit, konnte der erste Quartalsstichtag des Berichtszeitraums bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden.



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In welchen Wirtschaftssektoren und Teilsektoren das Finanzprodukt während des Berichtszeitraums investierte, ist in der nachfolgenden Tabelle dargestellt.

Die Zuteilung der Investitionen zu den Sektoren und Teilsektoren erfolgte auf Basis von Daten von externen Researchanbietern sowie internem Research. Unter „Sonstige“ fielen Bankguthaben, Derivate, Forderungen und Emittenten, für die keine Branchenzuteilung vorlag.

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 2,22% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilsektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC zurückgegriffen. Der Anteil beinhaltet Unternehmen, die Umsätze im Bereich der fossilen

Brennstoffe, einschließlich der Förderung, Verarbeitung, Lagerung und dem Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie thermischer und metallurgischer Kohle erwirtschaften.

Die Berechnung der Anteile basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen.

Sektor	Anteil
Basiskonsumgüter	17,41%
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	3,26%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	8,74%
Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	5,41%
Finanzwesen	11,94%
Banken	4,46%
Diversifizierte Finanzdienste	1,00%
Versicherungen	6,48%
Gesundheitswesen	21,60%
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	9,38%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	12,22%
Immobilien	2,46%
Immobilien	2,46%
Industrie	13,04%
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	3,57%
Investitionsgüter	6,89%
Transportwesen	2,58%
Informationstechnologie	9,14%
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	0,90%
Hardware & Ausrüstung	1,37%
Software & Dienste	6,87%
Kommunikationsdienste	14,92%
Medien & Unterhaltung	3,18%
Telekommunikationsdienste	11,74%
Nicht-Basiskonsumgüter	2,68%
Automobile & Komponenten	0,08%
Dienstleistungsunternehmen	0,44%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	0,71%
Groß- und Einzelhandel	1,45%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0,21%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0,21%
Sonstige	3,94%
Sonstige	3,94%
Versorgungsbetriebe	2,65%
Versorgungsbetriebe	2,65%

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht nachweisbar in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu keinem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug demnach 0% (gemessen an den drei Leistungsindikatoren OpEx, CapEx und Umsatz).

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht in Staatsanleihen. Der Anteil taxonomiekonformer Investitionen beträgt demnach mit und ohne Staatsanleihen 0%.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Nein, es erfolgten keine nachweisbaren taxonomiekonformen Investitionen im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie.

In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Art der Wirtschaftstätigkeit	Anteil
Ermöglichende Tätigkeiten	0,00%
Übergangstätigkeiten	0,00%

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Es war nicht Teil der Anlagestrategie des Finanzprodukts in Wirtschaftsaktivitäten zu investieren, die taxonomiekonform sind. Vielmehr wurde mit den nachhaltigen Investitionen ein allgemeiner Beitrag zur Erreichung eines oder mehrerer der SDGs angestrebt. Demnach investierte das Finanzprodukt in Wirtschaftsaktivitäten mit Umweltzielen, die nicht taxonomiekonform sind.

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel betrug 3,45%.

Die Berechnung des Anteils basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den letzten drei Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit, konnte der erste Quartalsstichtag des Berichtszeitraums bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 13,80%.

Die Berechnung des Anteils basiert auf dem Durchschnitt der Datenlage zu den letzten drei Quartalsstichtagen im Berichtszeitraum und bezieht sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit, konnte der erste Quartalsstichtag des Berichtszeitraums bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Unter „Andere Investitionen“ fielen alle Investitionen, die nicht nach den verbindlichen Elementen der ESG-Anlagestrategie ausgewählt wurden und damit nicht ausgerichtet auf die ökologischen und sozialen Merkmale des Finanzprodukts waren. Im Berichtszeitraum gehörten hierzu Investitionen in

- Derivate und andere derivative Instrumente wie zum Beispiel Optionen, Futures und Swaps. Die Investitionen dienten zur Risikoabsicherung z.B. gegen Kursschwankungen oder zu Investitionszwecken, aber nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale.
- Bankguthaben sowie flüssige Mittel (z.B. Sichteinlagen oder Festgelder). Diese wurden aus Liquiditätszwecken gehalten.

Bei diesen Investitionen wurde ein ökologischer und sozialer Mindestschutz angewendet, in der Form, dass auch mit diesen Investitionen nicht in Hersteller geächteter und kontroverser Waffen investiert wurde. Zudem wurde im Rahmen dieser Investitionen nicht in Produkte investiert, die die Preisentwicklung von Grundnahrungsmitteln abbilden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Überwachung der Konformität der Investitionsentscheidungen mit den ökologischen und sozialen Merkmalen erfolgte im Rahmen von standardisierten Prozessen. Es wurden nur Investitionsentscheidungen getroffen und entsprechende Kauf- oder Verkaufstransaktionen durchgeführt, welche im Rahmen der Vorabprüfung den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie entsprachen. Eine Transaktion konnte nicht ausgeführt werden, wenn sie gegen die im Rahmen der Anlagestrategie festgelegten Ausschlusskriterien verstieß. Lagen für einen Emittenten keine Daten oder ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen vor und waren betriebseigene Recherchen nicht möglich, wurde in die Wertpapiere dieser Unternehmen oder Staaten nicht investiert.

Bei der Identifikation von schweren Kontroversen (z.B. schwere Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact) galten interne Fristen für den Verkauf der betroffenen Titel. Das Portfoliomanagement erhielt zudem regelmäßig für die Investitionsentscheidung relevante Informationen bezüglich Veränderungen im investierbaren Anlageuniversum.

Um den Investitionsentscheidungsprozess zu unterstützen, wurde die hauseigene Research-Plattform um Informationen und Daten zu Nachhaltigkeitsaspekten erweitert. Zudem wurden den Entscheidungsträgern über die Handelssysteme relevante Datenpunkte für Investitionsentscheidungen zur Verfügung gestellt. Die Plattform kombiniert externe Daten und ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen mit internen Recherchen sowie Analysen und wird um relevante Erkenntnisse aus Gesprächen mit Unternehmensvertretern ergänzt. Das Portfoliomanagement wurde im Rahmen regelmäßiger Schulungen über Neuerungen und Wissenswertes durch das ESG-Team der Verwaltungsgesellschaft informiert.

Im Rahmen der Mitwirkungspolitik, nahm die Verwaltungsgesellschaft zudem ihre Rolle als aktiver Investor wahr. Bei Unternehmen mit kritischen Geschäftsaktivitäten versuchte sie ihren Einfluss als aktiver Aktionär zu nutzen, um diese Unternehmen zu einem nachhaltigeren und verantwortlicheren Wirtschaften zu bewegen. Hierzu trat die Gesellschaft in den aktiven und zielgerichteten Dialog mit ausgewählten Unternehmen zu Themen wie Umweltschutz und Klimawandel. Wurden ESG-Kontroversen bei Unternehmen identifiziert, wurden diese darauf angesprochen und zur Aufklärung bzw. Beseitigung des Missstandes aufgefordert. Die angesprochenen Themen wurden dokumentiert und die Entwicklung nachverfolgt. Zudem übte die Gesellschaft ihre Aktionärsrechte auf Hauptversammlungen aus und stimmte regelmäßig auf Hauptversammlungen ab. Details zu den Abstimmungsergebnissen und zu den Schwerpunkten sowie den Ergebnissen der Mitwirkungspolitik sind unter folgendem Link abrufbar: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.

Luxemburg, den 25. April 2023
Deka International S.A.
Der Vorstand

BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE.

An die Anteilhaber des
Deka Portfolio

BERICHT DES „REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE“

Bericht über die Jahresabschlussprüfung

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Deka Portfolio und seiner jeweiligen Teilfonds („der Fonds“), bestehend aus der Vermögensaufstellung, der Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Vermögenswerte zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie dem Anhang, mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden, geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Deka Portfolio und seiner jeweiligen Teilfonds zum 31. Dezember 2022 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit („Gesetz vom 23. Juli 2016“) und nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) angenommenen internationalen Prüfungsstandards („ISA“) durch. Unsere Verantwortung gemäss dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt „Verantwortung des „réviseur d'entreprises agréé“ für die Jahresabschlussprüfung“ weitergehend beschrieben. Wir sind auch unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ („IESBA Code“), zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben, und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Hervorhebung eines Sachverhalts

Wir verweisen auf die Angaben im Anhang zu diesem Jahresabschluss, in dem darauf hingewiesen wird, dass mit dem Beschluss des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft vom 08. März 2022 der Teilfonds Deka Portfolio Renten zum 30. Juni 2022 liquidiert wurde. Der Jahresabschluss für den Teilfonds Deka Portfolio Renten wurde daher nicht unter der Annahme der Unternehmensfortführung aufgestellt. Unser Prüfungsurteil ist hinsichtlich dieses Sachverhaltes nicht modifiziert.

Sonstige Informationen

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft und der für die Überwachung Verantwortlichen für den Jahresabschluss

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Vorstand als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen, beabsichtigten oder unbeabsichtigten, falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds und seiner jeweiligen Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und, sofern einschlägig, Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren oder einzelne seiner Teilfonds zu schließen, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Die für die Überwachung Verantwortlichen sind verantwortlich für die Überwachung des Jahresabschlussstellungsprozesses.

Verantwortung des „réviseur d’entreprises agréé“ für die Jahresabschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen, beabsichtigten oder unbeabsichtigten, falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des „réviseur d’entreprises agréé“, welcher unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für das Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und der entsprechenden Anhangangaben.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Vorstand der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder einzelner seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des „réviseur d’entreprises agréé“ auf die dazugehörigen Anhangangaben zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des „réviseur d’entreprises agréé“ erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einzelne seiner Teilfonds die Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen können.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschliesslich der Anhangangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschliesslich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Luxemburg, 27. April 2023

KPMG Audit S.à r.l.

Cabinet de révision agréé
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

Monika Wirtz-Bach

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka International S.A.
6, rue Lou Hemmer
1748 Luxembourg-Findel,
Luxemburg

Eigenmittel zum 31. Dezember 2021

gezeichnet und eingezahlt	EUR 10,4 Mio.
haftend	EUR 77,5 Mio.

Vorstand

Holger Hildebrandt
Direktor der Deka International S.A., Luxemburg

Eugen Lehnertz
Direktor der Deka International S.A., Luxemburg

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Thomas Schneider
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,
Frankfurt am Main
und der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Stellvertretender Vorsitzender

Holger Knüppe
Leiter Beteiligungen der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main

Unabhängiges Mitglied

Marie-Anne van den Berg, Luxemburg

Verwahr- und Zahlstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main, Niederlassung Luxemburg
6, rue Lou Hemmer
1748 Luxembourg-Findel,
Luxemburg

Cabinet de révision agréé für den Fonds und die Verwaltungsgesellschaft

KPMG Audit S.à r.l.
39, avenue John F. Kennedy
1855 Luxembourg,
Luxemburg

Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Stand: 31. Dezember 2022

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



Deka International S.A.

6, rue Lou Hemmer
1748 Luxembourg-Findel,
Postfach 5 45
2015 Luxembourg
Luxemburg

Telefon: (+3 52) 34 09 - 27 39
Telefax: (+3 52) 34 09 - 22 90
www.deka.lu