

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2023.

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023.

Nach mehr als fünfzehn Monaten seit dem russischen Einmarsch in die Ukraine ist an den Finanzplätzen eine Form von Gewöhnung an den Konflikt zu konstatieren, wenngleich die Auswirkungen auf die verschiedenen Volkswirtschaften weiterhin präsent bleiben. Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor nahmen angesichts eines milden Winters spürbar ab. Die Teuerungsraten entfernten sich im Verlauf von ihren Höchstständen. Zudem führte die abrupte Abkehr von der rigiden Null-Covid-Politik und entsprechender Lockdown-Maßnahmen in China zu einer Wiederbelebung des globalen Handels.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtshalbjahr unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,00 Prozent bis 5,25 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,00 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 3,8 Prozent.


Das Gros der globalen Aktienbörsen startete mit Rückenwind in das Jahr 2023 und trotz erhöhter Anleiherenditen sowie zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren aus dem Bankensektor bestimmte eine Aufwärtsbewegung das Bild an den Aktienmärkten. Der Euro tendierte im Verhältnis zum US-Dollar seit dem Jahreswechsel in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende Juni bei 1,09 US-Dollar.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung



Dirk Degenhardt (Vorsitzender)



Dirk Heuser



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023	7
Anhang	14
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

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

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

## Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist es, langfristigen Kapitalzuwachs durch eine positive Wertentwicklung der im Fonds enthaltenen Vermögenswerte zu erwirtschaften.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds weltweit mindestens 51% in Aktien an. Die Gesellschaft kann für das Sondervermögen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, Bankguthaben, Investmentanteile sowie sonstige Anlageinstrumente erwerben. Die Anlagepolitik ist darauf ausgelegt, computergestützt überwiegend in solchen Aktien zu investieren, die im Vergleich zur Gesamtheit der analysierten Aktien nach der Erkenntnis der Gesellschaft unterbewertet sind.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Auswahlprozess wird mit Hilfe eines speziellen Computerprogramms ausgeführt, das im Hause der Lingohr & Partner Asset Management GmbH entwickelt wurde. Für jedes der Länder bzw. für jede Anlageregion, in die investiert werden soll, wurden umfangreiche Untersuchungen durchgeführt, welche Anlagemethodik langfristig die besten Anlageresultate erzielte. Aus einem Anlageuniversum von über 30.000 Unternehmen werden so, unterstützt durch das Computermodell "CHICCO", Aktien nach bis zu 20 verschiedenen Auswahlkriterien selektiert. Innerhalb des Gesamtportfolios des Fonds erfolgt eine Gleichgewichtung der Länder-/Regionenmodule, sowie aller Einzeltitel – aber in jedem Land/jeder Region nach einem anderen, intensiv getesteten spezifischen Auswahlmodell. Kern des Investmentprozesses ist die Identifikation und Auswahl unterbewerteter Aktien, wobei in erster Linie Cash-Flows im Fokus liegen und ferner zusätzliche relevante Kennziffern, wie z.B. KGV, Dividendenrendite, Momentum oder Verschuldungsgrad, herangezogen werden. Durch Gleichgewichtung von Einzeltiteln werden Chancen und Risiken systematisch diversifiziert. Aktien und die Portfoliostruktur werden hierbei regelmäßig überprüft und gegebenenfalls angepasst. Darüber hinaus sind Investitionen in Titel, die nicht Bestandteil potentieller Vergleichsmaßstäbe sind im Rahmen der Bewertung der Untergewichtung, neben weiteren Auswahlkriterien der Einzelselektion, jederzeit möglich. Zur Messung des Wertpapierauswahlprozesses steht kein geeigneter Index zur Verfügung. Grund hierfür ist einerseits eine von repräsentativen Aktienindizes vernachlässigte Berücksichtigung von wertorientierten relevanten Kennzahlen von Unternehmen, die den Kern des Investmentansatzes hinsichtlich der finalen Titelselektion bedingen. Andererseits weisen verfügbare Indizes unterbewertete Einzeltitel nicht aus, die auf Grund von Markteinflüssen derzeit niedriger bewertet werden. Daher wird, aufgrund der fehlenden Vergleichbarkeit in der Zusammensetzung von Index und Fondsallokation, auf die Nutzung eines Referenzwertes oder eines gegebenenfalls zusammengesetzten Referenzwertes verzichtet.

### Wichtige Kennzahlen

#### LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

Performance*	6 Monate
	5,5%
ISIN	DE0009774794
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.	

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

Der Fonds wird von Lingohr & Partner Asset Management GmbH beraten.

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>536.584.893,16</b>	<b>94,18</b>
Australien	21.583.080,02	3,79
Belgien	6.171.282,76	1,08
Bermuda	12.692.974,05	2,23
Brasilien	12.893.550,12	2,25
China	8.050.202,20	1,41
Dänemark	16.809.271,53	2,95
Deutschland	28.835.937,20	5,05
Finnland	10.991.137,07	1,94
Frankreich	32.593.409,33	5,73
Großbritannien	51.016.831,26	8,96
Hongkong	6.232.446,99	1,09
Irland	899.915,26	0,16
Italien	11.143.792,96	1,96
Japan	49.284.470,91	8,66
Kaiman-Inseln	26.850.875,48	4,71
Kanada	47.383.527,70	8,32
Korea, Republik	12.598.002,03	2,21
Luxemburg	4.737.234,12	0,83
Mexiko	2.678.219,94	0,47
Niederlande	14.786.191,11	2,59
Norwegen	15.365.411,53	2,71
Österreich	9.660.731,22	1,69
Polen	1.226.305,18	0,22
Portugal	4.892.554,69	0,86
Schweden	6.024.878,39	1,06
Schweiz	13.938.079,81	2,44
Singapur	12.955.844,31	2,27
Spanien	15.761.037,18	2,77
Südafrika	4.687.909,59	0,81
Taiwan	9.302.707,14	1,62
Thailand	923.912,62	0,16
Ungarn	2.789.186,02	0,49
USA	60.823.983,44	10,69
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>4.951.430,30</b>	<b>0,87</b>
Schweiz	4.951.430,30	0,87
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>26.558.754,16</b>	<b>4,67</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>2.549.381,07</b>	<b>0,45</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-976.140,91</b>	<b>-0,17</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>569.668.317,78</b>	<b>100,00</b>

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>536.584.893,16</b>	<b>94,18</b>
AUD	21.583.080,02	3,79
BRL	12.893.550,12	2,25
CAD	47.383.527,70	8,32
CHF	10.968.518,99	1,92
DKK	16.809.271,53	2,95
EUR	138.881.029,83	24,38
GBP	53.047.503,86	9,32
HKD	52.887.908,94	9,28
HUF	2.789.186,02	0,49
JPY	49.284.470,91	8,66
KRW	12.598.002,03	2,21
MXN	2.678.219,94	0,47
NOK	15.365.411,53	2,71
PLN	1.226.305,18	0,22
SEK	6.024.878,39	1,06
SGD	12.955.844,31	2,27
THB	923.912,62	0,16
TWD	9.302.707,14	1,62
USD	64.293.654,51	11,29
ZAR	4.687.909,59	0,81
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>4.951.430,30</b>	<b>0,87</b>
CHF	4.951.430,30	0,87
<b>3. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>26.558.754,16</b>	<b>4,67</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>2.549.381,07</b>	<b>0,45</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-976.140,91</b>	<b>-0,17</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>569.668.317,78</b>	<b>100,00</b>

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

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteil bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>541.536.323,46</b>	<b>95,05</b>
<b>Aktien</b>								<b>536.584.893,16</b>	<b>94,18</b>
<b>EUR</b>								<b>138.881.029,83</b>	<b>24,38</b>
ES0132105018	Acerinox SA (CE Fab.Acero In.) Acciones Nom.	STK		215.017	0	0	EUR 9,910	2.130.818,47	0,37
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port.	STK		71.726	0	0	EUR 32,130	2.304.556,38	0,40
BE0974264930	AGEAS SA/NV Actions Nominatives	STK		53.099	0	0	EUR 37,240	1.977.406,76	0,35
FR0000071946	Alten S.A. Actions au Porteur	STK		15.692	0	0	EUR 144,400	2.265.924,80	0,40
AT0000730007	Andritz AG Inhaber-Aktien	STK		50.089	0	0	EUR 50,200	2.514.467,80	0,44
LU0569974404	Aperam S.A. Actions Nom.	STK		66.163	0	21.547	EUR 28,570	1.890.276,91	0,33
LU1598757687	ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat.	STK		113.402	29.194	0	EUR 25,105	2.846.957,21	0,50
FR0010313833	Arkema S.A. Actions au Porteur	STK		19.831	0	0	EUR 86,780	1.720.934,18	0,30
NL0011872643	ASR Nederland N.V. Aandelen op naam	STK		58.941	0	0	EUR 40,880	2.409.508,08	0,42
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		296.063	0	114.190	EUR 7,078	2.095.533,91	0,37
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom.	STK		695.055	0	0	EUR 3,419	2.376.045,52	0,42
AT0000BAWAG2	BAWAG Group AG Inhaber-Aktien	STK		48.946	0	0	EUR 40,400	1.977.418,40	0,35
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien	STK		24.077	0	7.279	EUR 112,340	2.704.810,18	0,47
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK		40.770	0	0	EUR 57,850	2.358.544,50	0,41
FR0000125338	Capgemini SE Actions Port.	STK		16.676	16.676	0	EUR 171,650	2.862.435,40	0,50
FR0000120172	Carrefour S.A. Actions Port.	STK		152.690	30.658	0	EUR 17,485	2.669.784,65	0,47
ES0105027009	Cia. d. Dis.Integ.Logista Hdgs Acciones Port.	STK		88.412	0	0	EUR 24,660	2.180.239,92	0,38
BE0003593044	Cofinimmo S.A. Actions Porteur	STK		22.883	0	0	EUR 68,400	1.565.197,20	0,27
DE000CBK1001	Commerzbank AG Inhaber-Aktien	STK		266.760	0	0	EUR 10,160	2.710.281,60	0,48
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur	STK		36.687	0	14.400	EUR 55,700	2.043.465,90	0,36
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK		60.033	0	0	EUR 44,965	2.699.383,85	0,47
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		113.666	113.666	0	EUR 20,070	2.281.276,62	0,40
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		247.427	247.427	0	EUR 11,665	2.886.235,96	0,51
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK		23.338	0	0	EUR 96,100	2.242.781,80	0,39
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom.	STK		166.309	0	0	EUR 13,238	2.201.598,54	0,39
DE000A0Z2Z25	freenet AG Namens-Aktien	STK		104.537	0	0	EUR 23,000	2.404.351,00	0,42
PTGALOAM0009	Galp Energia SGPS S.A. Acções Nominativas	STK		203.297	0	0	EUR 10,805	2.196.624,09	0,39
NL0000008977	Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder	STK		34.570	0	0	EUR 79,350	2.743.129,50	0,48
DE0006070006	HOCHTIEF AG Inhaber-Aktien	STK		38.881	0	0	EUR 78,900	3.067.710,90	0,54
FR0010259150	Ipsen S.A. Actions au Porteur	STK		26.740	6.467	0	EUR 110,500	2.954.770,00	0,52
NL0014332678	JDE Peet's N.V. Reg.Shares	STK		72.829	0	0	EUR 27,160	1.978.035,64	0,35
PTJMTOAE0001	Jerónimo Martins SGPS, S.A. Acções Nominativas	STK		106.139	106.139	0	EUR 25,400	2.695.930,60	0,47
DE000K5SAG888	K+S Aktiengesellschaft Namens-Aktien	STK		172.699	172.699	0	EUR 15,970	2.758.003,03	0,48
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B	STK		141.437	141.437	0	EUR 17,255	2.440.495,44	0,43
ES0124244E34	Mapfre S.A. Acciones Nom.	STK		1.170.048	0	0	EUR 1,827	2.137.677,70	0,38
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK		37.385	0	0	EUR 73,720	2.756.022,20	0,48
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien	STK		57.406	0	0	EUR 38,970	2.237.111,82	0,39
FI00090002422	Outokumpu Oyj Reg.Shares Cl.A	STK		568.666	0	406.894	EUR 4,983	2.833.662,68	0,50
IT0005278236	Pirelli & C. S.p.A. Azioni nom.	STK		438.420	438.420	0	EUR 4,535	1.988.234,70	0,35
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A. Azioni nom.	STK		251.360	0	0	EUR 9,910	2.490.977,60	0,44
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.	STK		28.225	0	9.535	EUR 74,300	2.097.117,50	0,37
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder	STK		41.535	0	0	EUR 48,440	2.011.955,40	0,35
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK		188.984	0	0	EUR 13,420	2.536.165,28	0,45
FR0010451203	Rexel S.A. Actions au Porteur	STK		110.402	0	0	EUR 22,670	2.502.813,34	0,44
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		21.880	21.880	0	EUR 98,050	2.145.334,00	0,38
DE0005SHA0159	Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.	STK		341.878	0	77.269	EUR 5,690	1.945.285,82	0,34
BE0003470755	Solvay S.A. Actions au Porteur A	STK		25.784	0	0	EUR 101,950	2.628.678,80	0,46
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A. Actions Port.	STK		13.291	0	0	EUR 182,200	2.421.620,20	0,43
NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen op naam	STK		147.424	0	0	EUR 16,160	2.382.371,84	0,42
FI00090005961	Stora Enso Oyj Reg.Shares Cl.R	STK		250.997	250.997	0	EUR 10,610	2.663.078,17	0,47
DE000A2YN900	TeamViewer SE Inhaber-Aktien	STK		179.567	0	53.505	EUR 14,605	2.622.576,04	0,46
NL0014559478	Technip Energies N.V. Aandelen op naam	STK		124.644	0	0	EUR 20,610	2.568.912,84	0,45
FI00090000277	TietoEVRY Oyj Reg.Shares	STK		120.517	0	0	EUR 25,340	3.053.900,78	0,54
FR0000120271	TotalEnergies SE Actions au Porteur	STK		47.034	0	0	EUR 53,170	2.500.797,78	0,44
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom.	STK		104.321	0	102.575	EUR 21,520	2.244.987,92	0,39
IT0004810054	Unipol Gruppo S.p.A. Azioni nom.	STK		451.822	0	0	EUR 4,909	2.217.994,20	0,39
FR0013447729	Verallia SA Actions Port. (Prom.)	STK		52.654	0	37.037	EUR 34,320	1.807.085,28	0,32
AT0000746409	Verbund AG Inhaber-Aktien	STK		40.051	40.051	0	EUR 73,200	2.931.733,20	0,51
<b>AUD</b>								<b>21.583.080,02</b>	<b>3,79</b>
AU0000000ASX7	ASX Ltd. Reg.Shares	STK		71.302	71.302	0	AUD 63,000	2.739.741,89	0,48
AU0000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK		349.951	0	0	AUD 20,550	4.386.180,03	0,77
AU0000000CLW0	Charter Hall Long WALE REIT Reg.Stapled Secs	STK		1.325.151	0	0	AUD 4,010	3.240.985,81	0,57
AU0000000SHL7	Sonic Healthcare Ltd. Reg.Shares	STK		200.375	0	0	AUD 35,570	4.347.051,53	0,76
AU0000000S320	South32 Ltd. Reg.Shares	STK		1.459.382	0	0	AUD 3,760	3.346.757,29	0,59
AU0000016875	VIVA ENERGY GROUP LTD. Reg.Shares	STK		1.918.670	0	0	AUD 3,010	3.522.363,47	0,62

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>BRL</b>								<b>12.893.550,12</b>	<b>2,25</b>
BRABEVACNOR1	AMBEV S.A. Reg.Shares	STK		418.600	418.600	0	BRL 15,220	1.208.935,86	0,21
BRB3SAACNOR6	B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao Reg.Shares	STK		584.400	584.400	0	BRL 14,640	1.623.456,55	0,28
BRBBASACNOR3	Banco do Brasil S.A. Reg.Shares	STK		175.700	0	0	BRL 50,050	1.668.649,91	0,29
BRCPLEACNPB9	Cia Paranaense En. Copel S.A. Reg.Preferred Shs B	STK		934.266	934.266	0	BRL 8,080	1.432.423,01	0,25
BRGGBRACNPR8	Gerdau S.A. Reg.Preferred Shares	STK		222.810	10.610	0	BRL 25,280	1.068.811,54	0,19
BRGMATACNOR7	Grupo Mateus S.A. Reg.Shares	STK		774.900	774.900	0	BRL 7,740	1.138.088,43	0,20
BRITSAACNPR7	Itausa S.A. Reg.Pref.Shares	STK		809.800	809.800	0	BRL 9,600	1.475.157,50	0,26
BRGOAUACNPR8	Metal Reg.Pref.Shares	STK		455.501	455.501	0	BRL 11,940	1.032.007,96	0,18
BRBEFACNOR6	Minerva SA Reg.Shares	STK		610.000	160.000	0	BRL 10,380	1.201.480,08	0,21
BRPETRACNPR6	Petroleo Brasileiro S.A. Reg.Pref.Shares	STK		177.400	0	0	BRL 131,030	1.044.539,28	0,18
<b>CAD</b>								<b>47.383.527,70</b>	<b>8,32</b>
CA00208D4084	ARC Resources Ltd. Reg.Shares	STK		538.500	538.500	0	CAD 17,660	6.604.838,04	1,16
CA15135U1093	Cenovus Energy Inc. Reg.Shares	STK		265.850	44.300	0	CAD 22,160	4.091.590,73	0,72
CA2918434077	Empire Co. Ltd. Reg.Shares Cl.A	STK		254.200	254.200	0	CAD 37,140	6.556.970,22	1,15
CA4530384086	Imperial Oil Ltd. Reg.Shares	STK		131.080	19.200	0	CAD 67,500	6.145.057,78	1,08
CA53278L1076	Linamar Corp. Reg.Shares	STK		111.036	0	0	CAD 68,820	5.307.185,19	0,93
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd. Reg.Shares	STK		80.600	80.600	0	CAD 119,240	6.674.869,43	1,17
CA69946Q1046	Parex Resources Inc. Reg.Shares	STK		351.436	37.500	0	CAD 26,500	6.468.117,29	1,14
CA8672241079	Suncor Energy Inc. Reg.Shares	STK		206.300	44.600	0	CAD 38,630	5.534.899,02	0,97
<b>CHF</b>								<b>10.968.518,99</b>	<b>1,92</b>
CH0012214059	Holcim Ltd. Namens-Aktien	STK		48.889	0	20.952	CHF 60,180	3.012.481,46	0,53
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		50.342	50.342	0	CHF 89,850	4.631.371,22	0,81
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien	STK		179.941	0	0	CHF 18,045	3.324.666,31	0,58
<b>DKK</b>								<b>16.809.271,53</b>	<b>2,95</b>
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK		1.954	1.954	0	DKK 12.050,000	3.161.684,93	0,56
DK0010181759	Carlsberg AS Navne-Aktier B	STK		26.894	0	0	DKK 1.089,000	3.932.694,97	0,69
DK0010272202	GENMAB AS Navne-Aktier	STK		7.350	7.350	0	DKK 2.566,000	2.532.508,86	0,44
DK0010307958	Jyske Bank A/S Navne-Aktier	STK		62.955	0	0	DKK 520,200	4.397.517,32	0,77
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		19.150	19.150	0	DKK 1.083,000	2.784.865,45	0,49
<b>GBP</b>								<b>53.047.503,86</b>	<b>9,32</b>
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares	STK		158.453	0	0	GBP 19,320	3.564.078,73	0,63
GB00B1XZS820	Anglo American PLC Reg.Shares	STK		83.721	25.372	0	GBP 22,310	2.174.571,43	0,38
GB0000961622	Balfour Beatty PLC Reg.Shares	STK		640.960	0	0	GBP 3,402	2.538.662,32	0,45
GB0031348658	Barclays PLC Reg.Shares	STK		1.220.977	0	0	GBP 1,531	2.176.033,80	0,38
GB0000811801	Barratt Developments PLC Reg.Shares	STK		377.512	0	0	GBP 4,165	1.830.566,32	0,32
GB0002869419	Big Yellow Group PLC Reg.Shares	STK		145.996	0	0	GBP 10,690	1.817.014,37	0,32
GB0007980591	BP PLC Reg.Shares	STK		481.982	87.420	177.735	GBP 4,630	2.597.793,40	0,46
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien	STK		109.753	0	38.183	GBP 23,240	2.969.560,82	0,52
GB00BV9FP302	Computacenter PLC Reg.Shares	STK		74.028	0	0	GBP 22,680	1.954.693,94	0,34
GB0008220112	DS Smith PLC Reg.Shares	STK		718.795	718.795	0	GBP 2,712	2.269.522,19	0,40
GB00BYZ9041	Future PLC Reg.Shares	STK		133.204	0	0	GBP 6,760	1.048.343,63	0,18
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares	STK		170.478	27.351	0	GBP 13,950	2.768.740,48	0,49
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC Reg.Shares	STK		154.105	0	0	GBP 18,680	3.351.454,30	0,59
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Reg.Shares	STK		364.231	364.231	0	GBP 6,213	2.634.619,85	0,46
GB00B61TVQ02	Inchcape PLC Reg.Shares	STK		208.254	0	88.488	GBP 7,720	1.871.760,82	0,33
GB0005603997	Legal & General Group PLC Reg.Shares	STK		769.049	0	0	GBP 2,278	2.039.611,40	0,36
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC Reg.Shares	STK		4.636.263	0	0	GBP 0,434	2.342.596,52	0,41
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC Reg.Shares	STK		736.345	0	0	GBP 2,405	2.061.750,57	0,36
GB00BLDRH360	OSB GROUP PLC Reg.Shares	STK		388.018	0	0	GBP 4,810	2.172.884,54	0,38
GB00BG11K365	Redrow PLC Reg.Shares	STK		381.894	0	0	GBP 4,456	1.981.197,25	0,35
GB0007188757	Rio Tinto PLC Reg.Shares	STK		38.343	0	0	GBP 49,955	2.229.999,44	0,39
GB00BLGZ9862	Tesco PLC Reg.Shs	STK		943.565	943.565	0	GBP 2,489	2.734.238,67	0,48
JE00B8KF9B49	WPP PLC Reg.Shares	STK		200.936	0	0	GBP 8,198	1.917.809,07	0,34
<b>HKD</b>								<b>52.887.908,94</b>	<b>9,28</b>
KYG017191142	Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shares	STK		149.100	149.100	0	HKD 81,200	1.423.204,97	0,25
KYG0535Q1331	ASMPT Ltd. Reg.Shares New	STK		471.600	0	0	HKD 77,150	4.277.041,90	0,75
CNE100001TJ4	BAIC Motor Corp. Ltd. Reg.Shares H	STK		3.925.500	0	0	HKD 1,900	876.763,30	0,15
HK2388011192	Bank of China (Hongkong) Ltd. Reg.Shares	STK		502.000	0	0	HKD 23,950	1.413.328,16	0,25
CNE100000205	Bank of Communications Co.Ltd. Reg.Shares H	STK		1.904.000	0	0	HKD 5,190	1.161.630,70	0,20
KYG1674K1013	Budweiser Brew. Co. Apac.Ltd. Reg.Shares	STK		1.110.000	1.110.000	0	HKD 20,200	2.635.773,73	0,46
CNE1000002G3	China Cmncnts Srvc Corp.Ltd. Reg.Shares H	STK		2.420.000	0	0	HKD 3,860	1.098.086,24	0,19
CNE1000002H1	China Construction Bank Corp. Reg.Shares H	STK		1.796.000	0	0	HKD 5,070	1.070.404,85	0,19
KYG2121Q1055	China Feihe Ltd. Reg.Shares	STK		2.110.000	2.110.000	0	HKD 4,360	1.081.440,73	0,19
KYG211081248	China Medical System Holdings Reg.Consolid.Shares	STK		774.000	0	0	HKD 12,760	1.160.981,80	0,20
CNE1000002J7	COSCO SHIPPING Holdings Co.Ltd Reg.Shares H	STK		713.000	713.000	0	HKD 7,060	591.736,02	0,10
HK1093012172	CSPC Pharmaceutical Group Ltd. Reg.Shares	STK		1.372.000	1.372.000	0	HKD 6,810	1.098.335,45	0,19
BMG210A71016	Grand Pharmaceutical Group Ltd Reg.Ajusted Shares	STK		5.100.000	0	2.120.000	HKD 4,420	2.649.880,10	0,47
KYG4387E1070	Health & Happiness (H&H) Int. Reg.Shares	STK		2.063.500	0	737.500	HKD 10,080	2.445.112,15	0,43
HK0388045442	Hongkong Exch. + Clear. Ltd. Reg.Shs	STK		73.900	73.900	0	HKD 295,200	2.564.451,97	0,45



# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
CNE100003G1	Industr. & Commerc.Bk of China Reg.Shares H		STK	2.182.000	0	0	HKD 4,180	1.072.172,85	0,19
KYG8208B1014	JD.com Inc. Reg.Shares A		STK	88.250	88.250	0	HKD 132,400	1.373.524,71	0,24
KYG2585A1045	JS Global Lifestyle Company Lt Reg.Shares		STK	2.728.000	2.728.000	0	HKD 7,940	2.546.235,95	0,45
BMG5320C1082	Kunlun Energy Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.458.000	0	0	HKD 6,160	1.055.776,56	0,19
HK0992009065	Lenovo Group Ltd. Reg.Shares		STK	1.204.000	0	0	HKD 8,170	1.156.331,41	0,20
BMG5800U1071	Man Wah Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	5.483.200	5.483.200	0	HKD 5,230	3.371.083,84	0,59
KYG6501M1050	Nexteer Automotive Group Ltd. Reg.Shares		STK	2.620.294	0	0	HKD 4,090	1.259.815,97	0,22
BMG677491539	Orient Overseas (Intl.) Ltd. Reg.Shares New		STK	122.000	122.000	0	HKD 105,100	1.507.288,29	0,26
CNE100001MK7	People's Ins.Co.(Gr.) o.Ch.Ltd Reg.Shares H		STK	3.349.000	0	0	HKD 2,840	1.118.065,55	0,20
CNE100001NV2	Sinopec Engineering (Group)Co. Reg.Shares H		STK	2.587.000	0	0	HKD 3,490	1.061.342,69	0,19
KYG8187G1055	SITC International Hldg.Co.Ltd Reg.Shs Reg.S		STK	1.576.000	0	0	HKD 14,300	2.649.268,82	0,47
KYG9222R1065	Uni-President China HLDGS Ltd. Reg.Shares		STK	1.251.000	0	0	HKD 6,600	970.588,24	0,17
BMG9400S1329	VTech Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	524.700	0	0	HKD 51,400	3.170.355,48	0,56
KYG960071028	WH Group Ltd Reg.Shares		STK	5.661.500	0	0	HKD 4,150	2.761.934,57	0,48
KYG9828G1082	Xinyi Glass Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	1.580.000	0	607.000	HKD 12,200	2.265.951,94	0,40
<b>HUF</b>								<b>2.789.186,02</b>	<b>0,49</b>
HU0000153937	MOL Magyar Olaj-és Gázip. Nyrt Namens-Aktien A		STK	156.814	0	0	HUF 2.986,000	1.260.421,55	0,22
HU0000123096	Richter Gedeon Vegye.Gyár Nyrt Namens-Aktien		STK	66.816	0	0	HUF 8.500,000	1.528.764,47	0,27
<b>JPY</b>								<b>49.284.470,91</b>	<b>8,66</b>
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares		STK	134.400	134.400	0	JPY 2.149,000	1.836.728,78	0,32
JP3754200008	Biprogy Inc. Reg.Shares		STK	96.000	0	0	JPY 3.533,000	2.156.871,22	0,38
JP3271400008	Credit Saison Co. Ltd. Reg.Shares		STK	149.900	149.900	0	JPY 2.204,500	2.101.459,78	0,37
JP3638600001	Dowa Holdings Inc. Reg.Shares		STK	61.700	0	0	JPY 4.546,000	1.783.708,74	0,31
JP3811000003	Fujikura Ltd. Reg.Shares		STK	325.500	325.500	0	JPY 1.202,500	2.489.117,65	0,44
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Reg.Shares		STK	79.800	0	0	JPY 4.341,000	2.202.936,72	0,39
JP3294460005	Impex Corp. Reg.Shares		STK	191.100	0	0	JPY 1.598,000	1.941.989,19	0,34
JP3152820001	Internet Initiative Japan Inc. Reg.Shares		STK	93.800	0	0	JPY 2.700,500	1.610.854,69	0,28
JP3143600009	ITOCHEU Corp. Reg.Shares		STK	60.300	60.300	0	JPY 5.687,000	2.180.770,11	0,38
JP3667600005	JGC Holdings Corp. Reg.Shares		STK	201.400	201.400	0	JPY 1.865,000	2.388.623,21	0,42
JP3206000006	Kakaku.com Inc. Reg.Shares		STK	147.200	147.200	0	JPY 2.063,000	1.931.151,67	0,34
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares		STK	68.500	0	0	JPY 4.450,000	1.938.473,77	0,34
JP3877600001	Marubeni Corp. Reg.Shares		STK	153.700	0	48.100	JPY 2.440,000	2.384.915,74	0,42
JP3893600001	Mitsui & Co. Ltd. Reg.Shares		STK	70.500	0	17.300	JPY 5.411,000	2.425.917,33	0,43
JP3688370000	Nippon Express Holdings Inc. Reg.Shares		STK	33.700	33.700	0	JPY 8.104,000	1.736.755,48	0,30
JP3717600005	Nippon Shinyaku Co. Ltd. Reg.Shares		STK	50.000	50.000	0	JPY 5.874,000	1.867.726,55	0,33
JP3732200005	Nippon Television Holdings Inc Reg.Shares		STK	247.000	0	0	JPY 1.369,000	2.150.352,94	0,38
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares		STK	86.600	0	0	JPY 2.606,000	1.435.164,39	0,25
JP3188220002	Otsuka Holdings Company Ltd. Reg.Shares		STK	71.700	87.700	16.000	JPY 5.271,000	2.403.374,88	0,42
JP3814800003	Subaru Corp. Reg.Shares		STK	114.400	0	0	JPY 2.703,000	1.966.443,24	0,35
JP3573000001	Tokyo Gas Co. Ltd. Reg.Shares		STK	99.700	99.700	0	JPY 3.143,000	1.992.731,96	0,35
JP3635400009	Toyota Boshoku Corp. Reg.Shares		STK	145.700	0	0	JPY 2.565,500	2.377.064,23	0,42
JP3637300009	Trend Micro Inc. Reg.Shares		STK	40.100	40.100	0	JPY 6.945,000	1.771.030,21	0,31
JP3940400009	Yamato Kogyo Co. Ltd. Reg.Shares		STK	56.700	0	0	JPY 6.130,000	2.210.308,43	0,39
<b>KRW</b>								<b>12.598.002,03</b>	<b>2,21</b>
KR7005830005	DB Insurance Co. Ltd. Reg.Shares		STK	23.895	0	0	KRW 74.600,000	1.245.835,95	0,22
KR7139130009	DGB Financial Group Co. Ltd. Reg.Shares		STK	170.606	0	0	KRW 7.270,000	866.849,51	0,15
KR7078930005	GS Holdings Corp. Reg.Shares		STK	39.092	0	0	KRW 36.650,000	1.001.329,17	0,18
KR7086280005	Hyundai Glovis Co. Ltd. Reg.Shares		STK	8.376	0	0	KRW 197.700,000	1.157.333,00	0,20
KR7024110009	Industrial Bank of Korea Reg.Shares		STK	146.595	0	0	KRW 10.340,000	1.059.387,13	0,19
KR7000270009	Kia Corp. Reg.Shares		STK	21.958	0	0	KRW 88.500,000	1.358.160,36	0,24
KR7039490008	Kiwoom Securities Co. Ltd. Reg.Shares		STK	9.169	9.169	0	KRW 88.400,000	566.486,07	0,10
KR7001120005	Lg International Corp. Reg.Shares		STK	30.703	0	0	KRW 36.050,000	773.572,60	0,14
KR7271560005	Orion Corp. of Republic of Korea Reg.Shares		STK	13.107	13.107	0	KRW 120.000,000	1.099.257,77	0,19
KR7028050003	Samsung Engineering Co. Ltd. Reg.Shares		STK	55.830	55.830	0	KRW 28.300,000	1.104.254,20	0,19
KR7316140003	Woori Financial Group Inc. Reg.Shares		STK	104.159	0	0	KRW 11.790,000	858.273,30	0,15
KR7111770004	Youngone Corp. Reg.Shares		STK	33.436	0	0	KRW 64.500,000	1.507.262,97	0,26
<b>MXN</b>								<b>2.678.219,94</b>	<b>0,47</b>
MX01AL0C0004	Alpek S.A.B. de C.V. Reg.Shares		STK	970.500	0	0	MXN 17,220	899.556,73	0,16
MX01AC100006	Arca Continental S.A.B. de C.V Bearer Shares		STK	187.900	0	0	MXN 175,860	1.778.663,21	0,31
<b>NOK</b>								<b>15.365.411,53</b>	<b>2,71</b>
NO0010345853	Aker BP ASA Navne-Aksjer		STK	171.648	64.143	0	NOK 251,900	3.695.045,67	0,65
NO0010096985	Equinor ASA Navne-Aksjer		STK	148.997	51.297	0	NOK 312,400	3.977.786,28	0,70
NO0003096208	Leroy Seafood Group ASA Navne-Aksjer		STK	726.859	726.859	0	NOK 40,920	2.541.784,30	0,45
NO0011202772	VAR Energi ASA Navne-Aksjer		STK	1.202.987	348.430	0	NOK 29,300	3.012.183,67	0,53
NO0010208051	Yara International ASA Navne-Aksjer		STK	66.117	0	0	NOK 378,500	2.138.611,61	0,38



# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>PLN</b>									
PLPKN0000018	Polski Koncern Naftowy Orlen Inhaber-Aktien		STK	83.844	0	0	PLN 65,080	1.226.305,18	0,22
<b>SEK</b>									
SE0000171100	SSAB AB Namn-Aktier A (fria)		STK	470.175	0	333.656	SEK 76,900	3.062.380,73	0,54
SE0005190238	Tele2 AB Namn-Aktier B		STK	390.022	390.022	0	SEK 89,680	2.962.497,66	0,52
<b>SGD</b>									
SG1B51001017	Jardine Cycle & Carriage Ltd. Reg.Shares		STK	213.100	0	0	SGD 34,780	5.032.331,61	0,88
SG1J26887955	Singapore Exchange Ltd. Reg.Shares		STK	413.200	413.200	0	SGD 9,630	2.701.735,47	0,47
SG1U76934819	Yangzijiang Shipbuilding Hldgs Reg.Shares		STK	5.127.089	0	0	SGD 1,500	5.221.777,23	0,92
<b>THB</b>									
TH6838010010	Star Petroleum Refining PCL Reg.Shares (Foreign)		STK	4.399.900	0	0	THB 8,100	923.912,62	0,16
<b>TWD</b>									
TW0003596003	Arcadyan Technology Corp. Reg.Shares		STK	320.000	320.000	0	TWD 123,000	1.163.746,46	0,20
TW0002385002	Chicony Electronics Co. Ltd. Reg.Shares		STK	412.000	0	0	TWD 98,000	1.193.786,26	0,21
TW0003293007	Intl Games Sys Co. Ltd. Reg.Shares		STK	70.000	0	24.000	TWD 618,000	1.279.056,70	0,22
TW0003034005	Novatek Microelectronics Corp. Reg.Shares		STK	85.000	0	0	TWD 426,500	1.071.867,85	0,19
TW0004915004	Primax Electronics Ltd. Reg.Shares		STK	381.000	381.000	0	TWD 65,800	741.231,99	0,13
TW0006121007	Simplo Technology Co. Ltd. Reg.Shares		STK	112.000	0	0	TWD 328,500	1.087.819,10	0,19
TW0002404001	United Integrated Ser.Co.Ltd. Reg.Shares		STK	188.000	0	0	TWD 218,000	1.211.762,83	0,21
TW0006669005	Wiwynn Corp. Reg.Shares		STK	37.000	0	0	TWD 1.420,000	1.553.435,95	0,27
<b>USD</b>									
US0044981019	ACI Worldwide Inc. Reg.Shares		STK	31.400	0	0	USD 23,180	670.429,70	0,12
US00508Y1029	Acuity Brands Inc. Reg.Shares		STK	7.400	7.400	0	USD 162,460	1.107.358,73	0,19
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares		STK	3.000	3.000	0	USD 483,770	1.336.812,05	0,23
US01973R1014	Allison Transmission Hldg.Inc. Reg.Shares		STK	21.300	0	0	USD 56,390	1.106.348,27	0,19
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	11.340	4.500	0	USD 119,100	1.244.041,82	0,22
GB0022569080	Amdocs Ltd. Reg.Shares		STK	10.400	0	0	USD 98,010	938.888,22	0,16
US03743Q1085	APA Corp. Reg.Shares		STK	19.600	0	0	USD 33,920	612.381,52	0,11
US03937C1053	ArcBest Corp. Reg.Shares		STK	9.400	0	0	USD 99,360	860.299,36	0,15
US05329W1027	Autonation Inc. Reg.Shares		STK	7.100	0	0	USD 163,780	1.071.098,42	0,19
US0936711052	Block H. & R. Inc. Reg.Shares		STK	21.600	21.600	0	USD 32,020	637.067,19	0,11
US09739D1000	Boise Cascade Co. Reg.Shares		STK	11.707	0	0	USD 89,410	964.143,94	0,17
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	17.886	7.086	0	USD 64,000	1.054.395,06	0,19
US12008R1077	Builders Firstsource Inc. Reg.Shares		STK	7.400	0	3.800	USD 136,170	928.161,01	0,16
US14149Y1082	Cardinal Health Inc. Reg.Shares		STK	10.400	10.400	0	USD 93,920	899.708,01	0,16
US15135B1017	Centene Corp. Reg.Shares		STK	13.300	3.600	0	USD 66,990	820.676,09	0,14
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares		STK	4.600	0	0	USD 156,240	662.003,41	0,12
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	25.669	10.600	0	USD 51,210	1.210.804,12	0,21
US1924461023	Cognizant Technology Sol.Corp. Reg.Shs Cl.A		STK	9.400	0	0	USD 64,540	558.813,61	0,10
US20602D1019	Concentrix Corp. Reg.Shares		STK	4.200	0	0	USD 80,790	312.548,24	0,05
US20825C1045	ConocoPhillips Reg.Shares		STK	9.088	2.388	0	USD 103,060	862.717,52	0,15
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares		STK	8.700	0	0	USD 68,760	551.017,36	0,10
US24703L2025	Dell Technologies Inc. Reg.Shares C		STK	19.100	0	0	USD 53,100	934.196,10	0,16
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	34.100	0	0	USD 26,720	839.268,64	0,15
US2786421030	eBay Inc. Reg.Shares		STK	27.800	12.400	0	USD 44,600	1.142.062,36	0,20
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	1.800	0	0	USD 440,100	729.682,68	0,13
US29249E1091	Enact Holdings Inc. Reg.Shares		STK	38.200	0	0	USD 24,920	876.842,44	0,15
BMG3223R1088	Everest Reinsurance Group Ltd. Reg.Shares		STK	3.000	0	0	USD 339,660	938.589,78	0,16
US30161Q1040	Exelixis Inc. Reg.Shares		STK	40.700	0	0	USD 18,960	710.792,61	0,12
US30212P3038	Expedia Group Inc. Reg.Shares		STK	12.000	12.000	0	USD 107,840	1.191.986,37	0,21
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares		STK	10.900	0	0	USD 106,700	1.071.275,27	0,19
US3156161024	F5 Inc. Reg.Shares		STK	8.300	8.300	0	USD 145,770	1.114.439,28	0,20
US3976241071	Greif Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	14.019	0	0	USD 69,050	891.642,75	0,16
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	11.619	0	0	USD 80,070	856.936,70	0,15
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares		STK	25.400	0	0	USD 30,320	709.370,42	0,12
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares		STK	1.600	1.600	0	USD 443,860	654.148,21	0,11
US4601461035	International Paper Co. Reg.Shares		STK	17.500	0	0	USD 31,680	510.661,82	0,09
US46817M1071	Jackson Financial Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	19.500	0	0	USD 30,550	548.726,57	0,10
IE00B4Q5ZN47	Jazz Pharmaceuticals PLC Reg.Shares		STK	7.900	7.900	0	USD 123,670	899.915,26	0,16
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares		STK	4.069	1.000	0	USD 240,480	901.315,45	0,16
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A		STK	8.290	0	0	USD 90,660	692.277,81	0,12
US56418H1005	ManpowerGroup Inc. Reg.Shares		STK	8.700	0	0	USD 79,830	639.728,27	0,11
US5658491064	Marathon Oil Corp. Reg.Shares		STK	39.000	0	0	USD 22,930	823.718,51	0,14
US56585A1025	Marathon Petroleum Corp. Reg.Shares		STK	8.000	0	0	USD 116,340	857.292,87	0,15
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	3.200	3.200	0	USD 420,880	1.240.561,88	0,22
US58470H1014	Medifast Inc. Reg.Shares		STK	6.567	0	0	USD 91,550	553.777,78	0,10
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	10.500	10.500	0	USD 113,540	1.098.116,34	0,19
US5528481030	MGIC Investment Corp. Reg.Shares		STK	59.100	0	0	USD 15,660	852.490,21	0,15
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	4.200	4.200	0	USD 335,050	1.296.191,22	0,23
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	3.300	800	0	USD 294,770	895.998,71	0,16
US6247561029	Mueller Industries Inc. Reg.Shares		STK	14.500	0	0	USD 86,710	1.158.103,44	0,20
US63938C1080	Navient Corp. Reg.Shares		STK	48.700	0	0	USD 18,750	841.085,99	0,15
US6745991058	Occidental Petroleum Corp. Reg.Shares		STK	15.871	0	0	USD 58,520	855.497,55	0,15

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares	STK		8.800	0	0	USD 130,720	1.059.582,74	0,19
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc. Reg.Shares	STK		19.300	19.300	0	USD 65,860	1.170.817,48	0,21
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK		21.600	5.800	0	USD 36,120	718.640,45	0,13
US7185461040	Phillips 66 Reg.Shares	STK		7.400	0	0	USD 94,530	644.334,73	0,11
US74051N1028	Premier Inc. Reg.Shares	STK		35.100	35.100	0	USD 27,430	886.835,54	0,16
US7502361014	Radian Group Inc. Reg.Shares	STK		36.100	0	0	USD 25,170	836.952,06	0,15
US7595091023	Reliance Steel & Alumin. Co. Reg.Shares	STK		3.121	0	1.300	USD 270,810	778.517,95	0,14
US79466L3024	Salesforce Inc. Reg.Shares	STK		6.000	6.000	0	USD 210,430	1.162.971,49	0,20
US8010561020	Sanmina Corp. Reg.Shares New	STK		20.400	0	0	USD 59,870	1.124.992,40	0,20
US85208M1027	Sprouts Farmers Market Inc. Reg.Shares	STK		29.600	0	0	USD 36,280	989.165,94	0,17
US8581191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares	STK		6.100	0	5.100	USD 109,140	613.230,78	0,11
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares	STK		24.200	0	0	USD 34,070	759.447,34	0,13
US125231003	The Cigna Group Reg.Shares	STK		4.600	1.100	0	USD 277,250	1.174.734,03	0,21
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares	STK		19.000	19.000	0	USD 60,020	1.050.412,20	0,18
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK		7.700	7.700	0	USD 149,380	1.059.481,42	0,19
US8962881079	Trinet Group Inc. Reg.Shares	STK		10.400	0	0	USD 94,960	909.670,70	0,16
US91325V1089	Uniti Group Inc. Reg.Shares	STK		64.600	0	0	USD 4,690	279.071,52	0,05
US91529Y1064	UNUM Group Reg.Shares	STK		19.300	0	0	USD 47,450	843.536,13	0,15
US91913Y1001	Valero Energy Corp. Reg.Shares	STK		6.700	0	0	USD 116,610	719.649,06	0,13
US92343X1000	Verint Systems Inc. Reg.Shares	STK		19.260	0	0	USD 35,230	624.998,66	0,11
US9282981086	Vishay Intertechnology Inc. Reg.Shares	STK		43.000	0	0	USD 29,040	1.150.204,95	0,20
<b>ZAR</b>								<b>4.687.909,59</b>	<b>0,81</b>
ZAE000054045	African Rainbow Minerals Ltd. Reg.Shares	STK		76.898	0	0	ZAR 199,960	750.354,36	0,13
ZAE000083648	Impala Platinum Holdings Ltd. Reg.Shares	STK		76.965	0	0	ZAR 124,660	468.197,01	0,08
ZAE000085346	Kumba Iron Ore Ltd. Reg.Shares	STK		29.971	0	0	ZAR 443,420	648.522,05	0,11
ZAE000042164	MTN Group Ltd. Reg.Shares	STK		210.000	210.000	0	ZAR 137,720	1.411.316,91	0,25
ZAE000259701	Sibanye Stillwater Ltd. Reg.Shares	STK		346.501	0	0	ZAR 28,610	483.760,70	0,08
ZAE000028296	Truworths International Ltd. Reg.Shares	STK		334.644	0	0	ZAR 56,690	925.758,56	0,16
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>								<b>4.951.430,30</b>	<b>0,87</b>
<b>CHF</b>								<b>4.951.430,30</b>	<b>0,87</b>
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK		17.572	6.084	0	CHF 275,200	4.951.430,30	0,87
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>541.536.323,46</b>	<b>95,05</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR		7.715.456,00			% 100,000	7.715.456,00	1,36
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK		71.179,69			% 100,000	9.557,91	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		HUF		6.568,65			% 100,000	17,68	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK		127.745,96			% 100,000	10.916,92	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		PLN		69,39			% 100,000	15,59	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK		65.466.436,34			% 100,000	5.544.878,21	0,97
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD		2.029,69			% 100,000	1.237,93	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD		2.000.857,32			% 100,000	1.389.638,65	0,24
DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF		2.112.625,19			% 100,000	2.163.134,38	0,38
DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP		45.339,48			% 100,000	52.785,69	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD		15.792,79			% 100,000	1.856,49	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY		1.276.764.626,00			% 100,000	8.119.329,90	1,44
DekaBank Deutsche Girozentrale		MXN		58,44			% 100,000	3,15	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		NZD		2.269,87			% 100,000	1.272,78	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		SGD		66.464,45			% 100,000	45.127,95	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale		TRY		30.879,70			% 100,000	1.091,04	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		TWD		0,20			% 100,000	0,01	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		USD		1.631.117,34			% 100,000	1.502.433,88	0,26
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>26.558.754,16</b>	<b>4,67</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>26.558.754,16</b>	<b>4,67</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Dividendenansprüche		EUR		1.800.675,83				1.800.675,83	0,32
Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR		11.108,08				11.108,08	0,00
Forderungen aus Quellensteuerrückstellungen		EUR		737.597,16				737.597,16	0,13
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>2.549.381,07</b>	<b>0,45</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR		-68.218,10				-68.218,10	-0,01
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR		-907.922,81				-907.922,81	-0,16
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-976.140,91</b>	<b>-0,17</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>569.668.317,78</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>4.672.476,000</b>	
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>121,92</b>	

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

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85894	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,44720	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,70165	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,80665	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,97665	= 1 Euro (EUR)
Türkei, Lira (Neu)	(TRY)	28,30290	= 1 Euro (EUR)
Polen, Zloty	(PLN)	4,44960	= 1 Euro (EUR)
Ungarn, Forint	(HUF)	371,50000	= 1 Euro (EUR)
Südafrika, Rand	(ZAR)	20,49235	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08565	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,43984	= 1 Euro (EUR)
Mexiko, Peso	(MXN)	18,57805	= 1 Euro (EUR)
Brasilien, Real	(BRL)	5,27000	= 1 Euro (EUR)
Thailand, Baht	(THB)	38,57420	= 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,47280	= 1 Euro (EUR)
Südkorea, Won	(KRW)	1.430,82000	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	157,25000	= 1 Euro (EUR)
Taiwan, Neue Dollar	(TWD)	33,82180	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,50680	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,63958	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland, Dollar	(NZD)	1,78340	= 1 Euro (EUR)

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:  
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>BRL</b>				
BRENBRACNOR2	EDP - Energias do Brasil SA Reg.Shares	STK	0	272.000
BRUSIMACNPA6	Usinas Siderurg.de Min. Ger.SA Reg.Preferred Shs A	STK	0	679.400
<b>CAD</b>				
CA1375761048	Canfor Corp. Reg.Shares	STK	0	280.744
CA2927661025	Enerplus Corp. Reg.Shares	STK	140.000	441.437
CA5592224011	Magna International Inc. Reg.Shares	STK	0	79.558
CA59151K1084	Methanex Corp. Reg.Shares	STK	0	123.223
CA6330671034	National Bank of Canada Reg.Shares	STK	0	71.800
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	68.441
<b>CHF</b>				
CH0012138605	Adecco Group AG Namens-Aktien	STK	0	71.755
<b>EUR</b>				
NL0000303709	AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)	STK	0	575.700
ES0113860A34	Banco de Sabadell S.A. Acciones Nom. S.A	STK	0	2.931.663
DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien	STK	0	54.014
BE0974268972	bpost S.A. Actions Nom. Compartm. A	STK	0	382.419
DE0005140008	Deutsche Bank AG Namens-Aktien	STK	0	218.742
AT0000652011	Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien	STK	0	101.242
DE0006047004	Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien	STK	0	41.242
FR0000120859	IMÉRYYS S.A. Actions Port.	STK	0	54.597
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK	0	187.047
FR0000120560	Quadiant S.A. Actions Port.	STK	0	106.944
LU0061462528	RTL Group S.A. Actions au Porteur	STK	0	46.674
GB00BP6MXD84	Shell PLC Reg.Shares Cl.	STK	0	108.034
FR0000130809	Société Générale S.A. Actions Port.	STK	0	87.098
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien	STK	20.000	20.000
AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien	STK	0	83.454
<b>GBP</b>				
GB00B4Y7R145	Currys PLC Reg.Shares	STK	0	2.426.490
GB00B1VNSX38	Drax Group PLC Reg.Shares	STK	0	296.560
GB00B1XH2C03	Ferrexpo PLC Reg.Shares	STK	0	1.296.337
GB00BDVZY777	Intl. Distributions Svcs. PLC Reg.Shares	STK	0	508.000
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC Reg.Shares	STK	0	88.933
JE00BJ1DLW90	Man Group PLC Reg.Shares	STK	0	950.910
GB00BD6GN030	Virgin Money UK PLC Reg.Shares	STK	0	1.224.733
<b>HKD</b>				
CNE1000002Q2	China Petroleum & Chemi. Corp. Reg.Shares H	STK	0	2.718.000
BMG684371393	Pacific Basin Shipping Ltd. Reg.Shares	STK	0	10.767.000
CNE1000003W8	PetroChina Co. Ltd. Reg.Shares H	STK	0	2.234.000
BMG988031446	Yue Yuen Indust.(Hldgs) Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.459.000
<b>JPY</b>				
JP3108600002	ACOM Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	562.700
JP3122800000	AMADA Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	267.200
JP3243600008	Canon Marketing Japan Inc. Reg.Shares	STK	0	71.300
JP3298000005	Cosmo Energy Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	59.600
JP3805010000	Fukuoka Financial Group Reg.Shares	STK	0	82.700
JP3768600003	Haseko Corp. Reg.Shares	STK	0	173.800
JP3735000006	JEOL Ltd. Reg.Shares	STK	0	52.300
JP3224200000	Kawasaki Heavy Industries Ltd. Reg.Shares	STK	90.300	90.300
JP3899800001	Mitsubishi Motors Corp. Reg.Shares	STK	0	458.600

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
JP3738600000	Niterra Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	90.000
JP3684000007	Nitto Denko Corp. Reg.Shares	STK	0	34.100
JP3164720009	Renesas Electronics Corp. Reg.Shares	STK	0	211.800
JP3973400009	Ricoh Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	175.000
JP3326000001	Sankyu Inc. Reg.Shares	STK	0	68.800
JP3436120004	SBI Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	108.200
JP3494600004	SCREEN Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	30.400
JP3414750004	Seiko Epson Corp. Reg.Shares	STK	0	98.900
JP3415400005	Seino Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	264.500
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares	STK	0	72.800
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	74.500	74.500
JP3443600006	Taisei Corp. Reg.Shares	STK	0	69.400
JP3595200001	Tosoh Corp. Reg.Shares	STK	0	162.300
<b>KRW</b>				
KR7047040001	DAEWOO Engin. & Constr. Co.Ltd Reg.Shares	STK	0	223.669
KR7011780004	Kumho Petro Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	9.803
KR7108320003	LX Semicon Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	10.777
KR7028670008	Pan Ocean Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	230.690
KR7005930003	Samsung Electronics Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	22.682
KR7055550008	Shinhan Financial Group Co.Ltd Reg.Shares	STK	0	40.602
<b>MYR</b>				
MYL518300008	Petronas Chemicals Group Bhd Reg.Shares	STK	0	578.900
<b>NZD</b>				
NZFBUE000150	Fletcher Building Ltd. Reg.Shares	STK	0	550.129
<b>SEK</b>				
SE0000190126	Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria)	STK	0	113.273
SE0015811963	Investor AB Namn-Aktier B (fria)	STK	0	149.341
SE0000163594	Securitas AB Namn-Aktier B	STK	0	268.097
SE0000242455	Swedbank AB Namn-Aktier A	STK	0	223.309
SE0000872095	Swedish Orphan Biovitrum AB Namn-Aktier	STK	0	151.217
<b>TRY</b>				
TRAAKBNK91N6	Akbank T.A.S. Inhaber-Aktien	STK	0	1.031.886
TREBIMM00018	BIM Birlesik Magazalar A.S. Inhaber-Aktien	STK	0	140.687
TRAKRDMR91G7	Kardemir Karabuk Demir San. Ti Namens-Aktien D	STK	0	1.257.814
TRATCELL91M1	Turkcell Iletisim Hizmetl. AS Namens-Aktien	STK	0	880.011
<b>TWD</b>				
TW0002303005	United Microelectronics Corp. Reg.Shares	STK	0	789.000
<b>USD</b>				
US02005N1000	Ally Financial Inc. Reg.Shares	STK	0	19.400
US06417N1037	Bank OZK Reg.Shares	STK	17.200	17.200
US1508701034	Celanese Corp. (Del.) Reg.Shares	STK	0	6.132
US2003401070	Comerica Inc. Reg.Shares	STK	0	9.500
US25179M1036	Devon Energy Corp. Reg.Shares	STK	0	10.333
US25278X1090	Diamondback Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	5.500
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares	STK	0	7.400
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares	STK	0	14.100
SG9999000020	Flex Ltd. Reg.Shares	STK	0	50.100
US3989051095	Group 1 Automotive Inc. Reg.Shares	STK	0	4.100
US4131971040	Harmony Biosciences Hldgs Inc. Reg.Shares	STK	19.300	19.300
US4039491000	HF Sinclair Corp. Reg.Shares	STK	4.800	18.700
US4470111075	Huntsman Corp. Reg.Shares	STK	0	24.800
US5012421013	Kulicke & Soffa Inds Inc. Reg.Shares	STK	0	14.200
US5463471053	Louisiana Pacific Corp. Reg.Shares	STK	0	12.000
CA5753851099	Masonite International Corp. Reg.Shares	STK	0	65.900
PR7331747001	Popular Inc. Reg.Shares New	STK	0	10.000
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares	STK	0	18.000
US6936561009	PVH Corp. Reg.Shares	STK	0	11.600
US78454L1008	SM Energy Co. Reg.Shares	STK	0	21.700
US8606301021	Stifel Financial Corp. Reg.Shares	STK	13.000	13.000
US8760301072	Tapestry Inc. Reg.Shares	STK	0	22.700
GB00BDSFG982	TechnipFMC PLC Reg.Shares	STK	0	108.300
US1638511089	The Chemours Co. Reg.Shares	STK	0	29.200
US8851601018	Thor Industries Inc. Reg.Shares	STK	0	10.000
US9576381092	Western Alliance Bancorp. Reg.Shares	STK	0	10.700
US9633201069	Whirlpool Corp. Reg.Shares	STK	0	4.300
US48123V1026	Ziff Davis Inc. Reg.Shares	STK	0	8.600
<b>Andere Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES06670509M2	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Anrechte	STK	71.726	71.726

## Gattungsbezeichnung

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

## Devisentermingeschäfte

## Devisenterminkontrakte (Kauf)

## Kauf von Devisen auf Termin:

HKD/EUR

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

EUR

Volumen in 1.000

1.382

# LINGOHR-SYSTEMATIC-INVEST

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	4.672.476
Anteilwert	EUR	121,92

### Angaben zu Bewertungsverfahren

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

#### Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

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

#### Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

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

#### Investmentanteile

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

#### Derivate

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

#### Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

#### Sonstiges

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

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

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

---

Frankfurt am Main, den 3. Juli 2023  
Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

16.09.1988

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 22,4 Mio.

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Serge Demolière, Berlin

Wolfgang Dürr, Trier

Carmen Lehr, Heilenbach

Victor Moftakhar, Bad Nauheim

### Geschäftsführung

Dirk Degenhardt (Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der bevestor GmbH,  
Frankfurt am Main

Dirk Heuser

Thomas Ketter

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

Thomas Schneider

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

### Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 2023

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



**Deka Vermögens-  
management GmbH**

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

Telefon: (0 69) 71 47 - 85 00  
Telefax: (0 69) 71 47 - 86 50  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

 **Finanzgruppe**