

Jahresbericht
zum 28. Februar 2023.

**Deka MSCI EUR Corporates
Climate Change ESG UCITS
ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

.Deka
Investments

Lizenzvermerk

Der Fonds, auf den an dieser Stelle Bezug genommen wird, wird von MSCI weder gefördert, unterstützt noch beworben. MSCI übernimmt keine Haftung für jegliche Fonds oder Indizes, die diesen Fonds zugrunde liegen. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

Bericht der Geschäftsführung.

28. Februar 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2022 bis zum 28. Februar 2023.

Die mit dem Einmarsch Russlands in die Ukraine erfolgte jähe Zäsur bildete im Berichtszeitraum das beherrschende Thema und verursachte auch an den Kapitalmärkten Turbulenzen. Die als Reaktion auf den Angriffskrieg initiierten Sanktionsmaßnahmen des Westens gegen den russischen Aggressor setzten eine Vergeltungsspirale in Gang, in deren Folge Russland u.a. die Lieferung von Gas an verschiedene europäische Länder massiv beschränkte und zahlreiche ausländische Unternehmen ihre dortigen Geschäftstätigkeiten einstellen mussten. Signifikante Preissteigerungen sowie Befürchtungen vor Versorgungsengpässen sorgten phasenweise für große Verunsicherung, insbesondere in Europa. Während die Pandemie und ihre Auswirkungen an den Finanzmärkten weltweit zusehends in den Hintergrund rückten, führte die Null-Covid-Politik in China mit damit einhergehenden Lockdown-Maßnahmen zu wiederholten Beeinträchtigungen im internationalen Handel, ehe im Dezember die Staatsführung einen abrupten Wechsel in der Pandemiepolitik vollzog.

In der Geld- und Fiskalpolitik rückte im Laufe des Berichtszeitraums die dynamische 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 bei einem Leitzinsintervall von 4,50 bis 4,75 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen ab Juli 2022 auf 3,00 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in Aussicht gestellt. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo merklich an. Ende Februar 2023 rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,7 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. Bis September überwogen hierbei die negativen Vorzeichen, ehe in der zweiten Berichtshälfte eine kräftige Gegenbewegung einsetzte. Stark unter Druck geriet zeitweise der Euro, der vorübergehend unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, sich jedoch ab November wieder spürbar erholte. Nach deutlichen Zugewinnen im ersten Quartal begab sich der Ölpreis ab Sommer auf Talfahrt und tendierte zuletzt unter 85 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 wichtige Informationen an die Anteilhaber im Internet unter www.deka-etf.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023	15
Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023	16
Anhang	22
Ökologische und/oder soziale Merkmale	24
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	42
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	44

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

Jahresbericht 01.03.2022 bis 28.02.2023

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Tätigkeitsbericht.

Der Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für den Fonds vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select (Preisindex) nachzubilden. Der MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select umfasst in Euro lautende Unternehmensanleihen von großen und mittelgroßen Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Europa haben. Dieser Index berücksichtigt hierbei ökologische (Environment – „E“), soziale (Social – „S“) und die verantwortungsvolle Unternehmens- bzw. Staatsführung (Governance – „G“) betreffende Kriterien (sog. ESG-Kriterien) mit besonderem Schwerpunkt. Bei dem Fonds handelt es sich daher um ein Finanzprodukt im Sinne des Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung).

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

Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrundeliegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt. Grundlage hierfür ist, dass die Entscheidungen über den Erwerb oder die Veräußerung von Vermögensgegenständen sowie über deren Gewichtung im Sondervermögen von dem zugrundeliegenden Index abhängig sind (passives Management).

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren im Wesentlichen aus Transaktionen mit Anleihen aufgrund von Indexanpassungen und Rücknahme von Anteilscheinen.

Adressenausfallrisiken

Für das Investmentvermögen bestanden Ausfallrisiken der Emittenten der im Fonds enthaltenen Schuldverschreibungen. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Emittentenrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des Index. Die geringen Abweichungen in dem Emittentenrisikoexposition zwischen Investmentvermögen und Index im Berichtszeitraum waren u.a. durch den Kassenbestand zu erklären. Im Berichtszeitraum entstand dem Investmentvermögen kein Verlust durch einen Adressenausfall.

Wichtige Kennzahlen

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	seit Auflegung p.a.
Performance*	-10,79%	-	-14,87%
ISIN	DE000ETF1599		

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

Währungsrisiken

Da die Fondswährung auf Euro lautet und das Investmentvermögen im Berichtszeitraum gemäß den Indexvorgaben ausschließlich in Euro-Wertpapiere investiert war, bestand für den Anleger aus der Eurozone kein Währungsrisiko.

Sonstige Marktpreisrisiken

Das Investmentvermögen unterlag im Berichtszeitraum dem Marktpreisrisiko der im Investmentvermögen gehaltenen Schuldverschreibungen. Deren Kursentwicklung wird u.a. durch das Marktzinsniveau sowie die Markteinschätzung zur Emittentenbonität beeinflusst. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Marktpreisrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select (Preisindex). Die geringen Abweichungen in dem Marktpreisexposition zwischen Investmentvermögen und Index im Berichtszeitraum waren u.a. durch den Kassenbestand zu erklären. Die modifizierte Duration des Investmentvermögens betrug zum Stichtag 4,90 Prozent.

Operationelle Risiken

Das Management von operationellen Risiken für das Investmentvermögen erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Deka Investment GmbH ist methodisch und prozessual in das in der Deka-Gruppe implementierte System zum Management und Controlling operationeller Risiken eingebunden. In diesem Rahmen werden regelmäßig die operationellen Risiken der für das Investmentvermögen relevanten Prozesse identifiziert, bewertet und überwacht. Instrumente hierfür sind u.a. das dezentrale Self Assessment, Szenarioanalysen sowie eine konzernweite Schadensfalldatenbank. Außerdem werden wesentliche Auslagerungen, insbesondere die konzernexterne Auslagerung der Fondsbuchhaltung an die BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland, im Rahmen eines Auslagerungscontrollings überwacht. Im Berichtszeitraum entstand dem Investmentvermögen kein Schaden aus operationellen Risiken.

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Liquiditätsrisiken

Aufgrund der passiven Abbildung eines Index, dessen Regelwerk liquiditätsrelevante Anforderungen an die Indexkonstituenten (u.a. Mindestemissionsvolumen) stellt sowie die Investition in Wertpapiere gemäß § 193 KAGB, wird das Liquiditätsrisiko grundsätzlich als gering eingestuft.

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FR00140007B4	0.010000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Preferred MTN 2020(26) 20260127
Löschung	XS2052503872	0.010000 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2019(24) 20240915
Löschung	XS2020568734	0.050000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240630
Löschung	FR0013460417	0.125000 % Arkéa Public Sector SCF EO-M.T.Obl.Fonc.Pu.S.19(30) 20300114
Löschung	ES0413860745	0.125000 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2020(28) 20280209
Löschung	FR0013444544	0.125000 % Dassault Systemes SE EO-Notes 2019(19/26) 20260915
Löschung	FR0013463650	0.125000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/25) 20250526
Löschung	XS2051659915	0.125000 % LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Bonds 2019(23) 20230912
Löschung	XS2241090088	0.125000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/24) 20241004
Löschung	XS2051032444	0.125000 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred M.-T.Nts 2019(26) 20260910
Löschung	XS2033351995	0.125000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2019(25) 20250724
Löschung	XS2104915033	0.190000 % National Grid Electr.Trans.PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/25) 20250119
Löschung	XS2018636600	0.250000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2019(19/25) 20250625
Löschung	FR0013453040	0.250000 % Alstom S.A. EO-Notes 2019(19/26) 20261013
Löschung	XS2084510069	0.250000 % Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2019(2023/2023) 20231128
Löschung	XS2384734542	0.250000 % NIBC Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260908
Löschung	XS2035620710	0.250000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270801
Löschung	XS2182055181	0.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(24) 20240604
Löschung	XS2406010285	0.250000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Pref. Med.-T.Nts 2021(26) 20261108
Löschung	XS2404027935	0.250000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 21(26) 20261101
Löschung	XS2324836878	0.250000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2021(21/28) 20280329
Löschung	XS2187525949	0.375000 % Alliander N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300609
Löschung	XS2102931594	0.375000 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250202
Löschung	FR0013463668	0.375000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20271126
Löschung	DE000LB2CHW4	0.375000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 806 v.19(24) 20240523
Löschung	DE000LB2CRG6	0.375000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 816 v.20(27) 20270217
Löschung	FR0013482841	0.375000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/31) 20310210
Löschung	XS2021471433	0.375000 % Motability Operations Grp PLC EO-Medium-Term Notes 2019(26) 20260102
Löschung	XS2084050637	0.375000 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-Preff. Med.-T.Nts 2019(25) 20250225
Löschung	XS2103013210	0.375000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28) 20280723
Löschung	XS2115094737	0.375000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTNs 2020(27) 20270210
Löschung	DE000A28RSR6	0.500000 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 20(30/31) 20310113
Löschung	XS2394063437	0.500000 % Brenntag Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20291005
Löschung	XS2051494222	0.500000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/25) 20250911
Löschung	XS2400445289	0.500000 % Dell Bank International DAC EO-MTN 2021(21/26) Reg.S 20261026
Löschung	XS2047479469	0.500000 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anleihe v.2019(2026/2027) 20270125
Löschung	XS2010044209	0.500000 % Schlumberger Finance B.V. EO-Notes 2019(19/31) 20311014
Löschung	XS2023872174	0.625000 % Aroundtown SA EO-Med.-Term Notes 2019(19/25) 20250708
Löschung	XS2055758804	0.625000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240930
Löschung	XS2100663579	0.625000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/25) 20250714
Löschung	XS2084497705	0.625000 % Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2019(2026/2026) 20261129
Löschung	XS2078737215	0.625000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTNs 2019(29) 20291111
Löschung	FR0014007Q96	0.750000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Nts 2022(30) 20300117

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FR0013463676	0.750000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/31) 20311126
Löschung	DK0009526998	0.750000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2020(27) 20270119
Löschung	XS2177013500	0.750000 % Reckitt Benck. Treas. Ser.(NL)BV EO-Notes 2020(20/30) 144A 20300518
Löschung	XS2170736180	0.750000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2020(20/28) 20280525
Löschung	XS2442768227	0.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270808
Löschung	XS2167002521	0.750000 % Swedbank AB EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250504
Löschung	DE000A2RWAX4	0.875000 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 19(25/26) 20260114
Löschung	FR0014009GQ8	0.875000 % Arkéa Public Sector SCF EO-M.T.Obl.Fonc.Pu.S.22(28) 20280330
Löschung	BE6325493268	0.875000 % Cofinimmo S.A. EO-Bonds 2020(20/30) 20301201
Löschung	FR0013511227	0.875000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Notes 2020(27) 20270506
Löschung	XS2243299463	0.875000 % H. Lundbeck A/S EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20271013
Löschung	XS2023631489	0.875000 % NIBC Bank N.V. EO-Preferred MTN 2019(25) 20250707
Löschung	XS2126162069	0.875000 % RELX Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320309
Löschung	XS1986416268	0.875000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2019(19/27) 20270428
Löschung	FR0013534500	0.875000 % Teréga S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300916
Löschung	XS2438026440	0.875000 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2022(22/28) 20280130
Löschung	XS2002017361	0.900000 % Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2019(26) 20261123
Löschung	XS2384716994	0.950000 % DXC Capital Funding DAC EO-Notes 2021(21/31) 144A 20310914
Löschung	FR0014006G24	1.000000 % Atos SE EO-Obl. 2021(21/29) 20291111
Löschung	XS2081018629	1.000000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(26) 20261118
Löschung	XS2446844594	1.000000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(29/30) 20300224
Löschung	XS2341269970	1.125000 % Aker BP ASA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290511
Löschung	XS2051494495	1.125000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/29) 20290911
Löschung	ES0213307061	1.125000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred Bonos 19(26) 20261111
Löschung	FR0013421369	1.125000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290522
Löschung	XS2050448336	1.125000 % Fastighets AB Balder EO-Medium-Term Notes 19(19/27) 20270128
Löschung	XS1974922442	1.125000 % Norsk Hydro ASA EO-Bonds 2019(19/25) 20250410
Löschung	XS2170736263	1.125000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2020(20/32) 20320525
Löschung	XS2068065163	1.250000 % Informa PLC EO-Medium-Term Nts 2019(19/28) 20280421
Löschung	FR0013403441	1.250000 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240214
Löschung	FR0013404571	1.375000 % Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2019(19/31) 20310220
Löschung	XS2013574038	1.375000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(26) 20260618
Löschung	FR0013397320	1.375000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Preferred Med.-T.Nts 19(25) 20250116
Löschung	BE0002629104	1.375000 % Elia Transm. Belgium S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/26) 20260113
Löschung	FR0013535150	1.375000 % Icade Sante SAS EO-Obl. 2020(20/30) 20300916
Löschung	XS2050543839	1.375000 % ITV PLC EO-Notes 2019(19/26) 20260925
Löschung	XS2166754957	1.375000 % Schlumberger Finance B.V. EO-Notes 2020(20/26) 20261027
Löschung	DE000A2RWAY2	1.500000 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 19(29/30) 20300114
Löschung	XS2100664114	1.500000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/30) 20300314
Löschung	FR0013396876	1.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2019(19/28) 20280114
Löschung	XS1986416698	1.500000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2019(19/31) 20310428
Löschung	XS2156598281	1.625000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30) 20300413

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FR0013507852	1.625000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/26) 20260414
Löschung	XS2193734733	1.625000 % Dell Bank International DAC EO-Notes 2020(20/24) 20240623
Löschung	XS2126170161	1.625000 % Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320421
Löschung	FR0013397452	1.625000 % VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2019(19/29) 20290117
Löschung	XS2002018500	1.625000 % Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2019(30) 20301123
Löschung	XS2022424993	1.750000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(29) 20290703
Löschung	XS2478690931	1.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 2022(26) 20261110
Löschung	FR0013410818	1.750000 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 20290321
Löschung	FR0013453974	1.875000 % Altarea S.C.A. EO-Bonds 2019(19/28) 20280116
Löschung	XS1936208252	1.875000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2019(2024/2025) 20250214
Löschung	FR0013507860	2.000000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/29) 20290414
Löschung	XS1978668298	2.000000 % NIBC Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240408
Löschung	XS2128498636	2.000000 % Signify N.V. EO-Notes 2020(20/24) 20240510
Löschung	XS2056491587	2.124000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2019(30) 20300930
Löschung	XS2240507801	2.125000 % Informa PLC EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20251005
Löschung	XS1933820372	2.125000 % ING Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(26) 20260109
Löschung	XS1936805776	2.375000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240131
Löschung	FR0014009E07	2.375000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/29) 20291029
Löschung	FR0013399060	2.625000 % ELO S.A. EO-Med.-T. Nts 2019(19/24) 20240129
Löschung	XS2156583259	2.625000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300414
Löschung	XS1936208419	2.875000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2019(2028/2029) 20290214
Löschung	XS2491664137	4.000000 % Eurofins Scientific S.E. EO-Bonds 2022(22/29) 20290705
Löschung	XS2545759099	5.250000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(30) 20300112
Neuaufnahme	FR00140007B4	0.010000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Preferred MTN 2020(26) 20260127
Neuaufnahme	XS2303089697	0.010000 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred MTN 2021(28) 20280217
Neuaufnahme	DE000A2GSR47	0.010000 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen Inh.-Schv. v.2020(2027) 20270506
Neuaufnahme	XS2020568734	0.050000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240630
Neuaufnahme	ES0413860745	0.125000 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2020(28) 20280209
Neuaufnahme	FR0013444544	0.125000 % Dassault Systemes SE EO-Notes 2019(19/26) 20260915
Neuaufnahme	FR0013482833	0.125000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) 20280210
Neuaufnahme	XS2176715584	0.125000 % SAP SE Inh.-Schuldv.v.2020(2026/2026) 20260517
Neuaufnahme	FR0013486701	0.125000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26) 20260223
Neuaufnahme	XS2104915033	0.190000 % National Grid Electr.Trans.PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/25) 20250119
Neuaufnahme	XS2035620710	0.250000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270801
Neuaufnahme	XS2182055181	0.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(24) 20240604
Neuaufnahme	XS2406010285	0.250000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Pref. Med.-T.Nts 2021(26) 20261108
Neuaufnahme	XS2347663507	0.375000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290602
Neuaufnahme	DE000BHY0GNO	0.375000 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv. v.22(27) 20270124
Neuaufnahme	XS2102931594	0.375000 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250202
Neuaufnahme	FR0013482841	0.375000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/31) 20310210
Neuaufnahme	DK0030484548	0.375000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280116
Neuaufnahme	XS2176715667	0.375000 % SAP SE Inh.-Schuldv.v.2020(2029/2029) 20290517

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	XS2237901355	0.375000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2020(30/30) 20300924
Neuaufnahme	DE000A28RSR6	0.500000 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 20(30/31) 20310113
Neuaufnahme	FR0014006CS9	0.500000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2021(21/30) 20300210
Neuaufnahme	XS2394063437	0.500000 % Brenntag Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20291005
Neuaufnahme	XS2400445289	0.500000 % Dell Bank International DAC EO-MTN 2021(21/26) Reg.S 20261026
Neuaufnahme	XS2325565104	0.500000 % Fresenius Finance Ireland PLC EO-Med.-Term Nts 2021(28/28) 20280930
Neuaufnahme	XS2010044209	0.500000 % Schlumberger Finance B.V. EO-Notes 2019(19/31) 20311014
Neuaufnahme	XS2320453884	0.500000 % UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31) 20310321
Neuaufnahme	XS2055758804	0.625000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240930
Neuaufnahme	XS2078737215	0.625000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTNs 2019(29) 20291111
Neuaufnahme	FR0014007Q96	0.750000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Nts 2022(30) 20300117
Neuaufnahme	FR0013463676	0.750000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/31) 20311126
Neuaufnahme	XS2317069685	0.750000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(28) 20280315
Neuaufnahme	XS2441244535	0.750000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/25) 20250330
Neuaufnahme	XS2442768227	0.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270808
Neuaufnahme	XS2163320679	0.750000 % Sodexo S.A. EO-Notes 2020(20/25) 20250426
Neuaufnahme	FR0014009GQ8	0.875000 % Arkéa Public Sector SCF EO-M.T.Obl.Fonc.Pu.S.22(28) 20280330
Neuaufnahme	BE6325493268	0.875000 % Cofinimmo S.A. EO-Bonds 2020(20/30) 20301201
Neuaufnahme	FR0014009EJ8	0.875000 % LOréal S.A. EO-Notes 2022(22/26) 20260628
Neuaufnahme	XS2023631489	0.875000 % NIBC Bank N.V. EO-Preferred MTN 2019(25) 20250707
Neuaufnahme	XS2126162069	0.875000 % RELX Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320309
Neuaufnahme	XS2438026440	0.875000 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2022(22/28) 20280130
Neuaufnahme	FR0014006G24	1.000000 % Atos SE EO-Obl. 2021(21/29) 20291111
Neuaufnahme	XS2432565005	1.000000 % Balder Finland Oyj EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270117
Neuaufnahme	BE0002838192	1.000000 % Cofinimmo S.A. EO-Bonds 2022(22/28) 20280123
Neuaufnahme	XS2232115423	1.000000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320114
Neuaufnahme	XS2446844594	1.000000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(29/30) 20300224
Neuaufnahme	XS2163333656	1.000000 % Sodexo S.A. EO-Notes 2020(20/29) 20290426
Neuaufnahme	XS2171713006	1.113000 % Eurogrid GmbH MTN v.2020(2020/2032) 20320514
Neuaufnahme	XS2341269970	1.125000 % Aker BP ASA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290511
Neuaufnahme	ES0213307061	1.125000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred Bonos 19(26) 20261111
Neuaufnahme	XS2170736263	1.125000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2020(20/32) 20320525
Neuaufnahme	XS2156787090	1.250000 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/25) 20250415
Neuaufnahme	XS2304664597	1.350000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31) 20310223
Neuaufnahme	XS2441247041	1.375000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/30) 20300330
Neuaufnahme	FR0014009L57	1.375000 % Pernod-Ricard S.A. EO-Notes 2022(22/29) 20290406
Neuaufnahme	XS2462466611	1.500000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28) 20280327
Neuaufnahme	XS2449928543	1.500000 % Vestas Wind Systems Finance BV EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290614
Neuaufnahme	XS2152329053	1.625000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2020(2027/2027) 20271007
Neuaufnahme	XS2126170161	1.625000 % Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320421
Neuaufnahme	XS2022424993	1.750000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(29) 20290703
Neuaufnahme	XS2478690931	1.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 2022(26) 20261110

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	FR0014009DZ6	1.875000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26) 20261029
Neuaufnahme	XS2482872418	1.875000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2025/2025) 20250523
Neuaufnahme	XS2461785185	2.000000 % Castellum Helsinki Fin.Hol.Abp EO-Medium-Term Nts 2022(22/25) 20250323
Neuaufnahme	FR0013512233	2.000000 % Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/29) 20290511
Neuaufnahme	XS2485152362	2.100000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270524
Neuaufnahme	XS2240507801	2.125000 % Informa PLC EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20251005
Neuaufnahme	XS2526839175	2.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20250309
Neuaufnahme	FR0013507878	2.375000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/32) 20320414
Neuaufnahme	FR0014009E07	2.375000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/29) 20291029
Neuaufnahme	XS2176562812	2.375000 % WPP Finance S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270518
Neuaufnahme	XS2484587048	2.592000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310524
Neuaufnahme	XS2531420730	2.625000 % Alliander N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270908
Neuaufnahme	XS2525157470	2.625000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27) 20270823
Neuaufnahme	XS2156583259	2.625000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300414
Neuaufnahme	DE000A3SJZT2	2.625000 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen Inh.-Schv. v.2023(2033) 20330125
Neuaufnahme	XS2496028502	2.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20270829
Neuaufnahme	XS2534276808	2.875000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Pref. Med.-T.Nts 2022(25) 20250919
Neuaufnahme	XS2555178644	3.000000 % adidas AG Anleihe v.2022(2022/2025) 20251120
Neuaufnahme	XS2528582377	3.000000 % Compass Group Fin. Netherl. BV EO-Medium-Term Nts 2022(22/30) 20300307
Neuaufnahme	XS2530756191	3.000000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2022(22/26) 20260922
Neuaufnahme	FR001400F703	3.125000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29) 20291012
Neuaufnahme	XS2536730448	3.125000 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251221
Neuaufnahme	XS2575555938	3.250000 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/27) 20270115
Neuaufnahme	FR0013524865	3.250000 % ELO S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(27/27) 20270722
Neuaufnahme	FR001400DT99	3.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20271108
Neuaufnahme	XS2489138789	3.250000 % Urenco Finance N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320612
Neuaufnahme	XS2527319979	3.279000 % Eurogrid GmbH MTN v.2022(2022/2031) 20310904
Neuaufnahme	XS2496028924	3.375000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320829
Neuaufnahme	FR001400DTA3	3.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20321108
Neuaufnahme	XS2560411543	3.625000 % Achmea B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20251128
Neuaufnahme	BE6340849569	3.625000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330117
Neuaufnahme	XS2537251170	3.750000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/30) 20301011
Neuaufnahme	XS2530034649	3.750000 % CaixaBank S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(29) 20290906
Neuaufnahme	XS2579319513	3.750000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20271122
Neuaufnahme	XS2555192710	3.750000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251113
Neuaufnahme	XS2491664137	4.000000 % Eurofins Scientific S.E. EO-Bonds 2022(22/29) 20290705
Neuaufnahme	XS2553798443	4.000000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26) 20261108
Neuaufnahme	XS2547609433	4.000000 % Talanx AG MTN v.2022(2029/2029) 20291024
Neuaufnahme	XS2545259876	4.500000 % Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20271017
Neuaufnahme	FR001400DNG3	4.625000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/32) 20320606
Neuaufnahme	FR001400DQ84	4.625000 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281102
Neuaufnahme	XS2545759099	5.250000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(30) 20300112

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS2171210862	0.375000	% Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25) 20250511	1,24
XS2156510021	1.000000	% Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250414	1,22
XS2579319513	3.750000	% Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20271122	1,21
FR0014000UC8	0.625000	% Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270503	1,20
XS2555192710	3.750000	% Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251113	1,18
FR0014000UD6	1.375000	% Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/31) 20311203	1,18
FR0013507878	2.375000	% Capgemini SE EO-Notes 2020(20/32) 20320414	1,17
XS2485152362	2.100000	% Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270524	1,16
FR0014009EJ8	0.875000	% LOréal S.A. EO-Notes 2022(22/26) 20260628	1,15
FR001400DQ84	4.625000	% Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281102	1,14
XS2282101539	0.125000	% Grand City Properties S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/28) 20280110	1,14
XS2121207828	0.500000	% Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2020(30) 20300217	1,14
FR0013510179	2.875000	% ELO S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/26) 20260128	1,13
FR0013506532	1.750000	% Pernod-Ricard S.A. EO-Bonds 2020(20/30) 20300407	1,13
XS2530034649	3.750000	% Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(29) 20290906	1,13
XS2484587048	2.592000	% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310524	1,13
FR001400DNG3	4.625000	% Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/32) 20320606	1,12
XS2179037697	2.125000	% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) 20250525	1,11
XS2553798443	4.000000	% Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26) 20261108	1,11
XS2537251170	3.750000	% AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/30) 20301011	1,10
FR0013486701	0.125000	% Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26) 20260223	1,10
FR0013505260	2.625000	% Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20271214	1,09
XS2442768227	0.750000	% Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270808	1,09
XS2527319979	3.279000	% Eurogrid GmbH MTN v.2022(2022/2031) 20310904	1,09
XS2317069685	0.750000	% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(28) 20280315	1,09
XS2482872418	1.875000	% Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2025/2025) 20250523	1,08
XS2280835260	0.625000	% Digital Intrepid Holding B.V. EO-Bonds 2021(21/31) Reg.S 20310714	1,08
XS2176562812	2.375000	% WPP Finance S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270518	1,07
FR0014009DZ6	1.875000	% Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26) 20261029	1,06
XS2163333656	1.000000	% Sodexo S.A. EO-Notes 2020(20/29) 20290426	1,05
FR0013524865	3.250000	% ELO S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(27/27) 20270722	1,05
DK0009529901	0.500000	% Nykredit Realkredit A/S EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250709	1,05
XS2175967343	1.500000	% Achmea B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(27/27) 20270525	1,03
XS2176715667	0.375000	% SAP SE Inh.-Schuld.v.2020(2029/2029) 20290517	1,01
XS2152329053	1.625000	% Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2020(2027/2027) 20271007	1,01
FR0013494168	0.250000	% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2020(20/29) 20290310	1,01
XS2240507801	2.125000	% Informa PLC EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20251005	1,01
XS2163320679	0.750000	% Sodexo S.A. EO-Notes 2020(20/25) 20250426	1,00
FR0014009L57	1.375000	% Pernod-Ricard S.A. EO-Notes 2022(22/29) 20290406	1,00
BE6321529396	0.875000	% Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300427	0,99
XS2347663507	0.375000	% AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290602	0,99
FR0014006CS9	0.500000	% Bouygues S.A. EO-Bonds 2021(21/30) 20300210	0,98
XS2332234413	0.125000	% SGS Nederland Holding B.V. EO-Medium-T.Notes 2021(21/27) 20270420	0,98
FR0013482833	0.125000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) 20280210	0,97
FR0013506508	0.750000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) 20250406	0,97
DK0030484548	0.375000	% Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280116	0,94

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS2147133578	1.750000 %	Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300324	0,93
XS2526839175	2.250000 %	Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20250309	0,93
XS2525157470	2.625000 %	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27) 20270823	0,93
XS2257961818	0.125000 %	UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) 20281118	0,93
FR0013482841	0.375000 %	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/31) 20310210	0,91
XS2341269970	1.125000 %	Aker BP ASA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290511	0,91
FR001400DTA3	3.500000 %	Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20321108	0,90
XS2171713006	1.113000 %	Eurogrid GmbH MTN v.2020(2020/2032) 20320514	0,90
XS2178769159	1.500000 %	Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2020(2030/2030) 20300528	0,89
FR001400F703	3.125000 %	Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29) 20291012	0,89
XS2496028502	2.750000 %	British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20270829	0,87
DE000A3SJTZ2	2.625000 %	Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen Inh.-Schv. v.2023(2033) 20330125	0,87
XS2156787090	1.250000 %	SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/25) 20250415	0,86
XS2304664597	1.350000 %	Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31) 20310223	0,85
XS2128499105	2.375000 %	Signify N.V. EO-Notes 2020(20/27) 20270510	0,84
XS2348030425	0.125000 %	Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Notes 2021(21/28) 20280603	0,83
FR0013515871	1.500000 %	Société Foncière Lyonnaise SA EO-Obl. 2020(20/27) 20270604	0,83
XS2232115423	1.000000 %	Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320114	0,82
FR0014004R72	0.500000 %	Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/30) 20300726	0,82
XS2176715584	0.125000 %	SAP SE Inh.-Schuld.v.2020(2026/2026) 20260517	0,82
XS2462466611	1.500000 %	Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28) 20280327	0,81
FR0013512233	2.000000 %	Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/29) 20290511	0,81
XS2547609433	4.000000 %	Talanx AG MTN v.2022(2029/2029) 20291024	0,76
XS2545259876	4.500000 %	Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20271017	0,75
XS2560411543	3.625000 %	Achmea B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20251128	0,75
FR001400DT99	3.250000 %	Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20271108	0,75
XS2575555938	3.250000 %	ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/27) 20270115	0,75
XS2555178644	3.000000 %	adidas AG Anleihe v.2022(2022/2025) 20251120	0,74
XS2530756191	3.000000 %	Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2022(22/26) 20260922	0,74
BE6340849569	3.625000 %	Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330117	0,74
XS2536730448	3.125000 %	SpareBank 1 SMN EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251221	0,74
XS2357205587	0.375000 %	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290622	0,74
XS2199604096	1.375000 %	UNIQA Insurance Group AG EO-Notes 2020(30/30) 20300708	0,74
XS2534276808	2.875000 %	Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Pref. Med.-T.Nts 2022(25) 20250919	0,74
XS2531420730	2.625000 %	Alliander N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270908	0,73
XS2317288301	0.375000 %	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2021(21/30) Reg.S 20300317	0,72
XS2528582377	3.000000 %	Compass Group Fin. Netherl. BV EO-Medium-Term Nts 2022(22/30) 20300307	0,72
XS2441244535	0.750000 %	Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/25) 20250330	0,72
XS2232027727	1.625000 %	KION GROUP AG Med.Term.Notes v.20(20/25) 20250923	0,71
XS2496028924	3.375000 %	British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320829	0,71
XS2461785185	2.000000 %	Castellum Helsinki Fin.Hol.Abp EO-Medium-Term Nts 2022(22/25) 20250323	0,70
XS2150015555	1.750000 %	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2020(20/27) 20270401	0,70
XS2489138789	3.250000 %	Urenco Finance N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320612	0,70
DE000A289NX4	0.625000 %	Evonik Industries AG Medium Term Notes v.20(20/25) 20250917	0,70
XS2411166973	0.875000 %	NN Group N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31) 20311122	0,70
XS2126169742	1.000000 %	Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/27) 20270421	0,68

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
DE000BHY0GNO	0.375000 %	Berlin Hyp AG Inh.-Schv. v.22(27) 20270124	0,67
DE000A2GSR47	0.010000 %	Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen Inh.-Schv. v.2020(2027) 20270506	0,66
XS2400445289	0.500000 %	Dell Bank International DAC EO-MTN 2021(21/26) Reg.S 20261026	0,66
XS2441247041	1.375000 %	Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/30) 20300330	0,66
FR0014004QX4	0.125000 %	Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/27) 20270726	0,66
XS2449928543	1.500000 %	Vestas Wind Systems Finance BV EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290614	0,65
FR0013519279	1.625000 %	Covivio S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300622	0,65
BE0002838192	1.000000 %	Cofinimmo S.A. EO-Bonds 2022(22/28) 20280123	0,63
XS2388449758	0.500000 %	Nationale-Niederlanden Bank NV EO-Medium-Term Notes 2021(28) 20280920	0,62
XS2386592484	0.125000 %	Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2021(21/28) 20280920	0,62
XS2303089697	0.010000 %	SpareBank 1 SMN EO-Preferred MTN 2021(28) 20280217	0,62
XS2198580271	0.750000 %	Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2020(20/30) 20300702	0,61
XS2325565104	0.500000 %	Fresenius Finance Ireland PLC EO-Med.-Term Nts 2021(28/28) 20280930	0,61
XS2432565005	1.000000 %	Balder Finland Oyj EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270117	0,60
XS2265360359	0.625000 %	Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20301201	0,60
XS2351301499	0.750000 %	ACEF Holding S.C.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28) 20280613	0,59
XS2237901355	0.375000 %	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2020(30/30) 20300924	0,59
XS2303070911	0.250000 %	H&M Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290824	0,59
XS2320453884	0.500000 %	UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31) 20310321	0,58
XS2386592567	0.500000 %	Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2021(21/31) 20310920	0,57
XS2401704189	1.250000 %	ACEF Holding S.C.A. EO-Notes 2021(21/30) 20300425	0,56
XS2325562697	0.875000 %	Fresenius Finance Ireland PLC EO-Med.-Term Nts 2021(31/31) 20310930	0,55

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		328.389.147,05	100,01
1. Anleihen		325.753.553,23	99,21
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	64.019.221,23		19,50
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	101.584.220,07		30,94
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	68.158.146,83		20,76
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	91.991.965,10		28,02
2. Forderungen		2.887.750,96	0,88
3. Bankguthaben		-252.157,14	-0,08
II. Verbindlichkeiten		-47.971,70	-0,01
III. Fondsvermögen		328.341.175,35	100,00

¹⁾ Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
XS2555178644	3,0000 % adidas AG - Anleihe 2022/2025	EUR		2.500	2.500	0	% 97,689	2.442.225,00	0,74
DE000BHYOGN0	0,3750 % Berlin Hyp AG - Inhaberschuldverschreibung 2022/2027	EUR		2.500	2.600	100	% 87,705	2.192.625,00	0,67
XS2171713006	1,1130 % Eurogrid GmbH - Anleihe 2020/2032	EUR		3.700	4.000	300	% 78,701	2.911.937,00	0,89
XS2527319979	3,2790 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2022/2031	EUR		3.700	3.700	0	% 95,447	3.531.539,00	1,08
DE000A289NX4	0,6250 % Evonik Industries AG - Medium Term Notes 2020/2025	EUR		2.500	2.000	300	% 91,884	2.297.100,00	0,70
XS2178769159	1,5000 % Fresenius Medical Care KGaA - Medium Term Notes 2020/2030	EUR		3.713	3.078	583	% 78,319	2.907.984,47	0,89
XS2152329053	1,6250 % Fresenius SE & Co. KGaA - Anleihe 2020/2027	EUR		3.713	3.826	113	% 88,676	3.292.539,88	1,00
XS2482872418	1,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA - Anleihe 2022/2025	EUR		3.683	3.796	113	% 95,125	3.503.453,75	1,07
XS2232027727	1,6250 % KION GROUP AG - Medium Term Notes 2020/2025	EUR		2.500	2.000	300	% 93,714	2.342.850,00	0,71
XS2171210862	0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Anleihe 2020/2025	EUR		4.400	5.200	3.200	% 92,107	4.052.708,00	1,23
XS2525157470	2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term IHS 2022/2027	EUR		3.200	3.300	100	% 93,721	2.999.072,00	0,91
XS2176715584	0,1250 % SAP SE - Anleihe 2020/2026	EUR		3.000	3.200	200	% 89,862	2.695.860,00	0,82
XS2176715667	0,3750 % SAP SE - Anleihe 2020/2029	EUR		4.000	4.400	400	% 83,159	3.326.360,00	1,01
XS2547609433	4,0000 % Talanx AG - Medium Term Notes 2022/2029	EUR		2.500	2.500	0	% 99,615	2.490.375,00	0,76
DE000A2GSR47	0,0100 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen - Inhaberschuldverschreibung 2020/2027	EUR		2.500	2.600	100	% 86,958	2.173.950,00	0,66
DE000A3SJZT2	2,6250 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen - Inhaberschuldverschreibung 2023/2033	EUR		3.000	3.000	0	% 94,745	2.842.350,00	0,87
							EUR	46.002.929,10	14,01
Ausland									
XS2575555938	3,2500 % ABB Finance B.V. - Medium Term Notes 2023/2027	EUR		2.519	2.519	0	% 98,541	2.482.247,79	0,76
XS2351301499	0,7500 % ACEF Holding S.C.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR		2.451	1.917	316	% 78,093	1.914.059,43	0,58
XS2401704189	1,2500 % ACEF Holding S.C.A. - EO-Notes 2021/2030	EUR		2.451	2.028	416	% 73,323	1.797.146,73	0,55
XS2175967343	1,5000 % Achmea B.V. - Medium Term Notes 2020/2027	EUR		3.713	3.028	533	% 90,670	3.366.577,10	1,03
XS2560411543	3,6250 % Achmea B.V. - Medium Term Notes 2022/2025	EUR		2.519	2.519	0	% 98,855	2.490.157,45	0,76
XS2386592484	0,1250 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR		2.451	2.028	416	% 80,966	1.984.476,66	0,60
XS2386592567	0,5000 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. - Medium Term Notes 2021/2031	EUR		2.451	2.028	416	% 75,218	1.843.593,18	0,56
XS2317288301	0,3750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. - Senior Notes 2021/2030	EUR		2.983	2.601	593	% 79,187	2.362.148,21	0,72
XS2150015555	1,7500 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. - Senior Notes 2020/2027	EUR		2.451	1.917	316	% 92,344	2.263.351,44	0,69
XS2341269970	1,1250 % Aker BP ASA - Medium Term Notes 2021/2029	EUR		3.618	4.519	2.119	% 81,674	2.954.965,32	0,90
XS2462466611	1,5000 % Akzo Nobel N.V. - Anleihe 2022/2028	EUR		2.983	3.428	445	% 88,847	2.650.306,01	0,81
XS2531420730	2,6250 % Alliander N.V. - Medium Term Notes 2022/2027	EUR		2.451	2.451	0	% 96,145	2.356.513,95	0,72
FR0014004QX4	0,1250 % Alstom S.A. - NTS (Notes) 2021/2027	EUR		2.500	2.000	300	% 86,439	2.160.975,00	0,66
FR0014004R72	0,5000 % Alstom S.A. - NTS (Notes) 2021/2030	EUR		3.500	3.100	700	% 77,038	2.696.330,00	0,82
XS2347663507	0,3750 % AstraZeneca PLC - Medium Term Notes 2021/2029	EUR		3.973	3.973	0	% 81,591	3.241.610,43	0,99
FR0013510179	2,8750 % Auchan Holding S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR		3.900	3.600	1.300	% 93,588	3.649.932,00	1,11
XS2537251170	3,7500 % AXA S.A. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR		3.582	3.582	0	% 100,106	3.585.796,92	1,09
XS2432565005	1,0000 % Balder Finland Oyj - Medium Term Notes 2022/2027	EUR		2.519	2.519	0	% 79,040	1.991.017,60	0,61
FR0014006CS9	0,5000 % Bouygues S.A. - Anleihe 2021/2030	EUR		4.000	4.500	500	% 80,450	3.218.000,00	0,98
FR001400DNG3	4,6250 % Bouygues S.A. - Bonds 2022/2032	EUR		3.500	3.500	0	% 103,705	3.629.675,00	1,11
XS2496028502	2,7500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2022/2027	EUR		2.921	2.921	0	% 94,865	2.771.006,65	0,84

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2496028924	3,3750 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	2.451	2.451	0	% 93,026	2.280.067,26	0,69
XS2530034649	3,7500 % CaixaBank S.A. - Medium Term Notes 2022/2029		EUR	3.800	3.800	0	% 97,525	3.705.950,00	1,13
FR0013507878	2,3750 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2032		EUR	4.300	5.700	1.400	% 88,047	3.786.021,00	1,15
FR0014009DZ6	1,8750 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2022/2026		EUR	3.700	3.700	0	% 93,087	3.444.219,00	1,05
FR0013505260	2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027		EUR	3.800	3.500	1.300	% 94,555	3.593.090,00	1,09
XS2461785185	2,0000 % Castellum Helsinki Fin.Hol.Abp - Anleihe 2022/2025		EUR	2.451	2.551	100	% 92,413	2.265.042,63	0,69
BE0002838192	1,0000 % Cofinimmo S.A. - Anleihe 2022/2028		EUR	2.500	2.700	200	% 83,318	2.082.950,00	0,63
XS2528582377	3,0000 % Compass Group Fin. Netherl. BV - Medium Term Notes 2022/2030		EUR	2.519	2.519	0	% 94,753	2.386.828,07	0,73
FR0013519279	1,6250 % Covivio S.A. - Obligations 2020/2030		EUR	2.500	2.000	300	% 84,998	2.124.950,00	0,65
XS2400445289	0,5000 % Dell Bank International DAC - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	2.519	3.421	1.741	% 86,949	2.190.245,31	0,67
XS2545259876	4,5000 % Dell Bank International DAC - Medium Term Notes 2022/2027		EUR	2.451	2.551	100	% 100,150	2.454.676,50	0,75
XS2232115423	1,0000 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2032		EUR	3.713	3.713	0	% 72,119	2.677.778,47	0,82
XS2280835260	0,6250 % Digital Intrepid Holding B.V. - Guaranteed Registered Notes 2021/2031		EUR	4.951	3.919	609	% 70,745	3.502.584,95	1,07
BE6321529396	0,8750 % Elia Transmission Belgium N.V. - Medium Term Notes 2020/2030		EUR	4.000	3.200	500	% 81,621	3.264.840,00	0,99
BE6340849569	3,6250 % Elia Transm. Belgium N.V. - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	2.500	2.500	0	% 97,108	2.427.700,00	0,74
FR0013524865	3,2500 % ELO S.A. - Anleihe 2020/2027		EUR	3.700	4.100	400	% 92,066	3.406.442,00	1,04
XS2325565104	0,5000 % Fresenius Finance Ireland PLC - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	2.476	2.542	66	% 80,065	1.982.409,40	0,60
XS2325562697	0,8750 % Fresenius Finance Ireland PLC - Medium Term Notes 2021/2031		EUR	2.476	2.053	389	% 71,920	1.780.739,20	0,54
XS2126169742	1,0000 % Givaudan Finance Europe B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2027		EUR	2.451	1.917	316	% 89,580	2.195.605,80	0,67
XS2282101539	0,1250 % Grand City Properties S.A. - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	5.000	4.000	600	% 75,024	3.751.200,00	1,14
XS2303070911	0,2500 % H&M Finance B.V. - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	2.451	1.917	316	% 77,124	1.890.309,24	0,58
XS2240507801	2,1250 % Informa PLC - Medium Term Notes 2020/2025		EUR	3.485	4.149	1.801	% 94,859	3.305.836,15	1,01
XS2317069685	0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	4.287	4.287	0	% 83,235	3.568.284,45	1,09
XS2304664597	1,3500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2031		EUR	3.729	3.729	0	% 74,255	2.768.968,95	0,84
XS2179037697	2,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2025		EUR	3.793	3.959	2.196	% 95,461	3.620.835,73	1,10
FR0013512233	2,0000 % Klépierre S.A. - Anleihe 2020/2029		EUR	3.000	3.200	200	% 88,169	2.645.070,00	0,81
FR0014009EJ8	0,8750 % L'Oréal S.A. - Anleihe 2022/2026		EUR	4.100	5.800	1.700	% 92,156	3.778.396,00	1,15
FR0013482833	0,1250 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2028		EUR	3.700	3.700	0	% 84,824	3.138.488,00	0,96
FR0013482841	0,3750 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Medium Term Notes 2020/2031		EUR	3.800	5.800	4.400	% 79,080	3.005.040,00	0,92
FR0013506508	0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2025		EUR	3.300	4.700	3.800	% 94,606	3.121.998,00	0,95
XS2388449758	0,5000 % Nationale-Nederlanden Bank NV - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	2.500	2.000	300	% 81,699	2.042.475,00	0,62
XS2411166973	0,8750 % NN Group N.V. - Medium Term Notes 2021/2031		EUR	2.983	2.589	593	% 76,491	2.281.726,53	0,69
XS2348030425	0,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Registered Notes 2021/2028		EUR	3.218	2.784	622	% 83,909	2.700.191,62	0,82
XS2441244535	0,7500 % Novo Nordisk Finance [Netherlands] B.V. - Anleihe 2022/2025		EUR	2.451	2.767	316	% 94,099	2.306.366,49	0,70
XS2441247041	1,3750 % Novo Nordisk Finance [Netherlands] B.V. - Anleihe 2022/2030		EUR	2.451	2.767	316	% 86,891	2.129.698,41	0,65
DK0030484548	0,3750 % Nykredit Realkredit A/S - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	3.713	3.713	0	% 82,183	3.051.454,79	0,93
DK0009529901	0,5000 % Nykredit Realkredit A/S - Medium Term Notes 2020/2025		EUR	3.713	3.028	533	% 91,611	3.401.516,43	1,04
FR0014009L57	1,3750 % Pernod-Ricard S.A. - Senior Notes 2022/2029		EUR	3.700	3.700	0	% 87,287	3.229.619,00	0,98
FR0013506532	1,7500 % Pernod-Ricard S.A. - Anleihe 2020/2030		EUR	4.200	3.700	1.100	% 87,747	3.685.374,00	1,12

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
FR0013494168	0,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2020/2029		EUR	4.000	3.200	500	% 83,035	3.321.400,00	1,01
FR001400F703	3,1250 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	3.000	3.000	0	% 97,535	2.926.050,00	0,89
FR001400DT99	3,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2022/2027		EUR	2.500	2.500	0	% 98,553	2.463.825,00	0,75
FR001400DTA3	3,5000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	3.000	3.000	0	% 98,929	2.967.870,00	0,90
XS2332234413	0,1250 % SGS Nederland Holding B.V. - Medium Term Notes 2021/2027		EUR	3.700	3.100	600	% 85,643	3.168.791,00	0,97
XS2526839175	2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	3.100	3.100	0	% 97,300	3.016.300,00	0,92
XS2128499105	2,3750 % Signify N.V. - Senior Notes 2020/2027		EUR	2.983	2.453	445	% 92,309	2.753.577,47	0,84
XS2442768227	0,7500 % Skandinaviska Enskilda Banken AB - Anleihe 2022/2027		EUR	4.044	7.326	3.282	% 86,560	3.500.486,40	1,07
XS2553798443	4,0000 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2022/2026		EUR	3.632	3.632	0	% 99,675	3.620.196,00	1,10
FR0013515871	1,5000 % Société Foncière Lyonnaise SA - Obligations 2020/2027		EUR	3.000	2.600	400	% 90,938	2.728.140,00	0,83
FR0013486701	0,1250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	4.000	5.600	1.600	% 89,190	3.567.600,00	1,09
XS2163320679	0,7500 % Sodexo S.A. - Senior Notes 2020/2025		EUR	3.467	3.467	0	% 94,122	3.263.209,74	0,99
XS2163333656	1,0000 % Sodexo S.A. - Senior Notes 2020/2029		EUR	4.011	4.011	0	% 86,456	3.467.750,16	1,06
XS2303089697	0,0100 % SpareBank 1 SMN - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	2.451	2.451	0	% 80,856	1.981.780,56	0,60
XS2534276808	2,8750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	2.451	2.451	0	% 96,630	2.368.401,30	0,72
XS2536730448	3,1250 % SpareBank 1 SMN - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	2.451	2.451	0	% 97,106	2.380.068,06	0,72
XS2579319513	3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Medium Term Notes 2023/2027		EUR	4.072	4.072	0	% 97,792	3.982.090,24	1,21
XS2156787090	1,2500 % SSE PLC - Anleihe 2020/2025		EUR	2.983	3.189	206	% 94,576	2.821.202,08	0,86
XS2265360359	0,6250 % Stora Enso Oyj - Anleihe 2020/2030		EUR	2.451	2.028	416	% 78,334	1.919.966,34	0,58
FR001400DQ84	4,6250 % Suez S.A. - Medium Term Notes 2022/2028		EUR	3.600	3.600	0	% 102,036	3.673.296,00	1,12
XS2121207828	0,5000 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2020/2030		EUR	4.747	3.835	728	% 77,884	3.697.153,48	1,13
XS2156510021	1,0000 % Svenska Handelsbanken AB - Anleihe 2020/2025		EUR	4.228	4.550	2.352	% 94,459	3.993.726,52	1,22
XS2485152362	2,1000 % Swedbank AB - Anleihe 2022/2027		EUR	4.121	4.929	808	% 92,750	3.822.227,50	1,16
XS2555192710	3,7500 % Swedbank AB - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	3.835	3.835	0	% 99,314	3.808.691,90	1,16
XS2484587048	2,5920 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2022/2031		EUR	4.000	4.800	800	% 91,344	3.653.760,00	1,11
XS2237901355	0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Anleihe 2020/2030		EUR	2.451	2.767	316	% 77,193	1.892.000,43	0,58
XS2357205587	0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	2.983	2.601	593	% 80,791	2.409.995,53	0,73
FR0014000UC8	0,6250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE - Medium Term Notes 2020/2027		EUR	4.500	3.800	900	% 86,012	3.870.540,00	1,18
FR0014000UD6	1,3750 % Unibail-Rodamco-Westfield SE - Medium Term Notes 2020/2031		EUR	4.900	3.900	600	% 77,405	3.792.845,00	1,16
XS2147133578	1,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. - Anleihe 2020/2030		EUR	3.421	3.283	1.502	% 88,653	3.032.819,13	0,92
XS2199604096	1,3750 % UNIQA Insurance Group AG - NTS (Notes) 2020/2030		EUR	3.000	2.400	400	% 80,683	2.420.490,00	0,74
XS2257961818	0,1250 % UPM Kymmene Corp. - Medium Term Notes 2020/2028		EUR	3.713	3.136	641	% 81,109	3.011.577,17	0,92
XS2320453884	0,5000 % UPM Kymmene Corp. - Medium Term Notes 2021/2031		EUR	2.451	2.451	0	% 76,316	1.870.505,16	0,57
XS2489138789	3,2500 % Urenco Finance N.V. - Anleihe 2022/2032		EUR	2.451	2.551	100	% 92,341	2.263.277,91	0,69
XS2449928543	1,5000 % Vestas Wind Systems Finance BV - Anleihe 2022/2029		EUR	2.451	2.767	316	% 85,943	2.106.462,93	0,64
XS2198580271	0,7500 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2020/2030		EUR	2.451	1.917	316	% 80,278	1.967.613,78	0,60
XS2530756191	3,0000 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2022/2026		EUR	2.451	2.451	0	% 97,372	2.386.587,72	0,73
XS2176562812	2,3750 % WPP Finance S.A. - Anleihe 2020/2027		EUR	3.713	3.813	100	% 93,549	3.473.474,37	1,06
Summe Wertpapiervermögen							EUR	279.750.624,13	85,20
							EUR	325.753.553,23	99,21
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-252.157,14	-0,08

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	EUR-Kredite bei: Verwahrstelle		EUR	-252.157			% 100,000	-252.157,14	-0,08
	Sonstige Vermögensgegenstände Zinsansprüche		EUR	2.887.750,96			EUR	2.887.750,96 2.887.750,96	0,88 0,88
	Sonstige Verbindlichkeiten Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-47.971,70			EUR	-47.971,70 -47.971,70	-0,01 -0,01
	Fondsvermögen Anteilwert						EUR	328.341.175,35	100,00 ¹⁾
	Umlaufende Anteile						EUR STK	84,24 3.897.759,00	

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Kurse per 28.02.2023

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. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Inland					
XS2084510069	0,2500 % Fresenius Medical Care KGaA - Medium Term Notes 2019/2023	EUR	1.184	2.240	
XS2084497705	0,6250 % Fresenius Medical Care KGaA - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	1.651	2.626	
XS1936208252	1,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA - Medium Term Notes 2019/2025	EUR	457	1.269	
XS1936208419	2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA - Medium Term Notes /	EUR	457	1.269	
XS2047479469	0,5000 % HELLA GmbH & Co. KGaA - Anleihe 2019/2027	EUR	1.350	2.162	
DE000LB2CHW4	0,3750 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2019/2027	EUR	1.300	2.500	
DE000LB2CRG6	0,3750 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	1.800	3.400	
Ausland					
XS2018636600	0,2500 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. - Senior Notes 2019/2025	EUR	1.122	2.097	
XS2156598281	1,6250 % Akzo Nobel N.V. - Medium Term Notes 2020/2030	EUR	2.902	4.120	
XS2187525949	0,3750 % Alliantier N.V. - Medium Term Notes 2020/2030	EUR	1.817	2.667	
DE000A28RSR6	0,0000 % Allianz Finance II B.V. - Anleihe 2020/2031	EUR	4.000	4.000	
DE000A2RWAX4	0,8750 % Allianz Finance II B.V. - Medium Term Notes 43480/46037	EUR	700	1.900	
DE000A2RWAY2	1,0000 % Allianz Finance II B.V. - Medium Term Notes 2019/2030	EUR	700	1.900	
FR0013453040	0,2500 % Alstom S.A. - NTS (Notes) 2019/2026	EUR	2.100	3.200	
FR0013453974	1,8750 % Alstom S.A. - Medium Term Notes 2019/2028	EUR	1.300	2.100	
FR0013460417	0,1250 % Arkéa Public Sector SCF - Öff. MT Pfandbriefe 2019/2030	EUR	1.300	2.100	
FR0014009GQ8	0,8750 % Arkéa Public Sector SCF - Anleihe 2022/2028	EUR	2.000	2.000	
XS2023872174	0,6250 % Arountown SA - Medium Term Notes 2019/2025	EUR	1.500	2.800	
XS2056491587	2,1240 % Assicurazioni Generali S.p.A. - Sub. Medium Term Notes 2019/2030	EUR	2.151	3.369	
FR0014006G24	1,0000 % Atos SE - Anleihe 2021/2029	EUR	2.700	2.700	
FR0013399060	2,6250 % Auchan Holding S.A. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	700	1.900	
FR0013404571	1,3750 % Autoroutes du Sud de la France S.A. - Medium Term Notes 2019/2031	EUR	900	2.500	
ES0413860745	0,1250 % Banco de Sabadell S.A. - Cédulas Hip. 2020/2028	EUR	3.700	3.700	
XS2394063437	0,5000 % Brenntag Finance B.V. - Anleihe 2021/2029	EUR	2.500	2.500	
XS2051494222	0,5000 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2019/2025	EUR	1.930	2.986	
XS2051494495	1,1250 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	2.151	3.369	
XS2102931594	0,3750 % CaixaBank S.A. - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	3.400	3.400	
XS2055758804	0,6250 % CaixaBank S.A. - Anleihe 2019/2024	EUR	4.200	4.200	
ES0213307061	1,1250 % CaixaBank S.A. - Anleihe 2019/2026	EUR	3.000	3.000	
XS2013574038	1,3750 % CaixaBank S.A. - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	2.500	4.500	
XS1936805776	2,3750 % CaixaBank S.A. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	900	2.500	
FR0013507852	1,6250 % Capgemini SE - Senior Notes 2020/2026	EUR	1.500	2.800	
FR0013507860	2,0000 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2029	EUR	900	2.500	
FR0014009E07	2,3750 % Carrefour S.A. - Anleihe 2022/2029	EUR	3.200	3.200	
BE6325493268	0,8750 % Cofinimmo S.A. - Anleihe 2020/2030	EUR	2.500	2.500	
FR00140007B4	0,0100 % Crédit Mutuel Arkéa - Anleihe 2020/2026	EUR	2.000	2.000	
FR0014007Q96	0,7500 % Crédit Mutuel Arkéa - Anleihe 2022/2030	EUR	2.700	2.700	
FR0013511227	0,8750 % Crédit Mutuel Arkéa - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	2.100	3.300	
FR0013421369	1,1250 % Crédit Mutuel Arkéa - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	800	1.600	
FR0013397320	1,3750 % Crédit Mutuel Arkéa - Medium Term Notes 2019/2025	EUR	500	1.300	

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
FR0013444544	0,1250 % Dassault Systemes SE - Anleihe 2019/2026	EUR	3.800	3.800	
XS2052503872	0,0100 % De Volksbank N.V. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	1.300	2.100	
XS2193734733	1,6250 % Dell Bank International DAC - Senior Notes 2020/2024	EUR	1.817	2.667	
XS2100663579	0,6250 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2025	EUR	2.576	3.637	
XS2100664114	1,5000 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2030	EUR	2.902	4.120	
BE0002629104	1,3750 % Elia Transmission Belgium N.V. - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	500	1.300	
FR0013463650	0,1250 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2025	EUR	3.900	6.300	
FR0013463668	0,3750 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2027	EUR	3.900	6.300	
FR0013463676	0,7500 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2031	EUR	3.200	3.200	
XS2491664137	4,0000 % Eurofins Scientific S.E. - Anleihe 2022/2029	EUR	2.389	2.389	
XS2050448336	1,1250 % Fastighets AB Balder - Medium Term Notes 2019/2027	EUR	902	1.741	
XS2126170161	1,6250 % Givaudan Finance Europe B.V. - Anleihe 2020/2032	EUR	2.140	2.140	
XS2243299463	0,8750 % H. Lundbeck A/S - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	791	1.641	
FR0013535150	1,3750 % Icade Sante SAS - Obligations 2020/2030	EUR	1.000	2.000	
XS2068065163	1,2500 % Informa PLC - Medium Term Notes 2019/2028	EUR	1.401	2.240	
XS1933820372	2,1250 % ING Groep N.V. - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	900	2.500	
XS2081018629	1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium-Term Notes 2019/2026	EUR	3.641	5.671	
XS2022424993	1,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	3.004	3.004	
XS2545759099	5,2500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	3.085	3.085	
XS2050543839	1,3750 % ITV PLC - Senior Notes 2019/2026	EUR	1.801	2.776	
XS2051659915	0,1250 % LeasePlan Corporation N.V. - Anleihe 2019/2023	EUR	890	2.530	
XS2021471433	0,3750 % Motability Operations Grp PLC - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	1.122	2.097	
XS2104915033	0,1900 % National Grid Electr.Trans.PLC - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	2.818	3.668	
XS2084050637	0,3750 % Nationale-Nederlanden Bank NV - Medium Term Notes 2019/2025	EUR	1.800	2.600	
XS2384734542	0,2500 % NIBC Bank N.V. - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	2.100	3.300	
XS2023631489	0,8750 % NIBC Bank N.V. - Anleihe 2019/2025	EUR	1.500	1.500	
XS1978668298	2,0000 % NIBC Bank N.V. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	500	1.300	
XS1974922442	1,1250 % Norsk Hydro ASA - Registered Bonds 2019/2025	EUR	367	1.217	
DK0009526998	0,7500 % Nykredit Realkredit A/S - Medium-Term Notes 2020/2027	EUR	2.853	4.071	
XS2177013500	0,7500 % Reckitt Benck.Treas.Ser.(NL)BV - Guaranteed Registered Notes 2020/2030	EUR	941	2.165	
XS2103013210	0,3750 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. - Medium Term Notes 2020/2028	EUR	2.800	3.900	
XS2126162069	0,8750 % RELX Finance B.V. - Guaranteed Notes 2020/2032	EUR	2.351	2.351	
XS2241090088	0,1250 % Repsol Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2020/2024	EUR	1.500	2.900	
XS2035620710	0,2500 % Repsol Intl Finance B.V. - Anleihe 2019/2027	EUR	2.300	2.300	
XS2156583259	2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. - Anleihe 2020/2030	EUR	2.500	2.500	
XS2170736180	0,7500 % Richemont Intl Holding S.A. - EO-Notes 2020/2028	EUR	1.817	2.667	
XS2170736263	1,1250 % Richemont Intl Holding S.A. - Guaranteed Notes 2020/2032	EUR	3.770	3.770	
XS2010044209	0,5000 % Schlumberger Finance B.V. - Anleihe 2019/2031	EUR	2.961	2.961	
XS2166754957	1,3750 % Schlumberger Finance B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2026	EUR	2.717	4.357	
FR0013396876	1,5000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2019/2028	EUR	700	1.900	
XS2182055181	0,0000 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Medium Term Notes 1900/1900	EUR	3.900	3.900	
XS2446844594	1,0000 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	3.500	3.500	
XS2128498636	2,0000 % Signify N.V. - Senior Notes 2020/2024	EUR	2.570	3.666	
XS1986416268	0,8750 % Sika Capital B.V. - Guaranteed Registered Notes 2019/2027	EUR	367	1.217	
XS1986416698	1,5000 % Sika Capital B.V. - Guaranteed Registered Notes 2019/2031	EUR	400	1.239	
XS2020568734	0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	3.279	3.279	
XS2115094737	0,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	735	2.434	
XS2078737215	0,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken - Anleihe 2019/2029	EUR	4.248	4.248	
XS2478690931	1,1750 % Skandinaviska Enskilda Banken - Anleihe 2022/2026	EUR	4.195	4.195	
FR0013403441	1,2500 % Société Générale S.A. - Anleihe 2019/2024	EUR	1.600	4.400	
FR0013410818	1,7500 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	1.200	3.200	
XS2051032444	0,1250 % SpareBank 1 SMN - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	1.290	2.140	
XS2406010285	0,2500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Anleihe 2021/2026	EUR	2.667	2.667	
XS2404027935	0,2500 % Swedbank AB - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	1.817	3.458	
XS2167002521	0,7500 % Swedbank AB - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	3.063	4.703	
FR0013534500	0,8750 % Teréga S.A. - Obligations 2020/2030	EUR	500	1.300	
XS2033351995	0,1250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2019/2025	EUR	791	1.641	
XS2438026440	0,8750 % Thames Water Utilities Fin.PLC - Anleihe 2022/2028	EUR	3.108	3.108	
FR0013397452	1,6250 % VINCI S.A. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	900	2.400	
XS2002017361	0,9000 % Vodafone Group PLC - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	1.426	2.644	
XS2002018500	1,6250 % Vodafone Group PLC - Medium Term Notes 2019/2030	EUR	1.817	3.458	
XS2324836878	0,2500 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2021/2028	EUR	1.817	2.667	

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2022 bis zum 28.02.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		314.914,68	0,081
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		3.038.174,07	0,779
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		7.065,31	0,002
Summe der Erträge		3.360.154,06	0,862
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-6.723,36	-0,002
2. Verwaltungsvergütung		-482.965,73	-0,124
3. Sonstige Aufwendungen		-1.498,91	0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-1.498,91		0,000
Summe der Aufwendungen		-491.188,00	-0,126
III. Ordentlicher Nettoertrag		2.868.966,06	0,736
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		428.855,76	0,110
2. Realisierte Verluste		-26.029.714,36	-6,678
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-25.600.858,60	-6,568
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-22.731.892,54	-5,832
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		231.198,07	0,059
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-8.619.044,88	-2,211
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-8.387.846,81	-2,152
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-31.119.739,35	-7,984

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023	2021 / 2022
	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		142.449.761,61
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-583.189,75
2. Zwischenausschüttungen		-1.954.248,53
3. Mittelzufluss (netto)		212.382.692,50
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	251.879.492,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-39.496.800,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		7.165.898,87
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-31.119.739,35
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	231.198,07	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-8.619.044,88	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		328.341.175,35

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		2.850.733,10	0,731
1. Vortrag aus dem Vorjahr		0,00	0,000
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-22.731.892,54	-5,832
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ²⁾		25.582.625,64	6,563
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		-0,00	0,000
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		-0,00	0,000
III. Gesamtausschüttung		2.850.733,10	0,731
1. Zwischenausschüttung		1.954.248,53	0,501
2. Endausschüttung		896.484,57	0,230

¹⁾ Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

²⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen entspricht dem Betrag, um den die Gesamtausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres zzgl. Vortrag aus dem Vorjahr übersteigt.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Sondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2022/2023	328.341.175,35	84,24
2021/2022	142.449.761,61	95,43

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	84,24
Umlaufende Anteile	STK	3.897.759,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		99,21
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 28.02.2023 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 28.02.2023 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

Gesamtkostenquote (in %)		0,18
---------------------------------	--	-------------

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Transaktionskosten	EUR	0,00
Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.		

Erfolgt die Abwicklung von Zeichnungen bzw. Rücknahmen von Anteilscheinen mit den sog. Market Makern nicht über die Bereitstellung bzw. Abnahme der betreffenden Wertpapiere, sondern über Bankguthaben, werden die Transaktionskosten, die dadurch entstehen, dass die Deka Investment die Wertpapiere über andere Broker beschafft bzw. veräußert, durch den Market Maker ersetzt und dem Sondervermögen gutgeschrieben. Die oben genannten Transaktionskosten reduzieren sich deshalb um folgenden Betrag:	EUR	0,00
--	-----	-------------

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,16
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,48

Der im Geschäftsjahr 2022/2023 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von eur -1:368,34 enthalten.

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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.

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB:

Basierend auf dem Gesetz zur Umsetzung der zweiten Aktionärsrechterichtlinie (ARUG II) macht die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu § 134c Abs. 4 AktG folgende Angaben:

Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken:

Informationen zu den wesentlichen allgemeinen mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens sind im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Risikohinweise“ aufgeführt. Für die konkreten wesentlichen Risiken im Geschäftsjahr verweisen wir auf den Tätigkeitsbericht.

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten:

Die Zusammensetzung des Portfolios und die Portfolioumsätze können der Vermögensaufstellung bzw. den Angaben zu den während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäften, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, entnommen werden. Die Portfolioumsatzkosten werden im Anhang des vorliegenden Jahresberichts ausgewiesen (Transaktionskosten).

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung:

Das Sondervermögen bildet möglichst genau die Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index ab, sodass die mittel- bis langfristige Entwicklung der jeweiligen Gesellschaften kein Entscheidungskriterium für Investitionen ist.

Einsatz von Stimmrechtsberatern:

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern informieren der Mitwirkungsbericht sowie der Stewardship Code der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Dokumente stehen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueberuns> (Corporate Governance).

Handhabung der Wertpapierleihe und Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten:

Auf inländischen Hauptversammlungen von börsennotierten Aktiengesellschaften übt die Kapitalverwaltungsgesellschaft das Stimmrecht entweder selbst oder über Stimmrechtsvertreter aus. Verleihe Aktien werden rechtzeitig an die Kapitalverwaltungsgesellschaft zurückübertragen, sodass diese das Stimmrecht auf Hauptversammlungen wahrnehmen kann. Für die in den Sondervermögen befindlichen ausländischen Aktien erfolgt die Ausübung des Stimmrechts insbesondere bei Gesellschaften, die im EURO STOXX 50® oder STOXX Europe 50® vertreten sind, sowie für US-amerikanische und japanische Gesellschaften mit signifikantem Bestand, falls diese Aktien zum Hauptversammlungstermin nicht verliehen sind. Zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften informiert der Stewardship Code und der Mitwirkungsbericht der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die entsprechenden Dokumente stehen Ihnen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueberuns> (Corporate Governance).

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka Investment GmbH 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 Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH 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 Investment GmbH nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - 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 Investment GmbH 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.

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

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

Die variable Vergütung der Geschäftsführung 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 die Geschäftsführung 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 Geschäftsführungs-Ebene 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 75 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2022 fand im 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 Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2022 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

	EUR
Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung	57.636.189,51
davon feste Vergütung	43.854.381,97
davon variable Vergütung	13.781.807,54
Zahl der Mitarbeiter der KVG	461,00
Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**	11.962.579,80
Geschäftsführer	2.094.112,05
weitere Risktaker	1.991.350,34
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	387.352,00
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risktaker	7.489.765,41

* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt

** weitere Risktaker: alle sonstigen Risktaker, die nicht Geschäftsführer oder Risktaker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risktaker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risktaker oder Geschäftsführer befinden.

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

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:

Unternehmenskennung (LEI-Code):

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF 5299006NGBYLKA0NUU17

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja
 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 31,50% 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.

Der Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF ist ein passiv gemanagter börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF), der den MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select (Preisindex) nachbildet. Der zugrundeliegende Index umfasst in Euro lautende Unternehmensanleihen von großen und mittelgroßen Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Europa haben und berücksichtigte im Berichtszeitraum ökologische (Environment – „E“), soziale (Social – „S“) und die verantwortungsvolle Unternehmens- bzw. Staatsführung (Governance – „G“) betreffende Kriterien (sog. ESG-Kriterien). Diese zielten darauf ab

- die gewichteten absoluten CO2-Emissionen des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant zu reduzieren. Dazu wurden Unternehmen anhand des „Low Carbon Transition Scores“ (nachfolgend „LCT-Score“) bei der Aufnahme in den Index selektiert. Der LCT-Score wird mit einem

Wert zwischen 0 und 10 angegeben und ist ein Indikator dafür, wie hoch die Risiken und Chancen eines Unternehmens in Bezug auf den Wandel zu einer CO₂-emissionsarmen Wirtschaft sind und wie gut diese Risiken im Unternehmen gemanagt werden. Grundlage für die Zuordnung des LCT-Scores ist die CO₂-Intensität eines Unternehmens. Die CO₂-Intensität ist eine Kennzahl, die ausdrückt, wie hoch die CO₂-Emissionen im Verhältnis zum Unternehmenswert (EVIC = enterprise value including cash) sind.

- in Unternehmen zu investieren, die verantwortungsvolle Geschäftspraktiken anwenden und keine Umsätze bzw. nur einen geringen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschaften. Hierzu wurde das Anlageuniversum des zugrundeliegenden Index durch verbindliche Ausschlusskriterien eingegrenzt.

Nicht investiert wurde in Unternehmen,

- die Nuklearsprengköpfe und/oder ganze Atomraketen herstellten.
- die Komponenten herstellten, die für die ausschließliche Verwendung in Kernwaffen entwickelten oder erheblich verändert wurden.
- die Trägerplattformen herstellten oder montierten, die für den ausschließlichen Einsatz von Kernwaffen entwickelt oder erheblich modifiziert wurden.
- die Hilfsdienste im Zusammenhang mit Kernwaffen anboten.
- die Komponenten herstellten, die nicht für die ausschließliche Verwendung in Kernwaffen entwickelt oder wesentlich verändert wurden, aber in Kernwaffen verwendet werden konnten.
- die Trägerplattformen herstellten oder montierten, die für Kernwaffen verwendet werden konnten, aber nicht für die ausschließliche Nutzung von Kernwaffen entwickelt oder nicht wesentlich geändert wurden.
- die Komponenten für Trägersysteme herstellten, die ausschließlich für Nuklearwaffen verwendet wurden.
- die in irgendeiner Weise mit umstrittenen Waffen (Streumunition, Landminen, Waffen mit angereichertem Uran, biologische/chemische Waffen, Blendlaser, nicht nachweisbare Splitter und Brandwaffen mit weißem Phosphor) in Verbindung standen.
- die als "Produzent" von Tabakwaren eingestuft wurden oder 5 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel, dem Angebot und der Lizenzierung von Tabakerzeugnissen erzielten.
- die mehr als 0 % ihres Umsatzes mit unkonventionellem Erdöl und Erdgas erzielten.
- die Atomkraftwerke betrieben oder besaßen.
- die sich nicht an die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen hielten.
- die mit sehr schwerwiegenden Kontroversen in Bezug auf ESG-Themen konfrontiert waren. Dies wurde durch den Ausschluss von Unternehmen mit einem „MSCI ESG Controversy Score“ von 0 umgesetzt.
- die mit sehr schwerwiegenden oder schwerwiegenden Kontroversen in Bezug auf Umweltthemen konfrontiert waren. Dies wurde durch den Ausschluss von Unternehmen mit einem „MSCI ESG Environmental Controversy Score“ von 1 oder 0 umgesetzt.
- Mit einem MSCI ESG Rating von "CCC", fehlendem LCT-Score oder fehlendem ESG-Score. Die Bewertung des MSCI ESG Ratings umfasst dabei 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 wurden im Laufe des Berichtszeitraums zweimal Ausschlusskriterien angepasst oder neu eingeführt.

Mit Wirkung zum 01.05.2022 wurde die Umsatz-Toleranzgrenze für Unternehmen,

- die Umsätze mit Waffensystemen, Komponenten oder unterstützenden Systemen und Dienstleistungen erzielten, von bisher 10% auf 5% reduziert.

- die Umsätze aus dem Abbau von Kohle und dem Verkauf an externe Parteien erzielten von bisher 5% auf 0% reduziert.

Außerdem wurden seit dem selben Zeitpunkt keine Wertpapiere von Unternehmen mehr in den Index aufgenommen,

- mit einer CO2Emissionsintensität (gemessen in Scope1 und 2 CO2e/ Mio. USD Umsatz) von mehr als 1.500.
- mit einer Energieverbrauchsintensität (gemessen in GWh/ Mio. EUR Umsatz) von mehr als 300.
- die in den letzten drei Jahren mehr als eine schwere oder sehr schwere Kontroverse im Zusammenhang mit Menschenrechtsverletzungen hatten.
- 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus Kohleverstromung erzielten.
- mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielten
- mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Uranabbau erzielten.
- die nicht das Mindest MSCI-ESG-Rating von "BB" erreicht haben.

Mit Wirkung vom 01.11.2022 wurde in das Indexregelwerk aufgenommen, dass das Ziel verfolgt wird, die Anforderungen an EU-Referenzwerte für den klimabedingten Wandel (EU Climate Transition Benchmark, EU CTB) zu erfüllen. Diese Anforderungen enthalten eine Reduktion der gewichteten absoluten CO2-Emissionen von mindestens 30% im Vergleich zu einem breiten Marktindex, sowie dass die gewichteten absoluten CO2-Emissionen des Portfolios jährlich um mindestens 7% im Vergleich zum Vorjahr sinken. Außerdem wurden die Ausschlusskriterien im Index ergänzt. Der Index sieht keine Investitionen in Wertpapiere von Unternehmen vor,

- die mehr als 0 % ihres Umsatzes aus der arktischen Erdöl oder Erdgasförderung bezogen oder ihren eigenen Angaben zur Folge Erdöl oder Erdgas in arktischen Gebieten förderten.
- die ihren eigenen Angaben zur Folge Erdöl oder Erdgas mit der Methode des hydraulischen Frackings oder Ölsand förderten.
- die ihren eigenen Angaben zur Folge Kohle förderten.

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 Investitionen in Wertpapiere von Unternehmen, 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 im Rahmen der physischen Replikation ausschließlich in Wertpapiere von Unternehmen, die im zugrundeliegenden Index enthalten waren. Damit hielt das Finanzprodukt die im Rahmen des Indexregelwerks festgelegten Ausschlusskriterien während des Berichtszeitraums vollumfänglich und dauerhaft ein. Die Zusammensetzung des Index und damit die Überprüfung der Ausschlusskriterien wurde durch den Indexanbieter vierteljährlich angepasst. Durch die Einhaltung der Ausschlusskriterien wurde erreicht, dass das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Wertpapieren von Unternehmen angelegt wurde, die keine verantwortungsvollen Geschäftspraktiken anwendeten und damit gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstießen, in Umwelt- oder andere ESG-Kontroversen verwickelt waren und/ oder Umsätze bzw. einen gewissen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschafteten.

Eine ausführliche Auflistung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen aus dem zugrundeliegenden Index 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 152,53 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. 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 50,23 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. 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. CO₂-Emissionen

Der Indikator „CO₂-Emissionen“ betrug im Berichtszeitraum 10.737.489,73 tCO₂ der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen.

Dies wurde erreicht durch eine Übergewichtung von Unternehmen, die dazu beitragen, dass CO₂-Emissionen reduziert werden und über ein zukunftsfähiges Geschäftsmodell verfügen, bei gleichzeitiger Untergewichtung von Unternehmen, die bislang nicht zu einer Verringerung des CO₂-Ausstoßes beitragen.

Der Indikator berechnet sich aus dem Anteil der Unternehmen am Fondsvolumen gewichteten CO₂-Emissionen der Unternehmen, gemessen in tCO₂. Der Indikator basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt die Datenlage an den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums wider.

● **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 Berichtszeitraum teilweise 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.

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, 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 auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1) herangezogen. Diese PAI-Indikatoren sollen dazu dienen, die negativen Effekte zu messen, die Unternehmen 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 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 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)

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts, hielten die investierten 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 mehrfach Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren und/ oder UN Global Compact Verstöße vorgeworfen.

Die Bewertung erfolgte hauptsächlich auf Basis von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC. Lagen bei einem Unternehmen 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 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 einbezogen. Informationen hierzu finden sich im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

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 mehrfach Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren oder schwere UN Global Compact Verstöße vorgeworfen 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 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?

Bei dem Finanzprodukt wurden im Berichtszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts oder PAI) berücksichtigt. PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-)Tätigkeiten von Unternehmen 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 negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen, die von den im Index enthaltenen Unternehmen ausgehen können, wurden im Berichtszeitraum begrenzt, indem der Index gegenüber einem breiten Marktindex Unternehmen ausschloss, die definierte Mindeststandards in Bezug auf Umwelt und Soziales nicht einhielten und damit besonders hohe negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren aufwiesen. Eine ausführliche Beschreibung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen geführt haben, findet sich im Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“.

Seit dem 1.05.2022 waren insbesondere keine Unternehmen mehr im Index enthalten, deren CO₂-Emissionsintensität (PAI 3, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) und Energieverbrauchsintensität (PAI 6, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) einen definierten Schwellenwert überschritt, die definierte Umsatzschwellen in kontroversen Geschäftsfeldern wie fossilen Brennstoffen (PAI 4, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) oder kontroversen Waffen (PAI 14, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) überschritten und die gegen soziale Mindeststandards verstießen, indem ihnen z.B. Verstöße gegen den UN Global Compact (PAI 10, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) oder mehrfach Menschenrechtsverletzungen (PAI 14, Tabelle 3, (EU) 2022/1288) vorgeworfen wurden. Eine ausführliche Beschreibung der Kriterien und Schwellenwerte bzw. Ausprägungen, die zum Ausschluss der Unternehmen geführt haben, findet sich im Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“

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>.

Die Messung und Bewertung der PAI der Unternehmen im Anlageuniversum erfolgte unter Verwendung von ESG-Daten des externen [Datenprovider - anpassen je nach Index].



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: 01.03.2022 - 28.02.2023

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
Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 20/25 (XS2171210862)	Banken	1,52%	Deutschland
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 20/25 (FR0013506508)	Gebrauchsgüter & Bekleidung	1,48%	Frankreich
Svenska Handelsbanken AB MTN 20/25 (XS2156510021)	Banken	1,38%	Schweden
Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 20/25 (XS2179037697)	Banken	1,33%	Italien
Carrefour S.A. MTN 20/27 (FR0013505260)	Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	1,19%	Frankreich
ELO S.A. MTN 20/26 (FR0013510179)	Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	1,17%	Frankreich
Pernod-Ricard S.A. Bonds 20/30 (FR0013506532)	Lebensmittel, Getränke & Tabak	1,15%	Frankreich
Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 20/27 (FR0014000UC8)	Immobilien	1,12%	Frankreich
Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 20/30 (XS2147133578)	Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	1,12%	Niederlande
Svenska Handelsbanken AB Non-Pref. MTN 20/30 (XS2121207828)	Banken	1,08%	Schweden
Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 20/31 (FR0014000UD6)	Immobilien	1,07%	Frankreich
Grand City Properties S.A. MTN 21/28 (XS2282101539)	Immobilien	1,06%	Luxemburg
Digital Intrepid Holding B.V. Bonds 21/31 Reg.S (XS2280835260)	Immobilien	1,01%	Niederlande
Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 19/26 (XS2081018629)	Banken	0,99%	Italien
ELO S.A. MTN 20/27 (FR0013524865)	Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	0,99%	Frankreich



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?

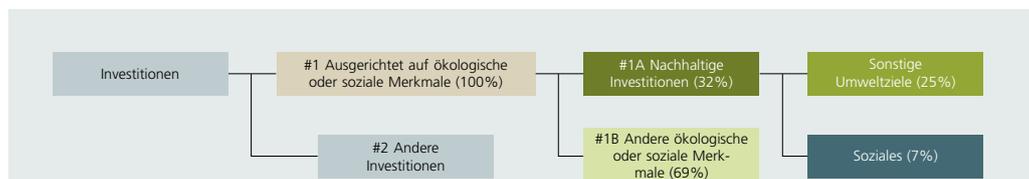
Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale beitrugen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale) betrug im Berichtszeitraum 100%. Darunter fallen alle Investitionen, die die im Rahmen der verbindlichen Elemente der ESG-Anlagestrategie definierten Ausschlusskriterien des Fonds einhielten.

Nachhaltige Investitionen (#1A 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 31,5%. 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 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 wurden 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 der Vermögensallokation nicht berücksichtigt werden.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst die Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

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

Die Zuteilung der Investitionen zu den Sektoren und Teilssektoren 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 3,92% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilssektoren 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	9,59%
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	2,07%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	1,65%
Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	5,87%
Energie	3,12%
Energie	3,12%
Finanzwesen	30,06%
Banken	20,60%
Diversifizierte Finanzdienste	5,09%
Versicherungen	4,37%
Gesundheitswesen	8,65%
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	5,69%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	2,96%
Immobilien	10,02%
Immobilien	10,02%
Industrie	9,86%
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	1,41%
Investitionsgüter	8,45%
Informationstechnologie	7,10%
Hardware & Ausrüstung	1,21%
Software & Dienste	5,89%
Kommunikationsdienste	4,91%
Medien & Unterhaltung	1,92%
Telekommunikationsdienste	2,99%
Nicht-Basiskonsumgüter	4,76%
Automobile & Komponenten	0,29%
Dienstleistungsunternehmen	0,77%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	2,41%
Groß- und Einzelhandel	1,29%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,55%
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,55%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	5,10%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	5,10%
Sonstige	-0,17%
Sonstige	-0,17%
Versorgungsbetriebe	6,45%
Versorgungsbetriebe	6,45%

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?

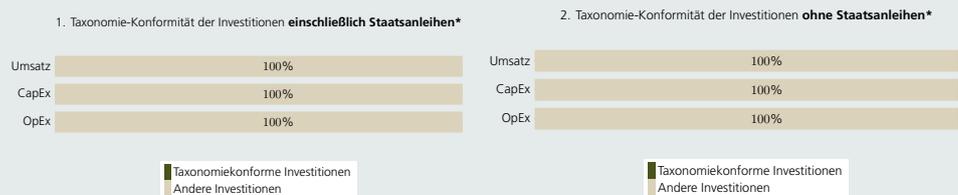
Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht nachweisbar in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu keinem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug demnach 0% (gemessen an den drei Leistungsindikatoren 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 24,75%.

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, konnten 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 6,75%.

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, konnten 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

- 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, die auf Indexebene umgesetzt sind. Dabei findet die Überwachung und Neugewichtung der im Index enthaltenen Wertpapiere im Rahmen der vierteljährlichen Indexanpassungen (jeweils im Januar, April, Juli und Oktober) statt. Aufgrund der Veröffentlichungspläne wurden die Unternehmen in der Regel zudem einmal jährlich von MSCI kontaktiert und das aktualisierte Unternehmensprofil wurde ihnen zugesendet. Die Low Carbon Transition Bewertung erfolgt ebenfalls auf jährlicher Basis. Die zugrundeliegenden Daten für die LCT Kategorien und Scores (d.h. Kohlenstoffemissionen, Einnahmen aus alternativen Energien, Einnahmen aus Energieeffizienz) wurden das ganze Jahr über aktualisiert. Wurden unterjährig signifikante Änderungen in den zugrundeliegenden Daten identifiziert erfolgte eine zusätzliche Bewertung.

Darüber hinaus erfolgte eine Nachhaltigkeitsanalyse durch die Deka Investment GmbH. Die Ergebnisse dieses Analyseprozesses werden auf jährlicher Basis herangezogen, um die ESG-Kriterien des Index zu überprüfen.

Im Rahmen der Mitwirkungspolitik nahm die Gesellschaft zudem ihre Rolle als aktiver Investor wahr, um Unternehmen mit kritischen Geschäftsaktivitäten zu einem nachhaltigeren und verantwortlicheren Wirtschaften zu bewegen. Hierzu trat die Gesellschaft in den Dialog mit ausgewählten Unternehmen zu Themen wie Umweltschutz, Klimawandel und Arbeitsbedingungen. 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>.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Für dieses Produkt wurde der MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select (Preisindex) als Referenzwert bestimmt. Dieser erfüllt die Anforderungen an EU-Referenzwerte für den klimabedingten Wandel (EU Climate Transition Benchmarks, EU CTB). Hiermit wird dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung getragen.

Der zugrundeliegende Index unterscheidet sich von einem breiten Marktindex zum einen durch die reduzierte Anzahl der enthaltenen Titel in Folge der Anwendung der im Abschnitt

„Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt? beschriebenen Ausschlusskriterien. Zum anderen wird bei den verbleibenden Indextiteln zusätzlich eine Umgewichtung anhand des LCT Scores vorgenommen. Dadurch wird erreicht, dass die CO₂-Intensität des Portfolios um 30% gegenüber einem bereiten Marktindex reduziert wird. Darüber hinaus sorgt die Umgewichtung dafür, dass die gewichtete CO₂-Intensität des Portfolios jährlich um mindestens 7% im Vergleich zum Vorjahr sinkt. Darüber hinaus kann sich bspw. der ESG-Score bzw. das ESG-Rating des zugrundeliegenden Index insgesamt von dem Wert eines breiten Marktindex unterscheiden.“

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

01.03.2022 - 28.02.2023	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF
CO ₂ -Emissionen (in tCO ₂ e)	10.737.489,73

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

01.03.2022 - 28.02.2023	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF	Referenzindex
CO ₂ -Emissionen (in tCO ₂ e)	10.737.489,73	21.400.661,77

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

01.03.2022 - 28.02.2023	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF	Breiter Marktindex
CO ₂ -Emissionen (in tCO ₂ e)	10.737.489,73	50.133.028,15

Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds, auf den an dieser Stelle Bezug genommen wird, 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. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

Lizenzdisclaimer: Obwohl die Informationsanbieter der Deka Investment GmbH, insbesondere die MSCI ESG Research LLC und ihre verbundenen Unternehmen (die "ESG-Parteien"), Informationen (die "Informationen") aus Quellen beziehen, die sie für zuverlässig halten, übernimmt keine der ESG-Parteien eine Garantie oder Gewährleistung für die Originalität, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten und lehnt ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien ab, einschließlich derjenigen der Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck. Die Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet werden, dürfen in keiner Form vervielfältigt oder weiterverbreitet werden und dürfen nicht als Grundlage oder Bestandteil von Finanzinstrumenten oder Produkten oder Indizes verwendet werden. Darüber hinaus kann keine der Informationen an und für sich verwendet werden, um zu bestimmen, welche Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen sind oder wann sie zu kaufen oder zu verkaufen sind. Keine der ESG-Parteien haftet für Fehler oder Auslassungen in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten oder für direkte, indirekte oder besondere Schäden, Strafen, Folgeschäden oder andere Schäden (einschließlich entgangener Gewinne), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurde.

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Frankfurt am Main, den 25. Mai 2023
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

**An die Deka Investment GmbH,
Frankfurt am Main**

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. März 2022 bis zum 28. Februar 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. März 2022 bis zum 28. Februar 2023 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der KVG unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die allgemeinen Angaben zum Management und zur Verwaltung des Sondervermögens.

Unser Prüfungsurteil zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und dementsprechend geben wir

diesbezüglich weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht des Sondervermögens Name des Fonds unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der KVG sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die KVG zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger

Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der KVG abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der KVG bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die KVG aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die KVG nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 31. Mai 2023

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Andreas Koch
Wirtschaftsprüfer

Mathias Bunge
Wirtschaftsprüfer

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2021

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

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: 28. Februar 2023

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



Deka Investment GmbH

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

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
www.deka-etf.de

