

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2023.

# **Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

**Lizenzvermerk**

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

# Bericht der Geschäftsführung.

31. Juli 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Juli 2023.

Der Berichtszeitraum war von uneinheitlichen konjunkturellen Signalen geprägt, gleichzeitig rückte der Ukraine-Krieg an den Märkten sukzessive in den Hintergrund. Einerseits nahmen Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor angesichts des milden Winters spürbar ab. Die Teuerungsraten entfernten sich zudem im Verlauf von ihren Höchstständen. Demgegenüber hat sich zumindest in Deutschland die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,25 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 4,0 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen wies trotz zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren im Bankensektor sowie der Auswirkungen steigender Leitzinsen eine Aufwärtsbewegung aus. Insbesondere große Technologiekonzerne verbuchten starke Kurszuwächse. Der Euro bewegte sich im Verhältnis zum US-Dollar in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende Juli bei 1,10 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte unter Schwankungen seitwärts und beendete die Berichtsperiode bei 85,6 US-Dollar je Barrel (Brent).

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 2023	9
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023	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 MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka MSCI Germany 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 Germany Climate Change ESG Select (Preisindex) nachzubilden. Der MSCI Germany Climate Change ESG Select umfasst Aktien von großen und mittelgroßen deutschen Unternehmen. 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 MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	6,9%	16,8%	3,7%

**ISIN** DE000ETFL540

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

# Deka MSCI Germany 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	LU1673108939	Aroundtown SA Bearer Shares EO -,01
Löschung	DE0005089031	United Internet AG Namens-Aktien o.N.
Neuaufnahme	DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien o.N.
Neuaufnahme	DE000TLX1005	Talanx AG Namens-Aktien o.N.
Neuaufnahme	DE000WCH8881	Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien o.N.

# Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	9,79
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien o.N.	9,34
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	8,96
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	7,15
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	6,93
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	5,01
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien o.N.	4,32
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	3,92
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.	3,71
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	2,73
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	2,65
DE000SYM9999	Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	2,26
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N.	2,12
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien o.N.	2,07
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	1,83
DE0007165631	Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	1,82
NL0012169213	Qiagen N.V. Aandelen op naam EO -,01	1,80
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	1,69
DE000A1DAH00	Brenntag SE Namens-Aktien o.N.	1,66
DE0005140008	Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.	1,57
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien o.N.	1,17
DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien o.N.	1,12
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.	1,07
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	0,99
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.	0,96
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	0,95
DE000CBK1001	Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	0,94
DE0006048408	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien o.N.	0,94
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N.	0,94
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.	0,94
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien o.N.	0,86
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE Namens-Aktien o.N.	0,84
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.	0,77
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N.	0,76
DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	0,66
DE000A161408	HelloFresh SE Inhaber-Aktien o.N.	0,65
DE0007010803	RATIONAL AG Inhaber-Aktien o.N.	0,61
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE Namens-Aktien o.N.	0,57
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N.	0,56
DE000EVNK013	Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N.	0,41
DE000A12DM80	Scout24 SE Namens-Aktien o.N.	0,36
DE0006452907	Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N.	0,30
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien o.St. EO 1	0,30
DE000TLX1005	Talanx AG Namens-Aktien o.N.	0,29
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien o.N.	0,27

# Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF

## Zusammensetzung des Index (%)

DE0005158703	Bechtle AG Inhaber-Aktien o.N.	0,26
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien o.N.	0,17



# Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>157.791.832,88</b>	<b>100,02</b>
1. Aktien		157.357.823,36	99,74
- Banken	3.953.225,58		2,51
- Büroausstattung	408.586,21		0,26
- Chemische Industrie	8.795.203,85		5,57
- Einzelhandel	6.795.463,34		4,31
- Elektrik / Elektronik	16.962.590,80		10,75
- Energieversorger	1.841.869,97		1,17
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	9.003.056,70		5,71
- Pharmaindustrie / Biotech	15.913.809,17		10,09
- Real Estate	5.617.899,84		3,56
- Software	15.887.520,88		10,07
- Sonstige Finanzdienstleistungen	4.166.990,10		2,64
- Sonstige industrielle Werte	17.948.963,70		11,38
- Telekommunikation	9.603.100,81		6,09
- Textilien und Kleidung	8.282.564,48		5,25
- Transportation	11.786.238,99		7,47
- Verbrauchsgüter	1.018.625,74		0,65
- Versicherungen	19.372.113,20		12,28
2. Bankguthaben		434.009,52	0,28
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-26.616,06</b>	<b>-0,02</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>157.765.216,82</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK		36.986	4.241	14.348	EUR 184,000	6.805.424,00	4,31	
DE0008404005	Allianz SE	STK		51.772	6.571	14.499	EUR 217,400	11.255.232,80	7,13	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		26.033	16.820	6.847	EUR 110,860	2.886.018,38	1,83	
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG	STK		4.671	520	1.612	EUR 102,200	477.376,20	0,30	
DE0005158703	Bechtle AG	STK		10.207	1.322	2.856	EUR 40,030	408.586,21	0,26	
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK		28.308	8.596	7.764	EUR 117,800	3.334.682,40	2,11	
DE000A1DAHH0	Brenntag SE	STK		37.134	4.024	11.158	EUR 70,480	2.617.204,32	1,66	
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		11.549	1.608	3.229	EUR 105,350	1.216.687,15	0,77	
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK		136.100	18.584	38.071	EUR 10,875	1.480.087,50	0,94	
DE0005439004	Continental AG	STK		24.241	23.148	6.131	EUR 72,620	1.760.381,42	1,12	
DE0006062144	Covestro AG	STK		31.771	30.431	8.032	EUR 48,830	1.551.377,93	0,98	
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE	STK		21.552	4.742	39.839	EUR 41,265	889.343,28	0,56	
DE0005140008	Deutsche Bank AG	STK		245.351	27.325	84.052	EUR 10,080	2.473.138,08	1,57	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		23.907	3.098	6.691	EUR 174,300	4.166.990,10	2,64	
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG	STK		96.606	92.945	24.410	EUR 9,178	886.649,87	0,56	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		233.296	28.817	119.187	EUR 46,720	10.899.589,12	6,91	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		397.123	49.497	111.241	EUR 19,842	7.879.714,57	4,99	
DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG	STK		9.362	3.674	2.539	EUR 111,200	1.041.054,40	0,66	
DE000ENAG999	E.ON SE	STK		160.093	199.067	38.974	EUR 11,505	1.841.869,97	1,17	
DE000EVNK013	Evonik Industries AG	STK		34.422	33.135	8.697	EUR 18,810	647.477,82	0,41	
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA	STK		25.448	3.300	7.124	EUR 47,220	1.201.654,56	0,76	
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK		52.427	6.798	14.678	EUR 28,530	1.495.742,31	0,95	
DE0006602006	GEA Group AG	STK		35.218	33.691	8.905	EUR 38,590	1.359.062,62	0,86	
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK		7.740	1.091	2.164	EUR 194,150	1.502.721,00	0,95	
DE000A161408	HelloFresh SE	STK		39.314	4.942	21.268	EUR 25,910	1.018.625,74	0,65	
DE0006048408	Henkel AG & Co. KGaA	STK		23.289	2.523	6.997	EUR 63,540	1.479.783,06	0,94	
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA	STK		37.931	4.295	13.962	EUR 70,180	2.661.997,58	1,69	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		352.420	45.530	98.666	EUR 40,000	14.096.800,00	8,94	
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG	STK		50.958	5.474	14.653	EUR 63,940	3.258.254,52	2,07	
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE	STK		20.451	2.844	5.718	EUR 64,360	1.316.226,36	0,83	
DE0006599905	Merck KGaA	STK		36.508	5.479	10.196	EUR 159,800	5.833.978,40	3,70	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		17.984	2.535	5.028	EUR 342,600	6.161.318,40	3,91	
DE0006452907	Nemetschek SE	STK		7.242	940	2.028	EUR 66,240	479.710,08	0,30	
DE0006969603	PUMA SE	STK		24.042	2.603	7.218	EUR 61,440	1.477.140,48	0,94	
DE0007010803	RATIONAL AG	STK		1.417	186	397	EUR 680,500	964.268,50	0,61	
DE0007164600	SAP SE	STK		123.857	14.107	46.750	EUR 124,400	15.407.810,80	9,77	
DE0007165631	Sartorius AG	STK		7.636	1.665	2.116	EUR 375,300	2.865.790,80	1,82	
DE000A12DM80	Scout24 AG	STK		9.359	1.041	3.194	EUR 60,180	563.224,62	0,36	
DE0007236101	Siemens AG	STK		94.791	11.575	26.560	EUR 154,980	14.690.709,18	9,31	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK		96.112	31.100	315.673	EUR 15,390	1.479.163,68	0,94	
DE000SYM9999	Symrise AG	STK		35.841	5.014	10.021	EUR 99,380	3.561.878,58	2,26	
DE000TLX1005	Talanx AG	STK		8.130	10.110	1.980	EUR 55,700	452.841,00	0,29	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK		110.493	13.258	51.048	EUR 2,451	270.818,34	0,17	
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK		202.527	44.393	69.019	EUR 21,240	4.301.673,48	2,73	
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG	STK		2.952	3.671	719	EUR 141,350	417.265,20	0,26	
DE000ZAL1111	Zalando SE	STK		53.803	5.827	16.141	EUR 31,400	1.689.414,20	1,07	
								154.526.759,01	97,95	
Ausland										
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK		66.379	9.691	18.546	EUR 42,650	2.831.064,35	1,79	
								2.831.064,35	1,79	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	157.357.823,36	99,74
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	434.009,52	0,28
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle								EUR	434.009,52	0,28
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-26.616,06	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung								EUR	-26.616,06	-0,02
Fondsvermögen								EUR	157.765.216,82	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert								EUR	12,36	
Umlaufende Anteile								STK	12.762.206,00	

<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 31.07.2023

# Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF

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>Inland</b>					
DE0005089031	United Internet AG	STK	1.085	15.043	
<b>Ausland</b>					
LU1673108939	Aroundtown SA	STK	25.623	355.238	

# Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.02.2023 bis zum 31.07.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		3.681.514,38	0,288
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		10.676,48	0,001
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-552.227,19	-0,043
4. Sonstige Erträge		8,17	0,000
davon: Sonstiges	8,17		0,000
Summe der Erträge		3.139.971,84	0,246
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-246,57	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-170.754,08	-0,013
3. Sonstige Aufwendungen		-6,99	0,000
davon: Sonstiges	-6,99		0,000
Summe der Aufwendungen		-171.007,64	-0,013
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		2.968.964,20	0,233
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		4.900.151,24	0,384
2. Realisierte Verluste		-5.658.024,73	-0,443
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-757.873,49	-0,059
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		2.211.090,71	0,173
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		4.254.174,92	0,333
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		4.872.677,13	0,382
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		9.126.852,05	0,715
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		11.337.942,76	0,888

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023
	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	EUR
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	176.175.245,16
2. Zwischenausschüttungen	-1.386.648,54
3. Mittelzufluss (netto)	-2.680.765,02
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	-25.467.477,47
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	16.369.328,72
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-41.836.806,19
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	-213.080,07
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	11.337.942,76
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	4.254.174,92
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	4.872.677,13
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	157.765.216,82

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

# Deka MSCI Germany 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	12,36
Umlaufende Anteile	STK	12.762.206,00

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

**99,74**

**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 31.07.2023 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2023 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)

0,16

### 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.

---

Frankfurt am Main, den 1. August 2023

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 2022

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

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Juli 2023

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



**Deka Investment GmbH**

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

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

