

Jahresbericht  
zum 29. Februar 2024.

**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 Deko Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

# Bericht der Geschäftsführung.

29. Februar 2024

## **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 2023 bis zum 29. Februar 2024.

Vor dem Hintergrund hoher Lebenshaltungskosten, einer schwachen Auslandsnachfrage und einer strafferen Geldpolitik verlor die europäische Wirtschaftsentwicklung im Berichtszeitraum spürbar an Schwung. In Deutschland hat sich die Konjunkturdynamik merklich abgekühlt, was sich in einer Schrumpfung des Bruttoinlandsprodukts im Jahr 2023 niederschlug. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin die Wirtschaftslage in den USA. Wiederholt sorgten geopolitische Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt für Verunsicherung an den Finanzmärkten.

In der Geldpolitik stand im Berichtsjahr die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zunächst zu weiteren restriktiven Maßnahmen veranlasste. Während die Fed ab Mitte Juli das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent beibehielt, erhöhte die EZB noch im September den Hauptrefinanzierungssatz auf 4,50 Prozent. In diesem Umfeld zogen an den Rentenmärkten die Renditen bis in das dritte Quartal hinein signifikant an. Mit ersten Anzeichen für ein Ende des Zinserhöhungs-Zyklus entfernten sich jedoch die Verzinsungen ab November wieder merklich von ihren zuvor erreichten Höchstständen. Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende Februar bei 2,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,3 Prozent.

An den Aktienmärkten spiegelten sich ab November die Zinssenkungserwartungen in merklich steigenden Kursen wider, sodass die wichtigsten Aktienindizes im Berichtszeitraum mehrheitlich erfreuliche Steigerungen verzeichneten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten auf ein neues Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Lediglich der chinesische Aktienmarkt litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise.

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](http://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

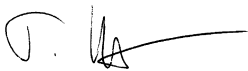
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 29. Februar 2024	16
Vermögensaufstellung zum 29. Februar 2024	17
Anhang	23
Nachhaltiges Investitionsziel	25
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	41
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	43

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

# Jahresbericht 01.03.2023 bis 29.02.2024

## 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 9 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, die aufgrund von Indexveränderungen und der Rücknahme von Anteilscheinen durchgeführt wurden.

#### 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	seit Auflegung p.a.
	5,82%	-4,39%

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 4,75 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	DE000A2GSR47	0.010000 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen Inh.-Schv. v.2020(2027) 20270506
Löschung	XS2282101539	0.125000 % Grand City Properties S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/28) 20280110
Löschung	FR0013482833	0.125000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) 20280210
Löschung	XS2176715584	0.125000 % SAP SE Inh.-Schuld.v.2020(2026/2026) 20260517
Löschung	FR0013486701	0.125000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26) 20260223
Löschung	XS2308586911	0.125000 % SPAREBANK 1 ØSTLANDET EO-Preferred Med.-T.Nts 21(28) 20280302
Löschung	XS2404629235	0.125000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20261102
Löschung	XS2257961818	0.125000 % UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) 20281118
Löschung	XS2356091269	0.250000 % De Volksbank N.V. EO-Non-Pref. MTN 2021(26/26) 20260621
Löschung	DK0030467105	0.250000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2020(26) 20260112
Löschung	FR0013494168	0.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2020(20/29) 20290310
Löschung	XS2347663507	0.375000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290602
Löschung	XS2171210862	0.375000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25) 20250511
Löschung	FR0013482841	0.375000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/31) 20310210
Löschung	DK0030484548	0.375000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280116
Löschung	XS2176715667	0.375000 % SAP SE Inh.-Schuld.v.2020(2029/2029) 20290517
Löschung	XS2237901355	0.375000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2020(30/30) 20300924
Löschung	XS2400445289	0.500000 % Dell Bank International DAC EO-MTN 2021(21/26) Reg.S 20261026
Löschung	XS2407955827	0.500000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN v.2021(2021/2032) 20321116
Löschung	DK0009529901	0.500000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250709
Löschung	XS2121207828	0.500000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2020(30) 20300217
Löschung	XS2320453884	0.500000 % UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31) 20310321
Löschung	XS2171316859	0.625000 % Danske Bank AS EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250525
Löschung	XS2280835260	0.625000 % Digital Intrepid Holding B.V. EO-Bonds 2021(21/31) Reg.S 20310714
Löschung	DE000A289NX4	0.625000 % Evonik Industries AG Medium Term Notes v.20(20/25) 20250917
Löschung	XS2265360359	0.625000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20301201
Löschung	FR0014000UC8	0.625000 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270503
Löschung	XS2317069685	0.750000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(28) 20280315
Löschung	FR0013506508	0.750000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) 20250406
Löschung	XS2441244535	0.750000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/25) 20250330
Löschung	XS2291340433	0.750000 % Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/28) 20280125
Löschung	XS2442768227	0.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270808
Löschung	XS2163320679	0.750000 % Sodexo S.A. EO-Notes 2020(20/25) 20250426
Löschung	XS2198580271	0.750000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2020(20/30) 20300702
Löschung	ES0205045026	0.875000 % Criteria Caixa S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2020(27) 20271027
Löschung	BE6321529396	0.875000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300427
Löschung	XS2348638433	1.000000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2021(33) 20330601
Löschung	XS2288925568	1.000000 % Balder Finland Oyj EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290119
Löschung	XS2432565005	1.000000 % Balder Finland Oyj EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270117
Löschung	XS2232115423	1.000000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320114
Löschung	XS2126169742	1.000000 % Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/27) 20270421
Löschung	XS2163333656	1.000000 % Sodexo S.A. EO-Notes 2020(20/29) 20290426
Löschung	XS2156510021	1.000000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250414
Löschung	XS2171713006	1.113000 % Eurogrid GmbH MTN v.2020(2020/2032) 20320514

# 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	XS2341269970	1.125000 % Aker BP ASA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290511
Löschung	FR0013519071	1.125000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/30) 20300622
Löschung	XS2401704189	1.250000 % ACEF Holding S.C.A. EO-Notes 2021(21/30) 20300425
Löschung	XS2191362859	1.250000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/31) 20310131
Löschung	XS2156787090	1.250000 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/25) 20250415
Löschung	XS2304664597	1.350000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31) 20310223
Löschung	XS2441247041	1.375000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/30) 20300330
Löschung	FR0014009L57	1.375000 % Pernod-Ricard S.A. EO-Notes 2022(22/29) 20290406
Löschung	FR0014000UD6	1.375000 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/31) 20311203
Löschung	XS2199604096	1.375000 % UNIQA Insurance Group AG EO-Notes 2020(30/30) 20300708
Löschung	XS2175967343	1.500000 % Achmea B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(27/27) 20270525
Löschung	XS2178769159	1.500000 % Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2020(2030/2030) 20300528
Löschung	FR0013515871	1.500000 % Société Foncière Lyonnaise SA EO-Obl. 2020(20/27) 20270604
Löschung	FR0013519279	1.625000 % Covivio S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300622
Löschung	XS2152329053	1.625000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2020(2027/2027) 20271007
Löschung	XS2232027727	1.625000 % KION GROUP AG Med.Term.Notes v.20(20/25) 20250923
Löschung	XS2150015555	1.750000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2020(20/27) 20270401
Löschung	FR0013506532	1.750000 % Pernod-Ricard S.A. EO-Bonds 2020(20/30) 20300407
Löschung	XS2472845911	1.750000 % SPAREBANK 1 ØSTLANDET EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270426
Löschung	XS2147133578	1.750000 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300324
Löschung	XS2236363573	1.875000 % Amadeus IT Group S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/28) 20280923
Löschung	XS2459544339	1.875000 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290920
Löschung	XS2482872418	1.875000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2025/2025) 20250523
Löschung	XS2461785185	2.000000 % Castellum Helsinki Fin.Hol.Abp EO-Medium-Term Nts 2022(22/25) 20250323
Löschung	FR0013512233	2.000000 % Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/29) 20290511
Löschung	XS2473346299	2.000000 % Nationwide Building Society EO-Med.-Term Nts 2022(27) 20270427
Löschung	XS2485152362	2.100000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270524
Löschung	XS2240507801	2.125000 % Informa PLC EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20251005
Löschung	XS2179037697	2.125000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) 20250525
Löschung	XS2526839175	2.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20250309
Löschung	FR0013507878	2.375000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/32) 20320414
Löschung	XS2128499105	2.375000 % Signify N.V. EO-Notes 2020(20/27) 20270510
Löschung	XS2176562812	2.375000 % WPP Finance S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270518
Löschung	XS2484587048	2.592000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310524
Löschung	XS2531420730	2.625000 % Alliander N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270908
Löschung	FR0013505260	2.625000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20271214
Löschung	XS2525157470	2.625000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27) 20270823
Löschung	DE000A3SJZT2	2.625000 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen Inh.-Schv. v.2023(2033) 20330125
Löschung	XS2177555062	2.875000 % Amadeus IT Group S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/27) 20270519
Löschung	FR0013510179	2.875000 % ELO S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/26) 20260128
Löschung	XS2524740649	2.875000 % Nordea Bank Abp EO-Non-Preferred MTN 2022(32) 20320823
Löschung	XS2534276808	2.875000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Pref. Med.-T.Nts 2022(25) 20250919
Löschung	XS2487054939	3.000000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(32) 20320531
Löschung	XS2530756191	3.000000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2022(22/26) 20260922



# 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	FR0013524865	3.250000 % ELO S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(27/27) 20270722
Löschung	XS2489138789	3.250000 % Urenco Finance N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320612
Löschung	XS2575556589	3.375000 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310115
Löschung	XS2496028924	3.375000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320829
Löschung	FR001400G412	3.375000 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330226
Löschung	XS2588099981	3.375000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2023(28) 20280216
Löschung	FR001400KJ00	3.500000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 23(23/33) 20330906
Löschung	XS2574870759	3.500000 % Motability Operations Grp PLC EO-Medium-Term Notes 23(23/31) 20310716
Löschung	XS2582814039	3.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310512
Löschung	XS2530034649	3.750000 % Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(29) 20290906
Löschung	FR001400HU68	3.750000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/30) 20301009
Löschung	FR001400DP44	3.750000 % Pernod Ricard S.A. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20321101
Löschung	XS2583600791	3.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280206
Löschung	XS2618499177	3.750000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2023(26) 20260504
Löschung	XS2555192710	3.750000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251113
Löschung	XS2542914986	3.875000 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/30) 20300310
Löschung	XS2625195891	4.000000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(26) 20260518
Löschung	DK0030045703	4.000000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280716
Löschung	XS2553798443	4.000000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26) 20261108
Löschung	FR001400DZM5	4.000000 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2022(27) 20271115
Löschung	FR001400IDW0	4.125000 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2023(27) 20270601
Löschung	XS2599779597	4.250000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330315
Löschung	XS2633552026	4.375000 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Med.-T. Notes 2023(26/26) 20260607
Löschung	XS2545259876	4.500000 % Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20271017
Löschung	FR001400DQ84	4.625000 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281102
Löschung	FR001400EHH1	4.875000 % ELO S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(28/28) 20281207
Löschung	XS2559501429	5.000000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029) 20291127
Löschung	XS2592658947	5.625000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 23(33) 20330307
Neuaufnahme	XS2308586911	0.125000 % SPAREBANK 1 ØSTLANDET EO-Preferred Med.-T.Nts 21(28) 20280302
Neuaufnahme	XS2404629235	0.125000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20261102
Neuaufnahme	ES0413900723	0.180000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2021(31) 20310621
Neuaufnahme	XS2356091269	0.250000 % De Volksbank N.V. EO-Non-Pref. MTN 2021(26/26) 20260621
Neuaufnahme	DK0030467105	0.250000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2020(26) 20260112
Neuaufnahme	XS2421195848	0.375000 % Arountown SA EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) 20270414
Neuaufnahme	DE000MHB64E1	0.375000 % Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29) 20290308
Neuaufnahme	DK0030484548	0.375000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280116
Neuaufnahme	DE000A3KY359	0.500000 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 21(33/33) 20331121
Neuaufnahme	XS2407955827	0.500000 % Henkel AG & Co. KGaA MTN v.2021(2021/2032) 20321116
Neuaufnahme	XS2343540519	0.500000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33) 20330523
Neuaufnahme	XS2441296923	0.500000 % Santander Consumer Bank AS EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20250810
Neuaufnahme	XS2432530637	0.500000 % Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2022(27) 20270113
Neuaufnahme	FR00140060E7	0.500000 % Société Foncière Lyonnaise SA EO-Obl. 2021(21/28) 20280420
Neuaufnahme	XS2171316859	0.625000 % Danske Bank AS EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250525
Neuaufnahme	XS2333297625	0.741000 % Eurogrid GmbH MTN v.2021(2021/2033) 20330420

# 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	XS2291340433	0.750000 % Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/28) 20280125
Neuaufnahme	ES0205045026	0.875000 % Criteria Caixa S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2020(27) 20271027
Neuaufnahme	FR0014007VP3	0.875000 % Gecina S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/33) 20330124
Neuaufnahme	XS2406890066	0.875000 % Kon. KPN N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33) 20331114
Neuaufnahme	XS2348638433	1.000000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2021(33) 20330601
Neuaufnahme	XS2288925568	1.000000 % Balder Finland Oyj EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290119
Neuaufnahme	XS2342227837	1.000000 % Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290516
Neuaufnahme	FR0013519071	1.125000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/30) 20300622
Neuaufnahme	XS2443893255	1.125000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2022(27) 20270215
Neuaufnahme	XS2449330179	1.125000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20270929
Neuaufnahme	XS2191362859	1.250000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/31) 20310131
Neuaufnahme	XS2428716000	1.375000 % Digital Intrepid Holding B.V. EO-Bonds 2022(22/32) 20320717
Neuaufnahme	XS2455983861	1.375000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320310
Neuaufnahme	XS2347367018	1.375000 % Merlin Properties SOCIMI S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/30) 20300531
Neuaufnahme	DE000BHYOSB0	1.750000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(32) 20320509
Neuaufnahme	XS2472845911	1.750000 % SPAREBANK 1 ØSTLANDET EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270426
Neuaufnahme	XS2236363573	1.875000 % Amadeus IT Group S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/28) 20280923
Neuaufnahme	XS2459544339	1.875000 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290920
Neuaufnahme	XS2462468740	2.000000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320327
Neuaufnahme	XS2473346299	2.000000 % Nationwide Building Society EO-Med.-Term Nts 2022(27) 20270427
Neuaufnahme	XS2473687106	2.250000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2022(22/32) 20320516
Neuaufnahme	FR001400AJX2	2.250000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/29) 20290628
Neuaufnahme	FR0014008JQ4	2.500000 % Mercialys EO-Bonds 2022(22/29) 20290227
Neuaufnahme	XS2531420730	2.625000 % Alliander N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270908
Neuaufnahme	XS2177555062	2.875000 % Amadeus IT Group S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/27) 20270519
Neuaufnahme	XS2482872251	2.875000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2030/2030) 20300523
Neuaufnahme	XS2524740649	2.875000 % Nordea Bank Abp EO-Non-Preferred MTN 2022(32) 20320823
Neuaufnahme	XS2487054939	3.000000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(32) 20320531
Neuaufnahme	FR001400N277	3.000000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2024(24/31) 20310109
Neuaufnahme	XS2558916693	3.125000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281121
Neuaufnahme	XS2747590896	3.212000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 24(24/29) 20290114
Neuaufnahme	FR001400KJP7	3.250000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 23(23/29) 20290906
Neuaufnahme	FR001400IJT3	3.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/28) 20280611
Neuaufnahme	XS2575556589	3.375000 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310115
Neuaufnahme	FR001400G412	3.375000 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330226
Neuaufnahme	FR001400HJE7	3.375000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 23(23/25) 20251020
Neuaufnahme	XS2588099981	3.375000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2023(28) 20280216
Neuaufnahme	FR001400KJ00	3.500000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 23(23/33) 20330906
Neuaufnahme	XS2574870759	3.500000 % Motability Operations Grp PLC EO-Medium-Term Notes 23(23/31) 20310716
Neuaufnahme	FR001400IJU1	3.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330611
Neuaufnahme	XS2747596315	3.547000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 24(24/34) 20340114
Neuaufnahme	XS2593105393	3.625000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/27) 20270302
Neuaufnahme	XS2573807778	3.625000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2023(23/33) 20330109
Neuaufnahme	XS2607193435	3.625000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290420

# 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	XS2615183501	3.722000 % Eurogrid GmbH MTN v.2023(2023/2030) 20300426
Neuaufnahme	XS2593105476	3.750000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/32) 20320302
Neuaufnahme	XS2575952424	3.750000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2023(26) 20260115
Neuaufnahme	XS2582814039	3.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310512
Neuaufnahme	FR001400HU68	3.750000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/30) 20301009
Neuaufnahme	FR001400DP44	3.750000 % Pernod Ricard S.A. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20321101
Neuaufnahme	FR001400KPC2	3.750000 % Pernod Ricard S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330914
Neuaufnahme	XS2616008541	3.750000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/26) 20261102
Neuaufnahme	XS2616008970	3.750000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/30) 20300502
Neuaufnahme	XS2583600791	3.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280206
Neuaufnahme	XS2618499177	3.750000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2023(26) 20260504
Neuaufnahme	XS2623868994	3.750000 % Tele2 AB EO-Medium-Term Nts 2023(29/29) 20291121
Neuaufnahme	XS2587306403	3.820000 % Sage Group PLC, The EO-Medium Term Nts 2023(23/28) 20280214
Neuaufnahme	FR001400IBM5	3.875000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2023(23/31) 20310716
Neuaufnahme	XS2542914986	3.875000 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/30) 20300310
Neuaufnahme	XS2598649254	3.875000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290315
Neuaufnahme	XS2718201515	3.875000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310520
Neuaufnahme	XS2619751576	3.875000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Notes 2023(28) 20280508
Neuaufnahme	XS2625195891	4.000000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(26) 20260518
Neuaufnahme	DK00300045703	4.000000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280716
Neuaufnahme	FR001400DZM5	4.000000 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2022(27) 20271115
Neuaufnahme	XS2629062568	4.000000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/26) 20260531
Neuaufnahme	XS2576550326	4.000000 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/27) 20270417
Neuaufnahme	FR001400D0F9	4.125000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281011
Neuaufnahme	XS2715302001	4.125000 % Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2023(23/33) 20331127
Neuaufnahme	XS2697483118	4.125000 % ING Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(26) 20261001
Neuaufnahme	XS2643041721	4.125000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 2023(27) 20270628
Neuaufnahme	FR001400IDW0	4.125000 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2023(27) 20270601
Neuaufnahme	XS2597973812	4.125000 % Vestas Wind Systems A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26) 20260614
Neuaufnahme	XS2725957042	4.125000 % Vestas Wind Systems A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310614
Neuaufnahme	XS2626022573	4.125000 % WPP Finance S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280529
Neuaufnahme	XS2675225531	4.250000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330105
Neuaufnahme	XS2559580548	4.250000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2026) 20260527
Neuaufnahme	XS2599779597	4.250000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330315
Neuaufnahme	FR001400DZO1	4.250000 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2022(32) 20321115
Neuaufnahme	XS2629064267	4.250000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290831
Neuaufnahme	XS2633552026	4.375000 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Med.-T. Notes 2023(26/26) 20260607
Neuaufnahme	FR001400LUK3	4.375000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20311113
Neuaufnahme	XS2679878319	4.375000 % Santander Consumer Bank AG EO Med.-Term Notes 2023(27) 20270912
Neuaufnahme	XS2596599147	4.500000 % Pandora A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280409
Neuaufnahme	DK0030512421	4.625000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2023(29) 20290118
Neuaufnahme	XS2708354811	4.750000 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(26/27) 20270124
Neuaufnahme	XS2529233814	4.750000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270905
Neuaufnahme	XS2626289222	4.875000 % 3i Group PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/29) 20290613

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

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

<b>Zu- oder Abgang</b>	<b>ISIN</b>	<b>Wertpapiername</b>
Neuaufnahme	XS2592240712	4.875000 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2023(29/30) 20300306
Neuaufnahme	FR001400EHH1	4.875000 % ELO S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(28/28) 20281207
Neuaufnahme	XS2704918478	4.875000 % H&M Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20311024
Neuaufnahme	XS2625196352	4.875000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30) 20300518
Neuaufnahme	XS2671251127	4.875000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Non-Pref. Med.-T.Nts 23(28) 20280823
Neuaufnahme	XS2690050682	5.000000 % BUPA Finance PLC EO-Notes 2023(23/30) 20301011
Neuaufnahme	XS2559501429	5.000000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029) 20291127
Neuaufnahme	XS2673808726	5.125000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(31) 20310828
Neuaufnahme	XS2592658947	5.625000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 23(33) 20330307
Neuaufnahme	FR001400KWR6	6.000000 % ELO S.A. EO-Medium Term Nts 2023(23/29) 20290321

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS2626289222	4.875000 % 3i Group PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/29) 20290613	0,89
XS2575555938	3.250000 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/27) 20270115	0,86
XS2351301499	0.750000 % ACEF Holding S.C.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28) 20280613	0,73
XS2560411543	3.625000 % Achmea B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20251128	0,86
XS2386592484	0.125000 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2021(21/28) 20280920	0,75
XS2386592567	0.500000 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2021(21/31) 20310920	0,69
XS2555178644	3.000000 % adidas AG Anleihe v.2022(2022/2025) 20251120	0,85
XS2462468740	2.000000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320327	0,91
XS2462466611	1.500000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28) 20280327	0,95
XS2531420730	2.625000 % Alliander N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) 20270908	0,84
DE000A3KY359	0.500000 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 21(33/33) 20331121	0,67
FR0014004QX4	0.125000 % Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/27) 20270726	0,76
FR0014004R72	0.500000 % Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/30) 20300726	0,96
XS2421195848	0.375000 % Aroundtown SA EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) 20270414	1,46
XS2473687106	2.250000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2022(22/32) 20320516	0,72
XS2747590896	3.212000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 24(24/29) 20290114	0,84
XS2747596315	3.547000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 24(24/34) 20340114	1,26
XS2593105393	3.625000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/27) 20270302	1,19
XS2593105476	3.750000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/32) 20320302	1,19
XS2573807778	3.625000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2023(23/33) 20330109	1,24
XS2537251170	3.750000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/30) 20301011	1,25
ES0413900723	0.180000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2021(31) 20310621	0,87
XS2575952424	3.750000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2023(26) 20260115	0,66
DE000BHY0SB0	1.750000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(32) 20320509	1,17
DE000BHY0GNO	0.375000 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv. v.22(27) 20270124	0,77
FR0014006CS9	0.500000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2021(21/30) 20300210	0,98
FR001400AJX2	2.250000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/29) 20290628	0,98
FR001400IBM5	3.875000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2023(23/31) 20310716	0,99
FR001400DNG3	4.625000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/32) 20320606	1,03
XS2496028502	2.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20270829	1,17
XS2675225531	4.250000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330105	1,35
XS2690050682	5.000000 % BUPA Finance PLC EO-Notes 2023(23/30) 20301011	0,90
XS2708354811	4.750000 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(26/27) 20270124	1,14
FR0014009DZ6	1.875000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26) 20261029	1,03
FR001400D0F9	4.125000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281011	1,04
FR001400LUK3	4.375000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20311113	1,02
BE0002838192	1.000000 % Cofinimmo S.A. EO-Bonds 2022(22/28) 20280123	0,77
XS2528582377	3.000000 % Compass Group Fin. Netherl. BV EO-Medium-Term Nts 2022(22/30) 20300307	0,84
XS2592240712	4.875000 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2023(29/30) 20300306	0,89
XS2428716000	1.375000 % Digital Intrepid Holding B.V. EO-Bonds 2022(22/32) 20320717	1,03
BE6340849569	3.625000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330117	0,86
FR001400KWR6	6.000000 % ELO S.A. EO-Medium Term Nts 2023(23/29) 20290321	1,27
XS2333297625	0.741000 % Eurogrid GmbH MTN v.2021(2021/2033) 20330420	0,66
XS2615183501	3.722000 % Eurogrid GmbH MTN v.2023(2023/2030) 20300426	1,38
XS2527319979	3.279000 % Eurogrid GmbH MTN v.2022(2022/2031) 20310904	1,26
XS2325565104	0.500000 % Fresenius Finance Ireland PLC EO-Med.-Term Nts 2021(28/28) 20280930	0,75

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS2325562697	0.875000 % Fresenius Finance Ireland PLC EO-Med.-Term Nts 2021(31/31) 20310930	0,68
XS2482872251	2.875000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2030/2030) 20300523	0,89
XS2559580548	4.250000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2026) 20260527	0,87
FR0014007VP3	0.875000 % Gecina S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/33) 20330124	0,89
XS2715302001	4.125000 % Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2023(23/33) 20331127	0,89
XS2303070911	0.250000 % H&M Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290824	0,71
XS2704918478	4.875000 % H&M Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20311024	0,90
XS2558916693	3.125000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281121	0,48
XS2455983861	1.375000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320310	0,49
XS2697483118	4.125000 % ING Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(26) 20261001	0,87
XS2529233814	4.750000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270905	0,78
XS2673808726	5.125000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(31) 20310828	0,86
XS2625196352	4.875000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30) 20300518	0,81
XS2317288301	0.375000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2021(21/30) Reg.S 20300317	0,86
XS2406890066	0.875000 % Kon. KPN N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33) 20331114	0,94
FR0014009EJ8	0.875000 % L'Oréal S.A. EO-Notes 2022(22/26) 20260628	1,18
FR001400HJE7	3.375000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 23(23/25) 20251020	0,09
FR001400KJP7	3.250000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 23(23/29) 20290906	0,09
FR0014008JQ4	2.500000 % Mercialis EO-Bonds 2022(22/29) 20290227	0,79
XS2347367018	1.375000 % Merlin Properties SOCIMI S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/30) 20300531	0,73
DE000MHB64E1	0.375000 % Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29) 20290308	0,71
XS2388449758	0.500000 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-Medium-Term Notes 2021(28) 20280920	0,75
XS2718201515	3.875000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310520	0,26
XS2598649254	3.875000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290315	0,24
XS2411166973	0.875000 % NN Group N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31) 20311122	0,87
XS2443893255	1.125000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2022(27) 20270215	1,06
XS2449330179	1.125000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20270929	0,80
XS2348030425	0.125000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Notes 2021(21/28) 20280603	0,98
DK0030484548	0.375000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280116	1,12
DK0030512421	4.625000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2023(29) 20290118	1,32
XS2596599147	4.500000 % Pandora A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280409	0,88
FR001400KPC2	3.750000 % Pernod Ricard S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330914	1,28
XS2343540519	0.500000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33) 20330523	0,81
XS2342227837	1.000000 % Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290516	0,73
XS2587306403	3.820000 % Sage Group PLC, The EO-Medium Term Nts 2023(23/28) 20280214	0,87
XS2679878319	4.375000 % Santander Consumer Bank AG EO Med.-Term Notes 2023(27) 20270912	0,51
XS2441296923	0.500000 % Santander Consumer Bank AS EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20250810	0,48
XS2432530637	0.500000 % Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2022(27) 20270113	0,51
FR001400N277	3.000000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2024(24/31) 20310109	0,68
FR001400F703	3.125000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29) 20291012	0,67
FR001400IJT3	3.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/28) 20280611	0,65
FR001400DT99	3.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20271108	0,66
FR001400IJU1	3.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330611	0,65
FR001400DTA3	3.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20321108	0,67
XS2332234413	0.125000 % SGS Nederland Holding B.V. EO-Medium-T.Notes 2021(21/27) 20270420	1,16
XS2616008970	3.750000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/30) 20300502	1,18

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS2616008541	3.750000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/26) 20261102	1,24
XS2619751576	3.875000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Notes 2023(28) 20280508	1,28
XS2643041721	4.125000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 2023(27) 20270628	1,29
FR00140060E7	0.500000 % Société Foncière Lyonnaise SA EO-Obl. 2021(21/28) 20280420	0,91
FR001400DZ01	4.250000 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2022(32) 20321115	0,77
XS2536730448	3.125000 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251221	0,85
XS2303089697	0.010000 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred MTN 2021(28) 20280217	0,75
XS2579319513	3.750000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20271122	1,51
XS2671251127	4.875000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Non-Pref. Med.-T.Nts 23(28) 20280823	0,89
XS2629062568	4.000000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/26) 20260531	0,86
XS2629064267	4.250000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290831	0,87
XS2547609433	4.000000 % Talanx AG MTN v.2022(2029/2029) 20291024	0,87
XS2623868994	3.750000 % Tele2 AB EO-Medium-Term Nts 2023(29/29) 20291121	0,86
XS2357205587	0.375000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290622	0,88
XS2607193435	3.625000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290420	1,29
XS2576550326	4.000000 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/27) 20270417	1,06
XS2725957042	4.125000 % Vestas Wind Systems A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310614	0,87
XS2597973812	4.125000 % Vestas Wind Systems A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26) 20260614	0,86
XS2449928543	1.500000 % Vestas Wind Systems Finance BV EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290614	0,78
XS2626022573	4.125000 % WPP Finance S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280529	1,31

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 29. Februar 2024.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>348.999.373,91</b>	<b>100,02</b>
1. Anleihen		343.608.373,94	98,47
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	52.125.564,73		14,94
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	110.943.775,58		31,79
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	83.869.383,43		24,04
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	96.669.650,20		27,70
2. Forderungen		5.159.377,86	1,48
3. Bankguthaben		231.622,11	0,07
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-56.359,27</b>	<b>-0,02</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>348.943.014,64</b>	<b>100,00</b>

<sup>1)</sup> Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.



# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 29. Februar 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
XS255178644	3,0000 % adidas AG - Anleihe 2022/2025	EUR		3.000	1.700	1.200	% 99,142	2.974.260,00	0,85
DE000BHYOQNO	0,3750 % Berlin Hyp AG - Inhaberschuldverschreibung 2022/2027	EUR		3.000	1.700	1.200	% 90,027	2.700.810,00	0,77
DE000BHYOSBO	1,7500 % Berlin Hyp AG - Pfandbriefe 2022/2032	EUR		4.474	6.260	1.786	% 90,804	4.062.570,96	1,16
XS2333297625	0,7410 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2021/2033	EUR		3.000	4.100	1.100	% 77,201	2.316.030,00	0,66
XS2527319979	3,2790 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2022/2031	EUR		4.500	2.600	1.800	% 97,597	4.391.865,00	1,26
XS2615183501	3,7220 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2023/2030	EUR		4.800	6.300	1.500	% 100,155	4.807.440,00	1,38
XS2482872251	2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA - Medium Term Notes 2022/2030	EUR		3.281	4.701	1.420	% 94,062	3.086.174,22	0,88
XS2559580548	4,2500 % Fresenius SE & Co. KGaA - Medium Term Notes 2022/2026	EUR		3.000	3.000	0	% 100,659	3.019.770,00	0,87
DE000MHB64E1	0,3750 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term IHS 2021/2029	EUR		3.000	3.000	0	% 82,835	2.485.050,00	0,71
XS2679878319	4,3750 % Santander Consumer Bank AG - Medium Term Notes 2023/2027	EUR		1.800	1.800	0	% 101,181	1.821.258,00	0,52
XS2547609433	4,0000 % Talanx AG - Medium Term Notes 2022/2029	EUR		3.000	1.700	1.200	% 101,732	3.051.960,00	0,87
							EUR	34.717.188,18	9,95
Ausland									
XS2626289222	4,8750 % 3i Group PLC - Medium Term Notes 2023/2029	EUR		2.974	4.270	1.296	% 103,571	3.080.201,54	0,88
XS2575555938	3,2500 % ABB Finance B.V. - Medium Term Notes 2023/2027	EUR		3.001	1.624	1.142	% 99,640	2.990.196,40	0,86
XS2351301499	0,7500 % ACEF Holding S.C.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR		2.974	1.919	1.396	% 85,396	2.539.677,04	0,73
XS2560411543	3,6250 % Achmea B.V. - Medium Term Notes 2022/2025	EUR		2.974	1.852	1.397	% 99,509	2.959.397,66	0,85
XS2386592484	0,1250 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR		2.974	1.919	1.396	% 86,781	2.580.866,94	0,74
XS2386592567	0,5000 % Adecco Intl Fin. Serv. B.V. - Medium Term Notes 2021/2031	EUR		2.974	1.919	1.396	% 79,968	2.378.248,32	0,68
XS2317288301	0,3750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. - Senior Notes 2021/2030	EUR		3.581	2.230	1.632	% 83,270	2.981.898,70	0,85
XS2462466611	1,5000 % Akzo Nobel N.V. - Anleihe 2022/2028	EUR		3.607	2.312	1.688	% 92,230	3.326.736,10	0,95
XS2462468740	2,0000 % Akzo Nobel N.V. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR		3.568	4.520	952	% 88,285	3.150.008,80	0,90
XS2531420730	2,6250 % Alliander N.V. - Medium Term Notes 2022/2027	EUR		3.001	3.001	2.451	% 97,798	2.934.917,98	0,84
DE000A3KY359	0,5000 % Allianz Finance II B.V. - Medium Term Notes 2021/2033	EUR		3.000	3.000	0	% 77,491	2.324.730,00	0,67
FR0014004QX4	0,1250 % Alstom S.A. - NTS (Notes) 2021/2027	EUR		3.000	1.700	1.200	% 88,147	2.644.410,00	0,76
FR0014004R72	0,5000 % Alstom S.A. - NTS (Notes) 2021/2030	EUR		4.200	2.500	1.800	% 79,654	3.345.468,00	0,96
XS2421195848	0,3750 % Aroundtown SA - Medium Term Notes 2021/2027	EUR		6.200	7.400	1.200	% 81,750	5.068.500,00	1,45
XS2473687106	2,2500 % ASML Holding N.V. - Registered Notes 2022/2032	EUR		2.681	3.725	1.044	% 93,892	2.517.244,52	0,72
XS2747590896	3,2120 % Assicurazioni Generali S.p.A. - Medium Term Notes 2024/2024	EUR		3.001	3.001	0	% 98,212	2.947.342,12	0,84
XS2747596315	3,5470 % Assicurazioni Generali S.p.A. - Medium Term Notes 2024/2024	EUR		4.451	4.451	0	% 97,576	4.343.107,76	1,24
XS2593105393	3,6250 % AstraZeneca PLC - Medium Term Notes 2023/2027	EUR		4.078	4.078	0	% 100,772	4.109.482,16	1,18
XS2593105476	3,7500 % AstraZeneca PLC - Medium Term Notes 2023/2032	EUR		4.016	6.079	2.063	% 102,485	4.115.797,60	1,18
XS2573807778	3,6250 % AXA S.A. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR		4.204	5.020	816	% 102,225	4.297.539,00	1,23
XS2537251170	3,7500 % AXA S.A. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR		4.217	3.073	2.438	% 102,809	4.335.455,53	1,24
XS2575952424	3,7500 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2023/2026	EUR		2.300	2.300	0	% 100,083	2.301.909,00	0,66
FR0014006CS9	0,5000 % Bouygues S.A. - Anleihe 2021/2030	EUR		4.000	2.700	2.700	% 84,676	3.387.040,00	0,97
FR001400AJX2	2,2500 % Bouygues S.A. - Anleihe 2022/2029	EUR		3.600	5.200	1.600	% 94,427	3.399.372,00	0,97
FR001400IBM5	3,8750 % Bouygues S.A. - Bonds 2023/2031	EUR		3.400	5.000	1.600	% 102,371	3.480.614,00	1,00
FR001400DNG3	4,6250 % Bouygues S.A. - Bonds 2022/2032	EUR		3.300	2.100	2.300	% 107,446	3.545.718,00	1,02
XS2496028502	2,7500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2022/2027	EUR		4.161	2.843	1.603	% 97,187	4.043.951,07	1,16

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2675225531	4,2500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	4.535	5.411	876	%	102,322	4.640.302,70	1,33
XS2690050682	5,0000 % BUPA Finance PLC - Guaranteed Notes 2023/2030	EUR	2.974	3.713	739	%	104,719	3.114.343,06	0,89
XS2708354811	4,7500 % CA Auto Bank S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	3.829	4.715	886	%	101,876	3.900.832,04	1,12
FR0014009DZ6	1,8750 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2022/2026	EUR	3.700	2.400	2.400	%	95,715	3.541.455,00	1,01
FR001400D0F9	4,1250 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2022/2028	EUR	3.500	5.600	2.100	%	102,555	3.589.425,00	1,03
FR001400LUK3	4,3750 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2023/2023	EUR	3.400	3.400	0	%	103,115	3.505.910,00	1,00
BE0002838192	1,0000 % Cofinimmo S.A. - Anleihe 2022/2028	EUR	3.000	1.700	1.200	%	89,559	2.686.770,00	0,77
XS2528582377	3,0000 % Compass Group Fin. Netherl. BV - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	2.974	1.852	1.397	%	97,667	2.904.616,58	0,83
XS2592240712	4,8750 % De Volksbank N.V. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	3.000	4.100	1.100	%	103,567	3.107.010,00	0,89
XS2428716000	1,3750 % Digital Intrepid Holding B.V. - Guaranteed Notes 2022/2032	EUR	4.451	6.387	1.936	%	80,017	3.561.556,67	1,02
BE6340849569	3,6250 % Elia Transm. Belgium N.V. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	3.000	1.700	1.200	%	100,183	3.005.490,00	0,86
FR001400KWR6	6,0000 % ELO S.A. - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	4.400	5.200	800	%	100,016	4.400.704,00	1,26
XS2325565104	0,5000 % Fresenius Finance Ireland PLC - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	2.982	1.856	1.350	%	87,455	2.607.908,10	0,75
XS2325562697	0,8750 % Fresenius Finance Ireland PLC - Medium Term Notes 2021/2031	EUR	2.982	1.856	1.350	%	79,591	2.373.403,62	0,68
FR0014007VP3	0,8750 % Gecina S.A. - Medium Term Notes 2022/2033	EUR	3.900	5.600	1.700	%	79,326	3.093.714,00	0,89
XS2715302001	4,1250 % Givaudan Finance Europe B.V. - Guaranteed Notes 2023/2033	EUR	3.001	3.001	0	%	103,377	3.102.343,77	0,89
XS2303070911	0,2500 % H&M Finance B.V. - Medium Term Notes 2021/2029	EUR	2.974	1.919	1.396	%	82,267	2.446.620,58	0,70
XS2704918478	4,8750 % H&M Finance B.V. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	2.974	3.713	739	%	104,458	3.106.580,92	0,89
XS2455983861	1,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	2.000	3.100	1.100	%	86,401	1.728.020,00	0,50
XS2558916693	3,1250 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2022/2028	EUR	1.700	4.800	3.100	%	99,249	1.687.233,00	0,48
XS2697483118	4,1250 % ING Bank N.V. - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	3.000	3.500	500	%	101,243	3.037.290,00	0,87
XS2529233814	4,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	2.567	2.567	0	%	102,512	2.631.483,04	0,75
XS2625196352	4,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	2.669	4.959	2.290	%	104,815	2.797.512,35	0,80
XS2673808726	5,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	2.819	3.430	611	%	106,363	2.998.372,97	0,86
XS2406890066	0,8750 % Kon. KPN N.V. - Medium Term Notes 2021/2033	EUR	4.200	4.200	0	%	77,672	3.262.224,00	0,93
FR0014009EJ8	0,8750 % L'Oréal S.A. - Anleihe 2022/2026	EUR	4.300	2.900	2.700	%	94,648	4.069.864,00	1,17
FR001400KJP7	3,2500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	300	1.500	1.200	%	99,948	299.844,00	0,09
FR001400HJE7	3,3750 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Medium Term Notes 2023/2025	EUR	300	3.000	2.700	%	99,835	299.505,00	0,09
FR0014008JQ4	2,5000 % Mercialis - Bonds 2022/2029	EUR	3.000	3.000	0	%	92,422	2.772.660,00	0,79
XS2347367018	1,3750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. - Medium Term Notes 2021/2030	EUR	3.000	3.000	0	%	84,956	2.548.680,00	0,73
XS2388449758	0,5000 % Nationale-Nederlanden Bank NV - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	3.000	1.700	1.200	%	86,972	2.609.160,00	0,75
XS2718201515	3,8750 % Neste Oyj - Medium Term Notes 2023/2023	EUR	871	871	0	%	101,162	881.121,02	0,25
XS2598649254	3,8750 % Neste Oyj - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	809	2.068	1.259	%	101,359	819.994,31	0,23
XS2411166973	0,8750 % NN Group N.V. - Medium Term Notes 2021/2031	EUR	3.568	2.386	1.801	%	83,918	2.994.194,24	0,86
XS2443893255	1,1250 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2022/2027	EUR	3.934	6.523	2.589	%	92,984	3.657.990,56	1,05
XS2348030425	0,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Registered Notes 2021/2028	EUR	3.866	2.457	1.809	%	88,092	3.405.636,72	0,98
XS2449330179	1,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	2.974	3.713	739	%	93,099	2.768.764,26	0,79
DK0030484548	0,3750 % Nykredit Realkredit A/S - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	4.451	4.563	3.825	%	87,135	3.878.378,85	1,11
DK0030512421	4,6250 % Nykredit Realkredit A/S - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	4.451	4.451	0	%	102,074	4.543.313,74	1,30
XS2596599147	4,5000 % Pandora A/S - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	2.974	4.270	1.296	%	102,397	3.045.286,78	0,87
FR001400KPC2	3,7500 % Pernod Ricard S.A. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	4.400	5.200	800	%	101,410	4.462.040,00	1,28

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2343540519	0,5000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. - Medium Term Notes 2021/2033		EUR	3.600	5.100	1.500	% 78,797	2.836.692,00	0,81
XS2342227837	1,0000 % Sagax EURO MTN NL B.V. - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	3.001	3.001	0	% 85,389	2.562.523,89	0,73
XS2587306403	3,8200 % Sage Group PLC, The - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	2.974	3.713	739	% 100,886	3.000.349,64	0,86
XS2441296923	0,5000 % Santander Consumer Bank AS - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	1.800	1.800	0	% 95,216	1.713.888,00	0,49
XS2432530637	0,5000 % Santander Consumer Finance SA - Medium Term Notes 2022/2027		EUR	1.900	1.900	0	% 91,246	1.733.674,00	0,50
FR001400N277	3,0000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2024/2031		EUR	2.400	2.400	0	% 97,854	2.348.496,00	0,67
FR001400F703	3,1250 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	2.300	1.300	2.000	% 99,182	2.281.186,00	0,65
FR001400DT99	3,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2022/2027		EUR	2.300	1.400	1.600	% 99,726	2.293.698,00	0,66
FR001400JIT3	3,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	2.300	3.300	1.000	% 99,924	2.298.252,00	0,66
FR001400DTA3	3,5000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	2.300	1.400	2.100	% 100,632	2.314.536,00	0,66
FR001400IJU1	3,5000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	2.200	3.800	1.600	% 100,719	2.215.818,00	0,64
XS2332234413	0,1250 % SGS Nederland Holding B.V. - Medium Term Notes 2021/2027		EUR	4.500	2.800	2.000	% 89,878	4.044.510,00	1,16
XS2616008541	3,7500 % Sika Capital B.V. - Guaranteed Registered Notes 2023/2026		EUR	4.249	6.453	2.204	% 100,603	4.274.621,47	1,23
XS2616008970	3,7500 % Sika Capital B.V. - Guaranteed Registered Notes 2023/2030		EUR	4.019	6.076	2.057	% 101,493	4.079.003,67	1,17
XS2619751576	3,8750 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	4.380	6.265	1.885	% 100,698	4.410.572,40	1,26
XS2643041721	4,1250 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2023/2027		EUR	4.368	4.368	0	% 101,650	4.440.072,00	1,27
FR00140060E7	0,5000 % Société Foncière Lyonnaise SA - Obligations 2021/2028		EUR	3.600	5.100	1.500	% 87,995	3.167.820,00	0,91
FR001400DZ01	4,2500 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	2.500	5.100	2.600	% 104,554	2.613.850,00	0,75
XS2303089697	0,0100 % SpareBank 1 SMN - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	2.974	1.919	1.396	% 86,997	2.587.290,78	0,74
XS2536730448	3,1250 % SpareBank 1 SMN - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	2.974	1.919	1.396	% 98,780	2.937.717,20	0,84
XS2579319513	3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Medium Term Notes 2023/2027		EUR	5.165	3.945	2.852	% 100,328	5.181.941,20	1,49
XS2671251127	4,8750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	3.001	3.001	0	% 103,721	3.112.667,21	0,89
XS2629062568	4,0000 % Stora Enso Oyj - Medium Term Notes 2023/2026		EUR	3.023	4.092	1.069	% 100,018	3.023.544,14	0,87
XS2629064267	4,2500 % Stora Enso Oyj - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	2.995	4.077	1.082	% 101,340	3.035.133,00	0,87
XS2623868994	0,0000 % Tele2 AB - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	2.974	4.270	1.296	% 100,063	2.975.873,62	0,85
XS2357205587	0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	3.568	2.386	1.801	% 85,257	3.041.969,76	0,87
XS2607193435	3,6250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	4.451	6.183	1.732	% 100,180	4.459.011,80	1,28
XS2576550326	4,0000 % Thames Water Utilities Fin.PLC - Medium Term Notes 2023/2027		EUR	3.853	5.560	1.707	% 94,871	3.655.379,63	1,05
XS2449928543	1,5000 % Vestas Wind Systems Finance BV - Anleihe 2022/2029		EUR	2.974	1.919	1.396	% 90,343	2.686.800,82	0,77
XS2725957042	4,1250 % Vestas Wind Systems A/S - Medium Term Notes 2023/2023		EUR	3.001	3.001	0	% 101,633	3.050.006,33	0,87
XS2597973812	4,1250 % Vestas Wind Systems A/S - Medium Term Notes 2023/2026		EUR	2.974	4.370	1.396	% 100,499	2.988.840,26	0,86
XS2626022573	4,1250 % WPP Finance S.A. - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	4.451	6.244	1.793	% 101,282	4.508.061,82	1,29
Summe Wertpapiervermögen							EUR	308.891.185,76	88,52
							EUR	343.608.373,94	98,47
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	231.622,11	0,07
EUR-Guthaben bei:									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	231.622,11			% 100,000	231.622,11	0,07
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	5.159.377,86	1,48
Abgegrenzte Stückzinsen Anleihen			EUR	152.323,98				152.323,98	0,04
Zinsansprüche			EUR	5.007.053,88				5.007.053,88	1,43
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-56.359,27	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-56.359,27				-56.359,27	-0,02
Fondsvermögen							EUR	348.943.014,64	100,00 <sup>1)</sup>

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Anteilwert						EUR	87,42	
	Umlaufende Anteile						STK	3.991.459,00	

<sup>1)</sup> 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 29.02.2024

## 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
<b>Inland</b>					
XS2171713006	1,1130 % Eurogrid GmbH - Anleihe 2020/2032	EUR	500		4.200
DE000A289NX4	0,6250 % Evonik Industries AG - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	300		2.800
XS2178769159	1,5000 % Fresenius Medical Care KGaA - Medium Term Notes 2020/2030	EUR	450		4.163
XS2152329053	1,6250 % Fresenius SE & Co. KGaA - Anleihe 2020/2027	EUR	98		3.811
XS2482872418	1,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA - Anleihe 2022/2025	EUR	1.785		5.468
XS2559501429	5,0000 % Fresenius SE & Co. KGaA - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	2.700		2.700
XS2407955827	0,5000 % Henkel AG & Co. KGaA - Medium Term Notes 2021/2032	EUR	6.200		6.200
XS2232027727	1,6250 % KION GROUP AG - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	500		3.000
XS2171210862	0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Anleihe 2020/2025	EUR	100		4.500
XS2525157470	2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term IHS 2022/2027	EUR	100		3.300
XS2176715584	0,1250 % SAP SE - Anleihe 2020/2026	EUR	400		3.400
XS2176715667	0,3750 % SAP SE - Anleihe 2020/2029	EUR	400		4.400
DE000A2GSR47	0,0100 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen - Inhaberschuldverschreibung 2020/2027	EUR	100		2.600
DE000A3SJT2	2,6250 % Wirt.u.Infrastrukturbk. Hessen - Inhaberschuldverschreibung 2023/2033	EUR	100		3.100
<b>Ausland</b>					
XS2575556589	3,3750 % ABB Finance B.V. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	4.077		4.077
XS2348638433	1,0000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2021/2033	EUR	7.000		7.000
XS2487054939	3,0000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	4.100		4.100
XS2401704189	1,2500 % ACEF Holding S.C.A. - EO-Notes 2021/2030	EUR	0		2.451
XS2175967343	1,5000 % Achmea B.V. - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	464		4.177
XS2150015555	1,7500 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. - Senior Notes 2020/2027	EUR	0		2.451
XS2341269970	1,1250 % Aker BP ASA - Medium Term Notes 2021/2029	EUR	311		3.929
XS2236363573	1,8750 % Amadeus IT Group S.A. - Medium Term Notes 2020/2028	EUR	2.900		2.900
XS2177555062	2,8750 % Amadeus IT Group S.A. - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	2.700		2.700
XS2347663507	0,3750 % AstraZeneca PLC - Medium Term Notes 2021/2029	EUR	849		4.822
FR0013510179	2,8750 % Auchan Holding S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	100		4.000
XS2288925568	1,0000 % Balder Finland Oyj - Medium Term Notes 2021/2029	EUR	3.639		3.639
XS2432565005	1,0000 % Balder Finland Oyj - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	1.752		4.271
XS2496028924	3,3750 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	0		2.451
XS2582814039	3,7500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	4.718		4.718
XS2633552026	4,3750 % CA Auto Bank S.p.A. (Irish Br) - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	5.069		5.069
XS2530034649	3,7500 % Caixabank S.A. - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	900		4.700
FR0013519071	1,1250 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2030	EUR	4.300		4.300
FR0013507878	2,3750 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2032	EUR	100		4.400
FR0013505260	2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027	EUR	100		3.900
FR001400HU68	3,7500 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	2.900		2.900
XS2461785185	2,0000 % Castellum Helsinki Fin.Hol.Abp - Anleihe 2022/2025	EUR	598		3.049
XS2404629235	0,3750 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	5.419		5.419
FR0013519279	1,6250 % Covivio S.A. - Obligations 2020/2030	EUR	300		2.800
ES0205045026	0,8750 % Criteria Caixa S.A.U. - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	3.500		3.500
XS2171316859	0,6250 % Danske Bank A/S - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	5.065		5.065
XS2356091269	0,2500 % De Volksbank N.V. - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	4.000		4.000
XS2400445289	0,5000 % Dell Bank International DAC - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	300		2.819
XS2545259876	4,5000 % Dell Bank International DAC - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	602		3.053
XS2232115423	1,0000 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2032	EUR	810		4.523
XS2191362859	1,2500 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2031	EUR	2.768		2.768
XS2280835260	0,6250 % Digital Intrepid Holding B.V. - Guaranteed Registered Notes 2021/2031	EUR	2.663		7.614
XS2459544339	1,8750 % EDP Finance B.V. - Anleihe 2022/2029	EUR	5.200		5.200
XS2542914986	3,8750 % EDP Finance B.V. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	3.049		3.049
BE6321529396	0,8750 % Elia Transmission Belgium N.V. - Medium Term Notes 2020/2030	EUR	100		4.100
FR0013524865	3,2500 % ELO S.A - Anleihe 2020/2027	EUR	500		4.200
FR001400EHH1	4,8750 % ELO S.A. - Medium Term Notes 2022/2028	EUR	3.800		3.800
XS2126169742	1,0000 % Givaudan Finance Europe B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2027	EUR	0		2.451

# 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
XS2282101539	0,1250 % Grand City Properties S.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	2.400		7.400
XS2240507801	2,1250 % Informa PLC - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	743		4.228
XS2317069685	0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	873		5.160
XS2304664597	1,3500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2031	EUR	0		3.729
XS2179037697	2,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	702		4.495
XS2625195891	4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	4.760		4.760
XS2592658947	5,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	4.498		4.498
FR001400G412	3,3750 % Kering S.A. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	4.500		4.500
FR0013512233	2,0000 % Klépierre S.A. - Anleihe 2020/2029	EUR	400		3.400
FR0013482833	0,1250 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2028	EUR	100		3.800
FR0013482841	0,3750 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Medium Term Notes 2020/2031	EUR	100		3.900
FR0013506508	0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2025	EUR	100		3.400
FR001400KJ00	3,5000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	1.800		1.800
XS2574870759	3,5000 % Motability Operations Grp PLC - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	4.270		4.270
XS2473346299	2,0000 % Nationwide Building Society - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	6.400		6.400
XS2599779579	4,2500 % Neste Oyj - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	2.874		2.874
XS2524740649	2,8750 % Nordea Bank Abp - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	5.350		5.350
XS2441244535	0,7500 % Novo Nordisk Finance [Netherlands] B.V. - Anleihe 2022/2025	EUR	598		3.049
XS2441247041	1,3750 % Novo Nordisk Finance [Netherlands] B.V. - Anleihe 2022/2030	EUR	0		2.451
DK0030467105	0,2500 % Nykredit Realkredit A/S - Medium Term Notes 2020/2026	EUR	5.596		5.596
DK0009529901	0,5000 % Nykredit Realkredit A/S - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	464		4.177
DK0030045703	4,0000 % Nykredit Realkredit A/S - Medium Term Notes 2015/2035	EUR	5.438		5.438
FR001400DP44	3,7500 % Pernod Ricard S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	2.900		2.900
FR0014009L57	1,3750 % Pernod-Ricard S.A. - Senior Notes 2022/2029	EUR	100		3.800
FR0013506532	1,7500 % Pernod-Ricard S.A. - Anleihe 2020/2030	EUR	100		4.300
XS2291340433	0,7500 % Sagax EURO MTN NL B.V. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	3.613		3.613
FR0013494168	0,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2020/2029	EUR	100		4.100
XS2526839175	2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2022/2025	EUR	100		3.200
XS2128499105	2,3750 % Signify N.V. - Senior Notes 2020/2027	EUR	400		3.383
XS2442768227	0,7500 % Skandinaviska Enskilda Banken AB - Anleihe 2022/2027	EUR	0		4.044
XS2583600791	3,7500 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	4.412		4.412
XS2553798443	4,0000 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2022/2026	EUR	2.135		5.767
FR0013515871	1,5000 % Société Foncière Lyonnaise SA - Obligations 2020/2027	EUR	400		3.400
FR0013486701	0,1250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	100		4.100
FR001400DZM5	4,0000 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	5.000		5.000
FR001400IDW0	4,1250 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	4.000		4.000
XS2163320679	0,7500 % Sodexo S.A. - Senior Notes 2020/2025	EUR	109		3.576
XS2163333656	1,0000 % Sodexo S.A. - Senior Notes 2020/2029	EUR	104		4.115
XS2308586911	0,1250 % SPAREBANK 1 OSTLANDET - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	2.768		2.768
XS2472845911	1,7500 % SPAREBANK 1 OSTLANDET - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	2.768		2.768
XS2534276808	2,8750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Medium Term Notes 2022/2025	EUR	1.819		4.270
XS2156787090	1,2500 % SSE PLC - Anleihe 2020/2025	EUR	100		3.083
XS2265360359	0,6250 % Stora Enso Oyj - Anleihe 2020/2030	EUR	1.819		4.270
FR001400DQ84	4,6250 % Suez S.A. - Medium Term Notes 2022/2028	EUR	100		3.700
XS2121207828	0,5000 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2020/2030	EUR	125		4.872
XS2156510021	1,0000 % Svenska Handelsbanken AB - Anleihe 2020/2025	EUR	110		4.338
XS2588099981	3,3750 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	6.432		6.432
XS2618499177	3,7500 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	6.225		6.225
XS2485152362	2,1000 % Swedbank AB - Anleihe 2022/2027	EUR	107		4.228
XS2555192710	3,7500 % Swedbank AB - Medium Term Notes 2022/2025	EUR	100		3.935
XS2484587048	2,5920 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2022/2031	EUR	2.500		6.500
XS2237901355	0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Anleihe 2020/2030	EUR	598		3.049
FR0014000UC8	0,6250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	100		4.600
FR0014000UD6	1,3750 % Unibail-Rodamco-Westfield SE - Medium Term Notes 2020/2031	EUR	200		5.100
XS2147133578	1,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. - Anleihe 2020/2030	EUR	111		3.532
XS2199604096	1,3750 % UNIQA Insurance Group AG - NTS (Notes) 2020/2030	EUR	400		3.400
XS2257961818	0,1250 % UPM Kymmene Corp. - Medium Term Notes 2020/2028	EUR	464		4.177
XS2320453884	0,5000 % UPM Kymmene Corp. - Medium Term Notes 2021/2031	EUR	598		3.049
XS2489138789	3,2500 % Urenco Finance N.V. - Anleihe 2022/2032	EUR	0		2.451
XS2198580271	0,7500 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2020/2030	EUR	0		2.451
XS2530756191	3,0000 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2022/2026	EUR	0		2.451
XS2176562812	2,3750 % WPP Finance S.A. - Anleihe 2020/2027	EUR	464		4.177

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.03.2023 bis zum 29.02.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		825.301,50	0,207
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		7.309.898,49	1,831
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		59.489,43	0,015
4. Sonstige Erträge		0,01	0,000
Summe der Erträge		8.194.689,43	2,053
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-3.115,87	-0,001
2. Verwaltungsvergütung		-618.850,82	-0,155
Summe der Aufwendungen		-621.966,69	-0,156
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		7.572.722,74	1,897
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		3.469.032,22	0,869
2. Realisierte Verluste		-11.774.550,03	-2,950
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-8.305.517,81	-2,081
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-732.795,07	-0,184
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		2.959.557,52	0,741
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		13.336.577,25	3,341
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		16.296.134,77	4,083
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		15.563.339,70	3,899

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2023 / 2024 EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		328.341.175,35
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-897.634,57
2. Zwischenausschüttungen		-5.561.856,37
3. Mittelzufluss (netto)		11.346.469,64
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	162.858.656,64	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-151.512.187,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		151.520,89
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		15.563.339,70
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	2.959.557,52	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	13.336.577,25	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		348.943.014,64

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		7.557.585,87	1,893
1. Vortrag aus dem Vorjahr		0,00	0,000
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-732.795,07	-0,184
3. Zuführung aus dem Sondervermögen <sup>2)</sup>		8.290.380,94	2,077
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		-0,00	0,000
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		-0,00	0,000
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		7.557.585,87	1,893
1. Zwischenausschüttung		5.561.856,37	1,393
2. Endausschüttung		1.995.729,50	0,500

<sup>1)</sup> Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

<sup>2)</sup> 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
2023/2024	348.943.014,64	87,42
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	87,42
Umlaufende Anteile	STK	3.991.459,00

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**

**98,47**

**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 29.02.2024 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 29.02.2024 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 Marker 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)	0,17
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,45

Der im Geschäftsjahr 2023/2024 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.

#### 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/ueber-uns/deka-investment-im-profil/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 Mitarbeitenden 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. 10 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 Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeitenden, 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 Mitarbeitenden 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 Mitarbeitenden 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 Mitarbeitenden, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitenden (zusammen als "risikorelevante Mitarbeitende") unterliegt folgenden Regelungen:

· Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeitenden ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeitenden 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 Mitarbeitenden unterhalb der Geschäftsführungsebene 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 Mitarbeitenden, 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 Mitarbeitende, 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 2023 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 2023 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

	EUR
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitendenvergütung</b>	<b>63.521.373,38</b>
davon feste Vergütung	47.888.259,53
davon variable Vergütung	15.633.113,85
Zahl der Mitarbeitenden der KVG	489
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitendengruppen**</b>	<b>8.109.790,91</b>
Geschäftsführer	2.091.060,65
weitere Risk Taker	2.336.833,98
Mitarbeitende mit Kontrollfunktionen	434.400,67
Mitarbeitende in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risk Taker	3.247.495,61

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

\*\* weitere Risk Taker: alle sonstigen Risk Taker, die nicht Geschäftsführer oder Risk Taker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeitende in Kontrollfunktionen: Mitarbeitende in Kontrollfunktionen, die als Risk Taker identifiziert wurden und nicht Geschäftsführer sind. Mitarbeitende in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risk Taker: Mitarbeitende, die nicht Geschäftsführer oder Risk Taker sind und sich auf derselben Einkommensstufe wie Risk Taker oder Geschäftsführer befinden.



**Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 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. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

**Name des Produkts:**

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF

**Unternehmenskennung (LEI-Code):**

5299006NGBYLKA0NUU17

## Nachhaltiges Investitionsziel

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 99,52%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es  % an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt:  %

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Der Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF ist ein passiv gemanagter börsen gehandelter 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 CO<sub>2</sub>-Emissionen des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindexe 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 CO<sub>2</sub>-emissionsarmen Wirtschaft sind und wie gut

diese Risiken im Unternehmen gemanagt werden. Grundlage für die Zuordnung des LCT-Scores ist die CO<sub>2</sub>-Intensität eines Unternehmens. Die CO<sub>2</sub>-Intensität ist eine Kennzahl, die ausdrückt, wie hoch die CO<sub>2</sub>-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 abgereichertem Uran, biologische/chemische Waffen, Blendlaser, nicht nachweisbare Splitter und Brandwaffen mit weißem Phosphor) in Verbindung standen.
- die mehr als 5% ihrer Umsätze mit Waffensystemen, Komponenten oder unterstützenden Systemen und Dienstleistungen erzielten
- 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 Umsätze aus dem Abbau von Kohle und dem Verkauf an externe Parteien erzielten.
- 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus Kohleverstromung erzielten.
- die mehr als 0 % ihres Umsatzes mit unkonventionellem Erdöl und Erdgas erzielten.
- 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 Atomkraftwerke betrieben oder besaßen.
- mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielten.
- mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Uranabbau erzielten.
- 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 ESGRating von "CCC" oder "B", 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.
- mit einer CO<sub>2</sub>Emissionsintensität (gemessen in Scope1 und 2 CO<sub>2</sub>e/ 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.

Darüber hinaus wurden im Laufe des Berichtszeitraums zweimal Ausschlusskriterien angepasst oder neu eingeführt.

Mit Wirkung vom 01.05.2023 wurden dadurch keine Wertpapiere von Unternehmen mehr in den Index aufgenommen,

- die in irgendeiner Weise mit Nuklearwaffen in Verbindung stehen.
- die mehr als 5% ihres Umsatzes mit der Lieferung wichtiger nuklearspezifischer Produkte oder Dienstleistungen für die Kernkraftindustrie erzielten.
- die mehr als 5% ihres Umsatzes durch die Produktion von Handfeuerwaffen erzielten.

Außerdem wurden am 01.11.2023 die Ausschlusskriterien im Index erweitert. Der Index sieht keine Investitionen in Wertpapiere von Unternehmen vor,

- die 5 % oder mehr ihres Umsatzes aus Kohleverstromung erzielten.
- die 5 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Förderung von Erdöl und Erdgas erzielten.
- die 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz aus/von fossilen Brennstoffen generierten.

Darüber hinaus tätigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungs-Verordnung ((EU) 2019/2088). Das nachhaltige Anlageziel des Fonds ist es, mittels Abbildung einer EU Climate Transition Benchmark die gewichtete CO<sub>2</sub>-Intensität des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant zu reduzieren.

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?“.

Der MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select (Preisindex) wurde als Referenzwert definiert, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf das nachhaltige Investitionsziel ausgerichtet ist. Der Index erfüllt zudem 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. Durch die dynamischen Umgewichtungsfaktoren der im Index enthaltenen Unternehmen wird sichergestellt, dass eine Reduktion der CO<sub>2</sub>-Intensität von mindestens 30% im Vergleich zu einem breiten Marktindex erfolgt. Darüber hinaus wird sichergestellt, dass die gewichtete CO<sub>2</sub>-Intensität des Portfolios jährlich um mindestens 7% im Vergleich zum Vorjahr sinkt.

### ● **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. CO2-Emissionen

Der Indikator „CO2-Emissionen“ betrug im Berichtszeitraum 9.327.125,34 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 den nach Anteil der Unternehmen am Fondsvolumen gewichteten CO2-Emissionen der Unternehmen, gemessen in tCO2e. Der Indikator basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt die Datenlage an den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums wider.

In der unten dargestellten Tabelle wird unter „nicht nachhaltige Investitionen“ für die letzte Berichtsperiode der Wert von „2 Andere Investitionen“ und „1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ ausgewiesen. Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug für die letzte Berichtsperiode 6,75%. Die Abweichung resultiert aus der Offenlegung im letzten Berichtsjahr unter Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088.

### ● ...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Referenzperiode	01.03.2023- 29.02.2024	01.03.2022- 28.02.2023
Anzahl Verletzungen der Ausschlusskriterien	0,00	0,00
	Verletzungen	Verletzungen
CO2-Emissionen	9.327.125,34 tCO2e	10.737.489,73 tCO2e
Anteil nachhaltige Investitionen	99,52%	31,50%
Anteil Investitionen mit Umweltziel	99,52%	24,75%
Anteil der taxonomiekonformen Investitionen	0,00%	0,00%
Anteil Investitionen mit anderen Umweltzielen	99,52%	24,75%
Anteil Investitionen mit sozialem Ziel	0,00%	0,00%
Anteil nicht nachhaltige Investitionen	0,48%	68,50%

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 wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Damit die nachhaltigen Investitionen den nachhaltigen 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 CO<sub>2</sub>-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.

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.



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

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 wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzproduktes erreicht?“.

Im Berichtszeitraum waren insbesondere keine Unternehmen mehr im Index enthalten, deren CO<sub>2</sub>-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 wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzproduktes erreicht?“.

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

- Treibhausgasemissionen (PAI 1 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (PAI 4 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (PAI 5 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Emissionen in Wasser (PAI 8 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (PAI 9 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (PAI 12 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress (PAI 8 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 2)

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>.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 01.03.2023 - 29.02.2024

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
Sparebank 1 SR-Bank ASA MTN 23/27 (XS2579319513)	Banken	1,37%	Norwegen
AXA S.A. MTN 22/30 (XS2537251170)	Versicherungen	1,22%	Frankreich
Terna Rete Elettrica Nazio.SpA MTN 23/29 (XS2607193435)	Versorgungsbetriebe	1,19%	Italien
Eurogrid GmbH MTN 22/31 (XS2527319979)	Versorgungsbetriebe	1,18%	Deutschland
L'Oréal S.A. Notes 22/26 (FR0014009EJ8)	Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	1,17%	Frankreich
Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 22/32 (DE000BHY05B0)	Finanzdienstleistungen	1,11%	Deutschland
Bouygues S.A. Bonds 22/32 (FR001400DNG3)	Investitionsgüter	1,08%	Frankreich
SGS Nederland Holding B.V. MTN 21/27 (XS2332234413)	Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	1,08%	Niederlande
Carrefour S.A. MTN 22/28 (FR001400D0F9)	Vertrieb und Einzelhandel von Basiskonsumgütern	1,07%	Frankreich
Thames Water Utilities Fin.PLC MTN 23/27 (XS2576550326)	Finanzdienstleistungen	1,05%	Vereinigtes Königreich
Carrefour S.A. MTN 22/26 (FR0014009DZ6)	Vertrieb und Einzelhandel von Basiskonsumgütern	1,02%	Frankreich
Bouygues S.A. Bonds 21/30 (FR0014006CS9)	Investitionsgüter	1,01%	Frankreich
British Telecommunications PLC MTN 22/27 (XS2496028502)	Telekommunikationsdienste	1,01%	Vereinigtes Königreich
Svenska Handelsbanken AB Preferred MTN 23/28 (XS2588099981)	Banken	0,97%	Schweden
Société Générale S.A. Pref. MTN 22/32 (FR001400DZO1)	Banken	0,95%	Frankreich



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

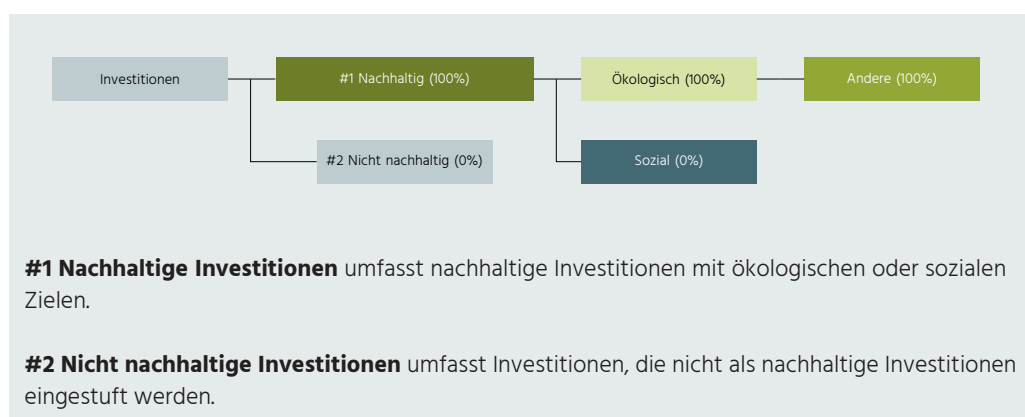
### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels beitrugen (#1 Nachhaltig) betrug im Berichtszeitraum 99,52%. Darunter fallen alle Investitionen, die die im Rahmen der verbindlichen Elemente der ESG-Anlagestrategie definierten Ausschlusskriterien des Fonds einhielten und Teil des CTB-konformen Index waren.



Eine Beschreibung der Investitionen, die nicht auf das nachhaltige Investitionsziel des Fonds ausgerichtet waren, findet sich im Abschnitt „Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige 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 Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums dar und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Geringfügige Abweichungen in der prozentualen Gewichtung der Investitionen resultieren aus rundungsbedingten Differenzen



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

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

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

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 3,03% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilsektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC zurückgegriffen. Der Anteil beinhaltet Unternehmen, die Umsätze im Bereich der fossilen Brennstoffe, einschließlich der Förderung, Verarbeitung, Lagerung und dem Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie thermischer und metallurgischer Kohle erwirtschaften.

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

<b>Sektor</b>	<b>Anteil</b>
<b>Basiskonsumgüter</b>	<b>6,94%</b>
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	1,49%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	1,00%
Vertrieb und Einzelhandel von Basiskonsumgütern	4,45%
<b>Energie</b>	<b>0,80%</b>
Energie	0,80%
<b>Finanzwesen</b>	<b>34,36%</b>
Banken	19,30%
Finanzdienstleistungen	9,14%
Versicherungen	5,92%
<b>Gesundheitswesen</b>	<b>7,06%</b>
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	3,66%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	3,40%
<b>Immobilien</b>	<b>8,35%</b>
Gebäudemanagement & Immobilienentwicklung	3,04%
Immobilienvermögensgesellschaften	5,31%
<b>Industrie</b>	<b>15,44%</b>
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	3,24%
Investitionsgüter	12,20%
<b>Informationstechnologie</b>	<b>2,29%</b>
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	0,54%
Hardware & Ausrüstung	0,56%
Software & Dienste	1,19%
<b>Kommunikationsdienste</b>	<b>5,71%</b>
Medien & Unterhaltung	1,70%
Telekommunikationsdienste	4,01%
<b>Nicht-Basiskonsumgüter</b>	<b>4,19%</b>
Dienstleistungsunternehmen	0,37%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	2,69%
Vertrieb u. Einzelhandel für Nicht-Basiskonsumgüter	1,13%
<b>Roh-, Hilfs- &amp; Betriebsstoffe</b>	<b>5,77%</b>
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	5,77%
<b>Sonstige</b>	<b>0,48%</b>
Sonstige	0,48%
<b>Versorgungsbetriebe</b>	<b>8,59%</b>
Versorgungsbetriebe	8,59%



### **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%.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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

Ja:

In fossiles Gas       In Kernenergie

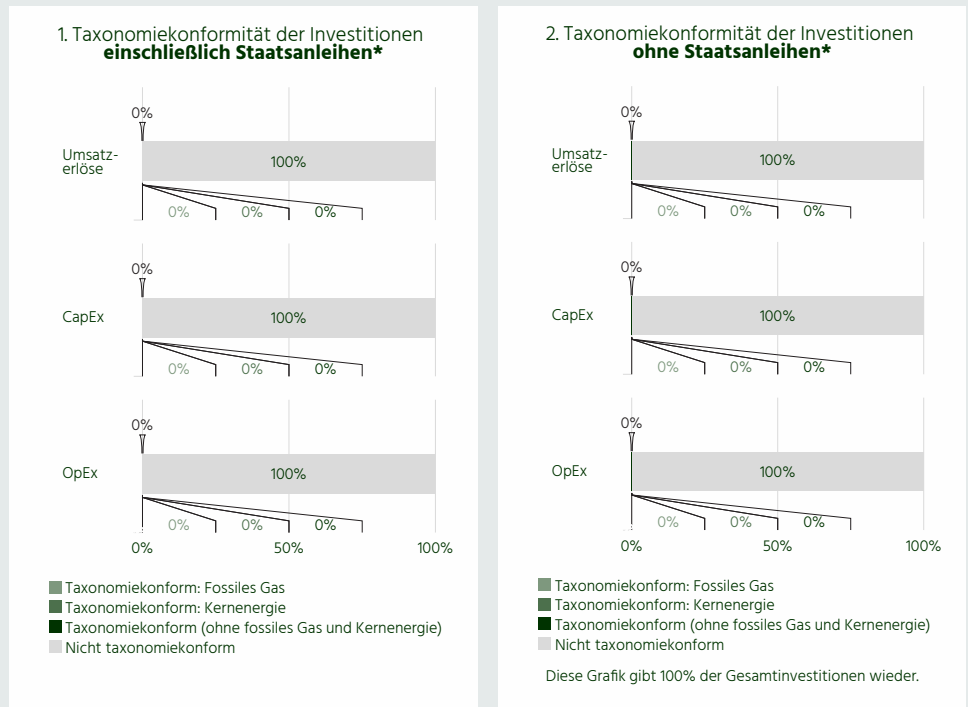
Nein

<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**




\*Für die Zwecke dieser Grafiken 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 Wirtschaftstätigkeiten**, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-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 EU-Taxonomie **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 mittels Abbildung einer EU Climate Transition Benchmark die gewichtete CO<sub>2</sub>-Intensität des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant reduziert. Zudem musste der Index sicherstellen, dass die CO<sub>2</sub>-Intensität jährlich um mindestens 7 % im Vergleich zum Vorjahr sinkt. So wird dafür Sorge getragen, dass die CO<sub>2</sub>-Intensität einem Transitionspfad folgt, der mit den Zielen des Pariser Klimaabkommens übereinstimmt. Gezielt Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten zu tätigen, die als taxonomiekonform gelten, sind nicht Teil der Anlagestrategie. Demnach investierte das Finanzprodukt in Wirtschaftstätigkeiten mit Umweltzielen, die nicht taxonomiekonform sind.

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel betrug 99,52%.

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



**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 des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Die Überwachung der Konformität der Investitionsentscheidungen mit dem nachhaltigen Investitionsziel 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 Februar, Mai, August und November) 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 Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

### ● 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 CO<sub>2</sub>-Emissionen des Portfolios um 30% gegenüber einem breiten Marktindex reduziert

werden. Darüber hinaus sorgt die Umgewichtung dafür, dass die CO<sub>2</sub>-Emissionen des Portfolios jährlich um mindestens 7% im Vergleich zum Vorjahr sinken. 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 das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

01.03.2023 - 29.02.2024	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF
CO <sub>2</sub> -Emissionen (in tCO <sub>2</sub> e)	9.327.125,34

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

01.03.2023 - 29.02.2024	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF	Referenzindex
CO <sub>2</sub> -Emissionen (in tCO <sub>2</sub> e)	9.327.125,34	9.632.040,77

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

01.03.2023 - 29.02.2024	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF	Breiter Marktindex
CO <sub>2</sub> -Emissionen (in tCO <sub>2</sub> e)	9.327.125,34	45.472.194,53

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 27. Mai 2024  
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 2023 bis zum 29. Februar 2024, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 29. Februar 2024, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. März 2023 bis zum 29. Februar 2024 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.

Die im Abschnitt „Sonstige Informationen“ unseres Vermerks genannten Bestandteile des Jahresberichts haben wir in Einklang mit den deutschen gesetzlichen Vorschriften bei der Bildung unseres Prüfungsurteils zum Jahresbericht nicht berücksichtigt.

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. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf den Inhalt der im Abschnitt „Sonstige Informationen“ genannten Bestandteile des Jahresberichts.

## 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 Deka Investment GmbH 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, den Abschnitt „Nachhaltiges Investitionsziel“ des Jahresberichts sowie die übrigen Darstellungen und Ausführungen zum Sondervermögen mit Ausnahme der in § 101 KAGB aufgeführten und geprüften Bestandteile des Jahresberichts sowie unseres Vermerks.

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 Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

## Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Deka Investment GmbH 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 einzu beziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH 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 Deka Investment GmbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Deka Investment GmbH 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 Deka Investment GmbH 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 Deka Investment GmbH 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 29. Mai 2024

### 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 2022

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

### Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 29. Februar 2024

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



**Deka Investment GmbH**

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

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

