

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2024.

**Deka EURO STOXX 50 ESG  
Filtered UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der EURO STOXX 50 ESG Filtered (Preisindex) ist das geistige Eigentum (inklusive registrierte Marken) der STOXX Ltd., Zug, Schweiz ("STOXX"), der Gruppe Deutsche Börse oder deren Lizenzgeber und wird unter einer Lizenz verwendet. Deka EURO STOXX 50® ESG Filtered UCITS ETF ist weder gefördert noch beworben, vertrieben oder in irgendeiner anderen Weise von STOXX, der Gruppe Deutsche Börse oder von deren Lizenzgebern, Forschungspartnern oder Datenlieferanten unterstützt und STOXX, die Gruppe Deutsche Börse und deren Lizenzgeber, Forschungspartner oder Datenlieferanten übernehmen keinerlei Gewährleistung und schliessen jegliche Haftung (aus fahrlässigem sowie aus anderem Verhalten) diesbezüglich generell aus und im speziellen in Bezug auf jegliche Fehler, Unterlassungen oder Störungen des EURO STOXX 50 ESG Filtered (Preisindex) oder der darin enthaltenen Daten. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

# Bericht der Geschäftsführung.

31. Juli 2024

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2024 bis zum 31. Juli 2024.

Der Trend nachlassenden Inflationsdrucks stabilisierte in den vergangenen sechs Monaten die Finanzmärkte und verlieh den Aktienbörsen weiterhin kräftigen Auftrieb. Zudem überzeugten die USA mit einer dynamischen Konjunktur und auch die Eurozone lieferte für das zweite Quartal einen BIP-Anstieg von 0,3 Prozent. In Deutschland blieb die wirtschaftliche Entwicklung hingegen spürbar verhaltener. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken ist weiterhin auf die Inflationsbekämpfung ausgerichtet. Ende 2023 hatten Signale hinsichtlich einer Entspannung an der Preisfront für sehr freundliche Rentenmärkte gesorgt. Die Erwartungen an rasche Leitzinssenkungen wurde im weiteren Verlauf jedoch ausgepreist. Im ersten Quartal 2024 sorgten die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und zwischenzeitlich wieder steigende Renditen. Die Fed behielt über die Berichtsperiode das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei. Die EZB senkte hingegen den Hauptrefinanzierungssatz im Juni von 4,50 Prozent auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger Euroland-Staatsanleihen lag Ende Juli bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,0 Prozent. Damit legten die Renditen auf Halbjahressicht leicht zu.

Die globalen Zinssenkungserwartungen waren ein Antriebsfaktor für die Kurse der weltweiten Aktienmärkte, die sich in der Breite in einer freundlichen Verfassung zeigten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten zwischenzeitlich jeweils auf ein Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Die großen US-Technologiewerte mit Bezug zum Trendthema Künstliche Intelligenz verzeichneten dabei die stärksten Zuwächse, ehe im letzten Monat eine Korrektur einsetzte.

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige 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.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Juli 2024	9
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2024	10
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS 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 EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered (Preisindex) nachzubilden.

Der EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered Index umfasst Aktien von großen Unternehmen mit Sitz in der Eurozone. 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.

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 Aktien aufgrund von Indexanpassungen und Rücknahme von Anteilscheinen.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

Performance*	6 Monate
	8,11%
ISIN	DE000ETFL466

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered 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>
Löschung	FR0010908533	Edenred SE Actions Port. EO 2
Löschung	FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40
Löschung	NL0011821392	Signify N.V. Registered Shares EO -,01
Löschung	IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001
Löschung	BE0974320526	Umicore S.A. Actions Nom. o.N.
Neuaufnahme	NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01
Neuaufnahme	FR0010220475	Alstom S.A. Actions Port. EO 7
Neuaufnahme	DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.
Neuaufnahme	FR0000121147	Forvia SE Actions Port. EO 7
Neuaufnahme	AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien o.N.

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	8,89
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	7,80
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	6,54
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	5,01
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	4,28
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	4,00
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	3,78
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	3,28
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	2,78
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	2,76
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	2,65
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	2,54
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	2,50
FR0000120628	AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	2,44
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	2,38
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	2,37
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	2,22
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	2,16
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	2,06
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	2,00
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	1,95
NL0013654783	Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	1,91
NL0011585146	Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	1,74
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	1,64
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	1,55
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port. EO -,25	1,51
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -,12	1,51
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien o.N.	1,50
FI4000297767	Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	1,48
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	1,41
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO -,01	1,27
FR0010307819	Legrand S.A. Actions au Port. EO 4	1,02
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	1,00
FR0000120693	Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	0,97
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.	0,84
FR0000133308	Orange S.A. Actions Port. EO 4	0,82
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port. EO 4	0,79
FI0009013403	KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N.	0,74
DE000SYM9999	Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	0,57
IE0004927939	Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13	0,53
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N.	0,51
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.Spa Azioni nom. EO -,22	0,42
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	0,40
IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,36
FI0009013296	Neste Oyj Registered Shs o.N.	0,31
FR0010220475	Alstom S.A. Actions Port. EO 7	0,25

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Zusammensetzung des Index (%)

DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien o.N.	0,24
AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien o.N.	0,14
FR0013176526	Valéo S.E. Actions Port. EO 1	0,08
FR0000121147	Forvia SE Actions Port. EO 7	0,07



# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2024.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>231.479.617,30</b>	<b>100,01</b>
1. Aktien		230.986.070,53	99,80
- Banken	37.279.171,50		16,11
- Bau und Baustoffe	1.561.146,48		0,67
- Chemische Industrie	2.256.456,80		0,97
- Einzelhandel	4.505.738,40		1,95
- Elektrik / Elektronik	38.245.635,85		16,52
- Energieversorger	7.153.665,70		3,09
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	8.941.329,25		3,86
- Pharmaindustrie / Biotech	27.605.455,15		11,93
- Software	18.018.482,86		7,79
- Sonstige Dienstleistungen	6.410.514,30		2,77
- Sonstige Finanzdienstleistungen	3.252.187,40		1,41
- Sonstige industrielle Werte	567.119,76		0,25
- Telekommunikation	13.891.508,68		6,00
- Textilien und Kleidung	26.849.691,10		11,60
- Transportation	3.577.447,50		1,55
- Verbrauchsgüter	10.506.107,36		4,54
- Versicherungen	20.364.412,44		8,80
2. Forderungen		202.432,69	0,09
3. Bankguthaben		291.114,08	0,13
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-29.316,14</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>231.450.301,16</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	15.027	3.303	166	EUR 231,300	3.475.745,10	1,50
DE0008404005	Allianz SE		STK	35.401	6.952	390	EUR 260,800	9.232.580,80	3,99
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	26.953	5.924	297	EUR 85,820	2.313.106,46	1,00
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	8.785	1.942	152	EUR 134,200	1.178.947,00	0,51
DE0005439004	Continental AG		STK	9.761	2.146	108	EUR 56,700	553.448,70	0,24
DE0006062144	Covestro AG		STK	17.080	17.080	0	EUR 54,460	930.176,80	0,40
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	17.171	3.774	189	EUR 189,400	3.252.187,40	1,41
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	86.726	22.064	1.344	EUR 41,250	3.577.447,50	1,55
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	313.374	68.885	3.459	EUR 24,170	7.574.249,58	3,27
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	118.019	25.942	1.302	EUR 32,050	3.782.508,95	1,63
DE0006599905	Merck KGaA		STK	11.680	2.567	128	EUR 165,800	1.936.544,00	0,84
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	12.088	2.705	375	EUR 455,600	5.507.292,80	2,38
DE0007164600	SAP SE		STK	92.393	25.944	6.610	EUR 195,020	18.018.482,86	7,79
DE0005YM9999	Symrise AG		STK	11.360	2.497	125	EUR 116,750	1.326.280,00	0,57
							EUR	62.658.997,95	27,07
Ausland									
NL0012969182	Adyen N.V.		STK	2.589	2.589	0	EUR 1.130,600	2.927.123,40	1,26
FR0010220475	Alstom S.A.		STK	31.298	31.298	0	EUR 18,120	567.119,76	0,25
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.		STK	86.698	23.200	524	EUR 54,960	4.764.922,08	2,06
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	24.143	5.059	7.459	EUR 850,500	20.533.621,50	8,87
FR0000120628	AXA S.A.		STK	173.116	38.136	1.389	EUR 32,490	5.624.538,84	2,43
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.		STK	527.589	106.853	5.822	EUR 9,704	5.119.723,66	2,21
ES0113900J37	Banco Santander S.A.		STK	1.430.196	288.742	15.784	EUR 4,455	6.371.523,18	2,75
FR0000131104	BNP Paribas S.A.		STK	96.481	21.502	2.550	EUR 63,460	6.122.684,26	2,65
FR0000120644	Danone S.A.		STK	58.133	12.748	486	EUR 60,160	3.497.281,28	1,51
IT0003128367	ENEL S.p.A.		STK	702.046	154.322	7.748	EUR 6,594	4.629.291,32	2,00
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.		STK	27.677	6.690	894	EUR 211,700	5.859.220,90	2,53
NL0011585146	Ferrari N.V.		STK	10.536	2.292	144	EUR 380,400	4.007.894,40	1,73
FR0000121147	Forvia SE		STK	15.289	15.439	150	EUR 10,835	165.656,32	0,07
FR0000052292	Hermes International S.C.A.		STK	3.175	699	38	EUR 2.023,000	6.423.025,00	2,78
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA		STK	100.440	22.079	1.109	EUR 44,860	4.505.738,40	1,95
NL0011821202	ING Groep N.V.		STK	298.535	56.059	3.136	EUR 16,750	5.000.461,25	2,16
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.		STK	1.457.955	320.483	16.091	EUR 3,751	5.468.060,23	2,36
FR0000121485	Kering S.A.		STK	6.444	1.417	71	EUR 284,500	1.833.318,00	0,79
IE0004927939	Kingspan Group PLC		STK	14.240	3.202	157	EUR 86,400	1.230.336,00	0,53
FI0009013403	KONE Oyj		STK	36.160	7.834	398	EUR 47,160	1.705.305,60	0,74
FR0010307819	Legrand S.A.		STK	23.700	5.243	422	EUR 99,880	2.367.156,00	1,02
FR0000120321	L'Oréal S.A.		STK	21.814	4.705	241	EUR 400,650	8.739.779,10	3,78
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE		STK	23.151	5.026	366	EUR 653,000	15.117.603,00	6,53
FI0009013296	Neste Oyj		STK	38.776	8.522	426	EUR 18,660	723.560,16	0,31
FI4000297767	Nordea Bank Abp		STK	316.808	68.916	4.904	EUR 10,820	3.427.862,56	1,48
FR0000133308	Orange S.A.		STK	185.225	40.716	2.045	EUR 10,250	1.898.556,25	0,82
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.		STK	18.096	3.976	200	EUR 124,000	2.243.904,00	0,97
NL0013654783	Prosus N.V.		STK	137.590	26.929	874	EUR 32,115	4.418.702,85	1,91
FR0000120578	Sanofi S.A.		STK	103.755	22.780	1.007	EUR 95,330	9.890.964,15	4,27
FR0000121972	Schneider Electric SE		STK	51.884	11.382	458	EUR 222,850	11.562.349,40	5,00
IT0003153415	Snam S.p.A.		STK	185.852	40.853	2.051	EUR 4,417	820.908,28	0,35
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA		STK	127.426	28.010	1.406	EUR 7,690	979.905,94	0,42
IT0005239360	UniCredit S.p.A.		STK	151.992	29.432	5.051	EUR 37,955	5.768.856,36	2,49
FR0013176526	Valéo S.E.		STK	18.509	4.198	1.175	EUR 10,585	195.917,77	0,08
AT0000831706	Wienerberger AG		STK	10.098	10.098	0	EUR 32,760	330.810,48	0,14
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.		STK	22.459	4.936	247	EUR 155,100	3.483.390,90	1,51
							EUR	168.327.072,58	72,73
Summe Wertpapiervermögen							EUR	230.986.070,53	99,80
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	291.114,08	0,13
EUR-Guthaben bei:									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	291.114,08			% 100,000	291.114,08	0,13
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	202.432,69	0,09
Dividendenansprüche			EUR	31.192,76				31.192,76	0,01
Quellensteuererstattungsansprüche			EUR	170.646,35				170.646,35	0,07
Zinsansprüche			EUR	593,58				593,58	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-29.316,14	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-29.316,14				-29.316,14	-0,01
Fondsvermögen							EUR	231.450.301,16	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert			EUR					110,62	
Umlaufende Anteile			STK					2.092.300,00	

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.07.2024

## 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>Aktien</b>					
<b>Ausland</b>					
FR0010908533	Edenred S.A.	STK	4.418	22.265	
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK	1.473	18.463	
NL0011821392	Signify N.V.	STK	2.273	11.450	
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC	STK	4.105	21.672	
BE0974320526	Umicore S.A.	STK	3.450	17.381	

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.02.2024 bis zum 31.07.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		1.377.231,67	0,658
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		4.242.408,66	2,028
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		13.444,96	0,006
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-206.584,76	-0,099
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-132.390,23	-0,063
6. Sonstige Erträge		7,06	0,000
davon: Sonstiges	7,06		0,000
Summe der Erträge		5.294.117,36	2,530
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-170.478,47	-0,081
2. Sonstige Aufwendungen		-83,88	0,000
davon: Bankgebühren	-64,78		0,000
davon: Sonstiges	-19,10		0,000
Summe der Aufwendungen		-170.562,35	-0,082
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		5.123.555,01	2,449
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		3.854.889,04	1,842
2. Realisierte Verluste		-685.725,43	-0,328
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		3.169.163,61	1,515
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		8.292.718,62	3,963
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		10.370.159,39	4,956
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-2.256.417,88	-1,078
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		8.113.741,51	3,878
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		16.406.460,13	7,841
<b>Entwicklung des Sondervermögens</b>		2024 / 2025	
	EUR	EUR	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		180.107.734,73	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-469.950,00	
2. Zwischenausschüttungen		-3.512.756,00	
3. Mittelzufluss (netto)		39.385.394,53	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	40.898.837,60		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.513.443,07		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-466.582,23	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		16.406.460,13	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	10.370.159,39		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-2.256.417,88		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		231.450.301,16	

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered 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	110,62
Umlaufende Anteile	STK	2.092.300,00

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

**99,80**

**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 31.07.2024 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 31.07.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)

0,15

### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

### Angaben zu den wesentlichen sonstigen Erträgen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Erträgen sind Korrektur aus Dividendenzahlungen in Höhe von EUR 6,89 enthalten.

### Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind Domizilierungsgebühren in Höhe von EUR -63,89 und Kosten für sonstige Gebühren in Höhe von EUR -16,9 enthalten.

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

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

---

Frankfurt am Main, den 1. August 2024  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2023

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

### Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Peter Scherkamp, München

Dr. Bernd Türk, Frankfurt am Main

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

Thomas Ketter

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

Thomas Schneider

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

### Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Juli 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)

