

Jahresbericht
zum 31. Januar 2024.

Deka MSCI Europe 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.

31. Januar 2024

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Januar 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 in 2023 niederschlug. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin die Wirtschaftslage in den USA. Wiederholt sorgten geopolitische Belastungsfaktoren (Ukraine-Krieg, Nahost-Konflikt, Angriffe auf Schiffe im Roten Meer) für Verunsicherung an den Finanzmärkten. Im Verlauf zeigte die Inflation jedoch Anzeichen einer Normalisierung, was in den letzten Monaten zu einer freundlicheren Marktstimmung führte.

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 mehrjährigen Höchstständen. Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende Januar bei 2,2 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten bei 3,9 Prozent.

Die internationalen Aktienindizes wiesen in der Betrachtungsperiode einige Schwankungen auf, konnten jedoch auf Jahressicht überwiegend deutlich zulegen. Lediglich China litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise. Am Devisenmarkt notierte der Euro Ende Januar bei 1,09 US-Dollar und damit per saldo unverändert, während Rohöl den Berichtszeitraum leicht niedriger bei rund 82 US-Dollar pro Barrel (Brent Future) beendete. Dagegen kletterte die Feinunze Gold über die Marke von 2.000 US-Dollar und erreichte im Dezember ein neues Allzeit-Hoch.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

| | |
|---|----|
| Tätigkeitsbericht | 5 |
| Vermögensübersicht zum 31. Januar 2024 | 16 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2024 | 17 |
| Anhang | 26 |
| Nachhaltiges Investitionsziel | 28 |
| Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers | 45 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 47 |

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 01.02.2023 bis 31.01.2024

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Tätigkeitsbericht.

Der Deka MSCI Europe 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 Europe Climate Change ESG Select (Preisindex) nachzubilden. Der MSCI Europe Climate Change ESG Select umfasst Aktien von großen und mittelgroßen Unternehmen europäischer Industriestaaten. 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 Aktien aufgrund von Indexanpassungen und Rücknahme von Anteilscheinen.

Adressenausfallrisiken

Das Management von Ausfallrisiken für das Sondervermögen erfolgt im Rahmen des Risikomanagementsystems der Deka Investment GmbH. Aufgrund des bestehenden Anlageuniversums ist das Adressenausfallrisiko als niedrig einzustufen.

Währungsrisiken

Die Fondswährung lautet auf Euro, jedoch lauteten einige Indexkonstituenten im Berichtszeitraum auf folgende Fremdwährungen: Britisches Pfund, Dänische Krone, Norwegische Krone, Schweizer Franken, Schwedische Krone und US-Dollar. Somit bestand für den Anleger aus der Eurozone ein Währungsrisiko in diesen Fremdwährungen, wobei wegen des Ziels der Indexnachbildung keine aktive Steuerung der Währungsrisiken durch das Fondsmanagement erfolgte.

Wichtige Kennzahlen

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| Performance* | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. | seit Auflegung p.a. |
|--------------|--------------|--------------|---------------------|
| | 10,86% | 9,13% | 10,87% |
| ISIN | DE000ETF1565 | | |

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

Sonstige Marktpreisrisiken

Das Investmentvermögen unterlag im Berichtszeitraum dem Marktpreisrisiko der im Investmentvermögen gehaltenen Wertpapiere. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Marktpreisrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des MSCI Europe Climate Change ESG Select (Preisindex). Die geringen Abweichungen in dem Marktpreisexposure zwischen Investmentvermögen und Index im Berichtszeitraum waren u.a. durch den Kassenbestand oder die Umsetzung von Kapitalmaßnahmen zu erklären. Die Volatilität des Anteilpreises betrug im Berichtszeitraum 11,91 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.

Liquiditätsrisiken

Aufgrund der passiven Abbildung eines Index, dessen Regelwerk liquiditätsrelevante Anforderungen an die Indexkonstituenten stellt, sowie der Investition ausschließlich in Aktien gemäß § 193 KAGB wird das Liquiditätsrisiko grundsätzlich als gering eingestuft.

Deka MSCI Europe 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 | NL0000303709 | AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)EO-,12 |
| Löschung | NO0010345853 | Aker BP ASA Navne-Aksjer NK 1 |
| Löschung | LU1673108939 | Aroundtown SA Bearer Shares EO -,01 |
| Löschung | SE0017768716 | Boliden AB Namn-Aktier o.N. |
| Löschung | GB0001367019 | British Land Co. PLC, The Registered Shares LS -,25 |
| Löschung | GB00B033F229 | Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395 |
| Löschung | NL0010545661 | CNH Industrial N.V. Aandelen op naam EO -,01 |
| Löschung | CH0012138530 | Credit Suisse Group AG Namens-Aktien SF -,04 |
| Löschung | FR0000120644 | Danone S.A. Actions Port. EO-,25 |
| Löschung | PTEDP0AM0009 | EDP - Energias de Portugal SA Acções Nom. EO 1 |
| Löschung | SE0016589188 | Electrolux, AB Namn-Aktier B |
| Löschung | SE0016828511 | Embracer Group AB Namn-Aktier AK Class B o.N. |
| Löschung | ES0118900010 | Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -,20 |
| Löschung | FI0009007132 | Fortum Oyj Registered Shares EO 3,40 |
| Löschung | PTGALOAM0009 | Galp Energia SGPS S.A. Acções Nominativas EO 1 |
| Löschung | SE0015811955 | Investor AB Namn-Aktier A (fria) o.N. |
| Löschung | GB00BZ4BQC70 | Johnson, Matthey PLC Registered Shares LS 1,101698 |
| Löschung | NL0012015705 | Just Eat Takeaway.com N.V. Registered Shares EO -,04 |
| Löschung | SE0015810247 | Kinnevik AB Namn-Aktier B SK 0,025 |
| Löschung | NL0000009827 | Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50 |
| Löschung | NL0000009538 | Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20 |
| Löschung | GB00B1CRLC47 | Mondi PLC Registered Shares EO -,20 |
| Löschung | FI0009013296 | Neste Oyj Registered Shs o.N. |
| Löschung | CH0038863350 | Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10 |
| Löschung | DK0060534915 | Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20 |
| Löschung | NL0012169213 | Qiagen N.V. Aandelen op naam EO -,01 |
| Löschung | FI0009003305 | Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N. |
| Löschung | CH1243598427 | Sandoz Group AG Namens-Aktien SF -,05 |
| Löschung | CH0002497458 | SGS S.A. Namens-Aktien SF 1 |
| Löschung | BE0003470755 | Solvay S.A. Actions au Porteur A o.N. |
| Löschung | DE000A1J5RX9 | Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien o.N. |
| Löschung | LU0156801721 | Tenaris S.A. Actions Nom. DL 1 |
| Löschung | LU2598331598 | Tenaris S.A. Registered Shares DL 1 |
| Löschung | FR0000054470 | Ubisoft Entertainment S.A. Actions Port. EO 0,0775 |
| Löschung | GB00B10RZP78 | Unilever PLC Registered Shares LS -,031111 |
| Löschung | DE0005089031 | United Internet AG Namens-Aktien o.N. |
| Löschung | FR0013176526 | Valéo S.E. Actions Port. EO 1 |
| Löschung | FR0000121204 | Wendel SE Actions Port. EO 4 |
| Neuaufnahme | BMG0112X1056 | AEGON Ltd. Registered Shares o.N. |
| Neuaufnahme | LU1598757687 | ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN |
| Neuaufnahme | NL0011872643 | ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16 |
| Neuaufnahme | IT0005218380 | Banco BPM S.p.A. Azioni o.N. |
| Neuaufnahme | NL0012866412 | BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01 |
| Neuaufnahme | SE0015949748 | Beijer Ref AB Namn-Aktier B O.N. |

Deka MSCI Europe 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 | SE0020050417 | Boliden AB Namn-Aktier o.N. |
| Neuaufnahme | GB00B033F229 | Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395 |
| Neuaufnahme | ES0105563003 | Corporacion Acciona Energias R Acciones Port. EO 1 |
| Neuaufnahme | CH1216478797 | DSM-Firmenich AG Namens-Aktien EO -,01 |
| Neuaufnahme | DE000ENAG999 | E.ON SE Namens-Aktien o.N. |
| Neuaufnahme | PTEDP0AM0009 | EDP - Energias de Portugal SA Açções Nom. EO 1 |
| Neuaufnahme | GB00BL6K5J42 | Endeavour Mining PLC Registered Shares DL-,01 |
| Neuaufnahme | ES0130670112 | Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20 |
| Neuaufnahme | IT0003128367 | ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1 |
| Neuaufnahme | FR0010208488 | Engie S.A. Actions Port. EO 1 |
| Neuaufnahme | NL0015001F58 | Ferrovial SE Registered Shares EO-,01 |
| Neuaufnahme | FI0009007132 | Fortum Oyj Registered Shares EO 3,40 |
| Neuaufnahme | CH0466642201 | Helvetia Holding AG Namens-Aktien SF 0,02 |
| Neuaufnahme | ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75 |
| Neuaufnahme | FI0009014575 | Metso Oyj Registered Shares o.N. |
| Neuaufnahme | GB00BMWC6P49 | Mondi PLC Registered Shares EO -,22 |
| Neuaufnahme | ES0116870314 | Naturgy Energy Group S.A. Acciones Port. EO 1 |
| Neuaufnahme | FI0009013296 | Neste Oyj Registered Shs o.N. |
| Neuaufnahme | DK0062498333 | Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1 |
| Neuaufnahme | NL0010558797 | OCI N.V. Registered Shares EO 0,02 |
| Neuaufnahme | NL0015001WM6 | Qiagen N.V. Aandelen op naam EO -,01 |
| Neuaufnahme | FR0000131906 | Renault S.A. Actions Port. EO 3,81 |
| Neuaufnahme | FI4000552500 | Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N. |
| Neuaufnahme | CH1243598427 | Sandoz Group AG Namens-Aktien SF -,05 |
| Neuaufnahme | CH1256740924 | SGS S.A. Namen-Aktien SF 0,04 |
| Neuaufnahme | BE0974464977 | Syensqo N.V. Actions au Porteur o.N. |
| Neuaufnahme | DE000TLX1005 | Talanx AG Namens-Aktien o.N. |
| Neuaufnahme | LU2598331598 | Tenaris S.A. Registered Shares DL 1 |
| Neuaufnahme | DE000WCH8881 | Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien o.N. |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|---|------|
| DK0062498333 | Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1 | 4,91 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09 | 4,45 |
| DE0007164600 | SAP SE Inhaber-Aktien o.N. | 3,57 |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE Actions Port. EO 4 | 3,41 |
| FR0000121014 | LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3 | 2,98 |
| CH0012005267 | Novartis AG Namens-Aktien SF 0,49 | 2,84 |
| GB0009895292 | AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25 | 2,76 |
| CH0012032048 | Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N. | 2,69 |
| ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75 | 2,35 |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. Actions Port. EO 2 | 1,53 |
| FR0000120321 | L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2 | 1,51 |
| GB0005405286 | HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50 | 1,31 |
| DE0007236101 | Siemens AG Namens-Aktien o.N. | 1,17 |
| DK0061539921 | Vestas Wind Systems A/S Navne-Aktier DK -,20 | 1,15 |
| GB00BN7SWP63 | GSK PLC Registered Shares LS-,3125 | 1,08 |
| GB0002374006 | Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185 | 1,03 |
| CH0210483332 | Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1 | 1,02 |
| DE0008404005 | Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N. | 0,94 |
| CH0012221716 | ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12 | 0,89 |
| CH0244767585 | UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10 | 0,85 |
| FR0000052292 | Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N. | 0,85 |
| FR0000125486 | VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50 | 0,84 |
| FR0000120073 | Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50 | 0,77 |
| FR0000121667 | EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18 | 0,77 |
| FR0014003TT8 | Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10 | 0,72 |
| IT0003128367 | ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1 | 0,68 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N. | 0,66 |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC Registered Shares LS -,144397 | 0,66 |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10 | 0,65 |
| CH0024608827 | Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01 | 0,64 |
| ES0148396007 | Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03 | 0,63 |
| GB00B1YW4409 | 3i Group PLC Registered Shares LS -,738636 | 0,62 |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10 | 0,62 |
| NL0015001FS8 | Ferrovial SE Registered Shares EO-,01 | 0,62 |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2 | 0,61 |
| DE0005552004 | Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N. | 0,60 |
| DE0006231004 | Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N. | 0,57 |
| ES0113900J37 | Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50 | 0,57 |
| SE0017486889 | Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125 | 0,55 |
| FR0000120628 | AXA S.A. Actions Port. EO 2,29 | 0,53 |
| DE0008430026 | Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N. | 0,50 |
| CH0418792922 | Sika AG Namens-Aktien SF 0,01 | 0,50 |
| CH0432492467 | Alcon AG Namens-Aktien SF -,04 | 0,50 |
| ES0113211835 | Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49 | 0,48 |
| CH0010645932 | Givaudan SA Namens-Aktien SF 10 | 0,48 |
| BE0974293251 | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N. | 0,48 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)

| | | |
|---------------|---|------|
| CH0013841017 | Lonza Group AG Namens-Aktien SF 1 | 0,46 |
| NL0011821202 | ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01 | 0,45 |
| SE0000115446 | Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N. | 0,44 |
| FR0000120693 | Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N. | 0,43 |
| DK0060094928 | Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10 | 0,43 |
| DK0060079531 | DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier DK 1 | 0,43 |
| IE0004927939 | Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13 | 0,42 |
| IT0000072618 | Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N. | 0,42 |
| IT0005239360 | UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N. | 0,41 |
| IE0001827041 | CRH PLC Registered Shares EO -,32 | 0,40 |
| GB00B0S0WJX34 | London Stock Exchange Group PLC Reg. Shares LS 0,069186047 | 0,40 |
| FR0000125007 | Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4 | 0,40 |
| GB00BD6K4575 | Compass Group PLC Registered Shares LS -,1105 | 0,38 |
| GB0000536739 | Ashtead Group PLC Registered Shares LS -,10 | 0,38 |
| DE000A1EWW0 | adidas AG Namens-Aktien o.N. | 0,38 |
| IT0003242622 | Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22 | 0,38 |
| FR0000121485 | Kering S.A. Actions Port. EO 4 | 0,38 |
| NL0000226223 | STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04 | 0,37 |
| DK0060336014 | Novozymes A/S Navne-Aktier B DK 2 | 0,36 |
| SE0015811963 | Investor AB Namn-Aktier B (fria) o.N. | 0,35 |
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp Registered Shares o.N. | 0,34 |
| FR0010307819 | Legrand S.A. Actions au Port. EO 4 | 0,34 |
| SE0007100581 | Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33 | 0,34 |
| NL0011794037 | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01 | 0,33 |
| GB00B19NLV48 | Experian PLC Registered Shares DL -,10 | 0,33 |
| DE0005810055 | Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N. | 0,32 |
| NL0000334118 | ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04 | 0,32 |
| NL0000395903 | Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -,12 | 0,31 |
| SE0015988019 | NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N. | 0,30 |
| FR0000125338 | Capgemini SE Actions Port. EO 8 | 0,30 |
| CH0126881561 | Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10 | 0,30 |
| IE00BWT6H894 | Flutter Entertainment PLC Registered Shares EO -,09 | 0,30 |
| GB0008706128 | Lloyds Banking Group PLC Registered Shares LS -,10 | 0,30 |
| SE0015961909 | Hexagon AB Namn-Aktier B (fria) o.N. | 0,30 |
| DE000A1ML7J1 | Vonovia SE Namens-Aktien o.N. | 0,29 |
| SE0017486897 | Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria) o.N. | 0,28 |
| SE0000667891 | Sandvik AB Namn-Aktier o.N. | 0,27 |
| ES0109067019 | Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01 | 0,27 |
| DE0006599905 | Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N. | 0,27 |
| NL0000009165 | Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60 | 0,26 |
| DE000ENER6Y0 | Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N. | 0,26 |
| ES0173093024 | Redeia Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50 | 0,25 |
| FI0009000681 | Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06 | 0,25 |
| CH0030170408 | Geberit AG Nam.-Akt. (Dispost.) SF -,10 | 0,25 |
| GB0031348658 | Barclays PLC Registered Shares LS 0,25 | 0,25 |
| GB0007099541 | Prudential PLC Registered Shares LS -,05 | 0,24 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)

| | | |
|--------------|--|------|
| NL0012969182 | Adyen N.V. Aandelen op naam EO -,01 | 0,24 |
| CH0025238863 | Kühne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1 | 0,24 |
| AT0000746409 | Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N. | 0,23 |
| CH1216478797 | DSM-Firmenich AG Namens-Aktien EO -,01 | 0,23 |
| FI0009003727 | Wärtsilä Corp. Reg. Shares o.N. | 0,23 |
| FR0000120503 | Bouygues S.A. Actions Port. EO 1 | 0,22 |
| CH1175448666 | Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01 | 0,22 |
| DE0005140008 | Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N. | 0,22 |
| CH0012549785 | Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05 | 0,21 |
| SE0000108656 | Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Aktier B (fria) o.N. | 0,21 |
| DK0060448595 | Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1 | 0,21 |
| GB0007908733 | SSE PLC Shs LS-,50 | 0,21 |
| FI0009013403 | KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N. | 0,21 |
| NL0000687663 | AerCap Holdings N.V. Aandelen op naam EO -,01 | 0,20 |
| ES0127797019 | EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5 | 0,20 |
| FR001400AJ45 | Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50 | 0,20 |
| GB00BDR05C01 | National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289 | 0,20 |
| IT0000062072 | Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. o.N. | 0,20 |
| SE0000148884 | Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) SK 10 | 0,20 |
| FR0000130577 | Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40 | 0,19 |
| NL0010832176 | argenx SE Aandelen aan toonder EO -,10 | 0,18 |
| ES0105066007 | Cellnex Telecom S.A. Acciones Port. EO -,25 | 0,18 |
| FR0000133308 | Orange S.A. Actions Port. EO 4 | 0,18 |
| CH0014852781 | Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10 | 0,18 |
| DE0005200000 | Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,18 |
| FR0000124141 | Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5 | 0,18 |
| NL0011585146 | Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01 | 0,18 |
| GB00B0744B38 | Bunzl PLC Registered Shares LS -,3214857 | 0,18 |
| SE0012673267 | Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003 | 0,18 |
| FI0009005987 | UPM Kymmene Corp. Registered Shares o.N. | 0,17 |
| ES0105046009 | Aena SME S.A. Acciones Port. EO 10 | 0,17 |
| GB00B5ZN1N88 | Segro PLC Registered Shares LS -,10 | 0,17 |
| CH0025751329 | Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -,25 | 0,17 |
| GB0007188757 | Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10 | 0,17 |
| GB00B082RF11 | Rentokil Initial PLC Registered Shares LS 0,01 | 0,17 |
| IE0004906560 | Kerry Group PLC Registered Shares A EO -,125 | 0,17 |
| SE0009922164 | Essity AB Namn-Aktier B | 0,17 |
| GB0005603997 | Legal & General Group PLC Registered Shares LS -,025 | 0,17 |
| ES0178430E18 | Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1 | 0,17 |
| GB0032089863 | NEXT PLC Registered Shares LS 0,10 | 0,17 |
| GB00BDCPN049 | Coca-Cola Europacific Pa. PLC Registered Shares EO -,01 | 0,17 |
| CH0010570759 | Chocoladef. Lindt & Sprüngli vink.Namens-Aktien SF 100 | 0,17 |
| FR0000130809 | Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25 | 0,17 |
| GB00BH4HKS39 | Vodafone Group PLC Registered Shares DL 0,2095238 | 0,16 |
| FI4000552500 | Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N. | 0,16 |
| IT0004965148 | Moncler S.p.A. Azioni nom. o.N. | 0,16 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|--|------|
| GB0009223206 | Smith & Nephew PLC Registered Shares DL -,20 | 0,16 |
| DE000SYM9999 | Symrise AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,16 |
| CH0311864901 | VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10 | 0,16 |
| DE000A1DAHH0 | Brenntag SE Namens-Aktien o.N. | 0,16 |
| DK0010274414 | Danske Bank AS Navne-Aktier DK 10 | 0,16 |
| BE0003739530 | UCB S.A. Actions Nom. o.N. | 0,16 |
| DE0006048432 | Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N | 0,16 |
| NL0013267909 | Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder E00,5 | 0,16 |
| DK0010272202 | GENMAB AS Navne Aktier DK 1 | 0,16 |
| NO0010161896 | DNB Bank ASA Navne-Aksjer NK 100 | 0,16 |
| DK0060252690 | Pandora A/S Navne-Aktier DK 1 | 0,15 |
| ES0140609019 | Caixabank S.A. Acciones Port. EO 1 | 0,15 |
| GB0004082847 | Standard Chartered PLC Registered Shares DL -,50 | 0,15 |
| SE0000242455 | Swedbank AB Namn-Aktier A o.N. | 0,15 |
| CH0010570767 | Chocoladef. Lindt & Sprüngli Inhaber-Part.sch. SF 10 | 0,15 |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1 | 0,15 |
| BE0003822393 | Elia Group Actions au Port. o.N. | 0,14 |
| NL0012866412 | BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01 | 0,14 |
| GB00BM8PJY71 | NatWest Group PLC Registered Shares LS 1,0769 | 0,14 |
| BE0003565737 | KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N. | 0,14 |
| IT0004176001 | Prysmian S.p.A. Azioni nom. EO 0,10 | 0,14 |
| GB0004052071 | Halma PLC Registered Shares LS -,10 | 0,14 |
| DE000KBX1006 | Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,14 |
| SE0007100599 | Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A (fria) SK 1,433 | 0,14 |
| FR0000045072 | Crédit Agricole S.A. Actions Port. EO 3 | 0,13 |
| CH0008742519 | Swisscom AG Namens-Aktien SF 1 | 0,13 |
| GB00BPQY8M80 | Aviva PLC Registered Shares LS -,33 | 0,13 |
| CH0012032113 | Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1 | 0,13 |
| AT0000652011 | Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,13 |
| NL0015001WM6 | Qiagen N.V. Aandelen op naam EO -,01 | 0,13 |
| DE0007165631 | Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N. | 0,13 |
| FR0000120172 | Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5 | 0,13 |
| FR0010220475 | Alstom S.A. Actions Port. EO 7 | 0,13 |
| GB00B8C3BL03 | Sage Group PLC, The Registered Shares LS-,01051948 | 0,13 |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N. | 0,13 |
| FR0010908533 | Edenred SE Actions Port. EO 2 | 0,13 |
| CH0024638196 | Schindler Holding AG Inhaber-Part.sch. SF -,10 | 0,12 |
| GB0006731235 | Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568 | 0,12 |
| GB00B1FH8J72 | Severn Trent PLC Registered Shares LS -,9789 | 0,12 |
| ES0125220311 | Acciona S.A. Acciones Port. EO 1 | 0,12 |
| CH1256740924 | SGS S.A. Namen-Aktien SF 0,04 | 0,12 |
| GB00BWFQGN14 | Spirax-Sarco Engineering PLC Reg. Shares LS -,26923076 | 0,12 |
| SE0000106270 | H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B SK 0,125 | 0,12 |
| GB00BMJ6DW54 | Informa PLC Registered Shares LS -,001 | 0,12 |
| NL0010801007 | IMCD N.V. Aandelen op naam EO -,16 | 0,11 |
| DE000ENAG999 | E.ON SE Namens-Aktien o.N. | 0,11 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|--|------|
| GB00B39J2M42 | United Utilities Group PLC Registered Shares LS -,05 | 0,11 |
| DK0010181759 | Carlsberg AS Navne-Aktier B DK 20 | 0,11 |
| IE00B1RR8406 | Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001 | 0,11 |
| FR0013326246 | Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05 | 0,11 |
| ES0167050915 | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. EO -,50 | 0,11 |
| DK0060227585 | Christian Hansen Holding AS Navne-Aktier DK 10 | 0,11 |
| FR0014000MR3 | Eurofins Scientific S.E. Actions Port. EO 0,01 | 0,11 |
| DE000CBK1001 | Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,11 |
| DK0010244508 | A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000 | 0,10 |
| GB00BJFFLV09 | Croda International PLC Regist.Shares LS -,10609756 | 0,10 |
| SE0000112724 | Svenska Cellulosa AB Namn-Aktier B (fria) SK 10 | 0,10 |
| CH0008038389 | Swiss Prime Site AG Nam.-Aktien SF 2 | 0,10 |
| NO0003054108 | Mowi ASA Navne-Aksjer NK 7,50 | 0,10 |
| GB0000456144 | Antofagasta PLC Registered Shares LS -,05 | 0,10 |
| DE0005785604 | Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N. | 0,10 |
| FR0000130452 | Eiffage S.A. Actions Port. EO 4 | 0,10 |
| FR0010208488 | Engie S.A. Actions Port. EO 1 | 0,10 |
| FR0013154002 | Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port. EO -,20 | 0,10 |
| CH0102484968 | Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02 | 0,10 |
| NL0010773842 | NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12 | 0,10 |
| NL0000009082 | Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder EO -,04 | 0,10 |
| NL0000008977 | Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60 | 0,10 |
| FI0009005961 | Stora Enso Oyj Reg. Shares Cl.R EO 1,70 | 0,09 |
| JE00B8KF9B49 | WPP PLC Registered Shares LS -,10 | 0,09 |
| GB00B1XZS820 | Anglo American PLC Registered Shares DL -,54945 | 0,09 |
| SE0020050417 | Boliden AB Namn-Aktier o.N. | 0,09 |
| SE0001515552 | Indutrade AB Aktier SK 1 | 0,09 |
| GB00BHJYC057 | InterContinental Hotels Group Reg.Shares LS -,208521303 | 0,09 |
| DE0006048408 | Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien o.N. | 0,09 |
| CH0012255151 | Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25 | 0,09 |
| SE0000108227 | SKF AB Namn-Aktier B SK 0,625 | 0,09 |
| FR0010533075 | Getlink SE Actions Port. EO -,40 | 0,09 |
| IE00BD1RP616 | Bank of Ireland Group PLC Registered Shares EO 1 | 0,08 |
| GB0000811801 | Barratt Developments PLC Registered Shares LS -,10 | 0,08 |
| GB0008782301 | Taylor Wimpey PLC Registered Shares LS -,01 | 0,08 |
| BMG0112X1056 | AEGON Ltd. Registered Shares o.N. | 0,08 |
| SE0012853455 | EQT AB Namn-Aktier o.N. | 0,08 |
| FI0009014575 | Metso Oyj Registered Shares o.N. | 0,08 |
| DE0006602006 | GEA Group AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,08 |
| DK0010219153 | Rockwool A/S Navne-Aktier B DK 10 | 0,08 |
| PTJMT0AE0001 | Jerónimo Martins, SGPS, S.A. Acções Nominativas EO 1 | 0,08 |
| GB00BLJNXL82 | Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,054141 | 0,08 |
| FR0000121220 | Sodexo S.A. Actions Port. EO 4 | 0,08 |
| GB00BYW0PQ60 | Land Securities Group PLC Registered Shares LS 0,106666 | 0,08 |
| GB0030913577 | BT Group PLC Registered Shares LS 0,05 | 0,08 |
| DE000LEG1110 | LEG Immobilien SE Namens-Aktien o.N. | 0,08 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|---|------|
| SE0000113250 | Skanska AB Namn-Aktier B (fria) SK 3 | 0,08 |
| NL0012059018 | EXOR N.V. Aandelen aan toonder o.N. | 0,08 |
| GB0031638363 | Intertek Group PLC Registered Shares LS -,01 | 0,08 |
| FR0000051807 | Téléperformance SE Actions Port. EO 2,5 | 0,08 |
| IT0003828271 | Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA Azioni nom. EO -,125 | 0,08 |
| SE0000108847 | L E Lundbergföretagen AB Namn-Aktier B (fria) SK 10 | 0,08 |
| IT0000072170 | Fincobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33 | 0,08 |
| CH0198251305 | Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien SF 6,70 | 0,08 |
| CH0435377954 | SIG Group AG Namens-Aktien SF-,01 | 0,08 |
| GB0031743007 | Burberry Group PLC Registered Shares LS-,0005 | 0,08 |
| GB0006825383 | Persimmon PLC Registered Shares LS -,10 | 0,07 |
| FR0000121964 | Klépierre S.A. Actions Port. EO 1,40 | 0,07 |
| GB00B02J6398 | Admiral Group PLC Registered Shares LS -,001 | 0,07 |
| GB00BVYVFW23 | Auto Trader Group PLC Registered Shares LS 0,01 | 0,07 |
| ES0105563003 | Corporacion Acciona Energias R Acciones Port. EO 1 | 0,07 |
| GB00B1KJJ408 | Whitbread PLC Reg. Shares LS -,76797385 | 0,07 |
| FI0009000202 | Kesko Oyj Registered Shares Cl. B o.N. | 0,07 |
| CH0024638212 | Schindler Holding AG Namens-Aktien SF -,10 | 0,07 |
| FR0010040865 | Gecina S.A. Actions Nom. EO 7,50 | 0,07 |
| GB00BMWC6P49 | Mondi PLC Registered Shares EO -,22 | 0,07 |
| SE0015949748 | Beijer Ref AB Namn-Aktier B O.N. | 0,07 |
| NL0015435975 | Davide Campari-Milano N.V. Aandelen op naam EO -,01 | 0,07 |
| GB0006776081 | Pearson PLC Registered Shares LS -,25 | 0,07 |
| BE0974349814 | Warehouses De Pauw N.V. Actions Nom. o.N. | 0,07 |
| DE0005785802 | Fresenius Medical Care AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,07 |
| FR0006174348 | Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12 | 0,07 |
| FI0009014377 | Orion Corp. Registered Shares Cl.B o.N. | 0,07 |
| NO0003733800 | Orkla ASA Navne-Aksjer NK 1,25 | 0,07 |
| NL0011872643 | ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16 | 0,06 |
| NL0006294274 | Euronext N.V. Aandelen an toonder WI EO 1,60 | 0,06 |
| DK0060636678 | Tryg AS Navne-Aktier DK 5 | 0,06 |
| IM00B5VQMV65 | Entain PLC Registered Shares EO -,01 | 0,06 |
| FR0000127771 | Vivendi SE Actions Port. EO 5,5 | 0,06 |
| SE0005127818 | AB Sagax Namn-Aktier B o.N. | 0,06 |
| CH0012410517 | Bâloise Holding AG Namens-Aktien SF 0,10 | 0,06 |
| IT0000062957 | Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom. EO 0,50 | 0,06 |
| DK0010244425 | A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier A DK 1000 | 0,06 |
| SE0000202624 | Getinge AB Namn-Aktier B (fria) SK 2 | 0,06 |
| CH0009002962 | Barry Callebaut AG Namensaktien SF 0,02 | 0,06 |
| NL0011540547 | ABN AMRO Bank N.V. Cert.v.Aand.op Naam EO 1 | 0,06 |
| FR0010340141 | Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3 | 0,06 |
| IE00BF0L3536 | AIB Group PLC Registered Shares EO -,625 | 0,06 |
| CH0012138605 | Adecco Group AG Namens-Aktien SF 0,1 | 0,06 |
| BE0974264930 | AGEAS SA/NV Actions Nominatives o.N. | 0,06 |
| SE0000115420 | Volvo (publ), AB Namn-Aktier A (fria) o.N. | 0,06 |
| DK0060738599 | Demant AS Navne Aktier A DK 0,2 | 0,06 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|--|------|
| FR0013280286 | bioMerieux Actions au Porteur (P.S.) o.N. | 0,06 |
| DE000ZAL1111 | Zalando SE Inhaber-Aktien o.N. | 0,06 |
| FR0010259150 | Ipsen S.A. Actions au Porteur EO 1 | 0,06 |
| FR0010313833 | Arkema S.A. Actions au Porteur EO 10 | 0,06 |
| BE0974259880 | Dleteren Group S.A. Parts Sociales au Port. o.N. | 0,06 |
| GB00B1WY2338 | Smiths Group PLC Registered Shares LS -,375 | 0,06 |
| BE0003797140 | Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Actions au Porteur o.N. | 0,06 |
| NO0010063308 | Telenor ASA Navne-Aksjer NK 6 | 0,06 |
| SE0017832488 | Fastighets AB Balder Namn-Aktier B SK 0,16666 | 0,06 |
| DE0005313704 | Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,06 |
| IT0005218380 | Banco BPM S.p.A. Azioni o.N. | 0,06 |
| IT0004056880 | Amplifon S.p.A. Azioni nom. EO -,02 | 0,06 |
| FI0009007884 | Elisa Oyj Registered Shares Class A o.N. | 0,06 |
| CH0012453913 | Temenos AG Nam.-Aktien SF 5 | 0,05 |
| NL0000379121 | Randstad N.V. Aandelen aan toonder EO 0,10 | 0,05 |
| GB00B0LCW083 | Hikma Pharmaceuticals PLC Registered Shares LS -,10 | 0,05 |
| DE0006969603 | PUMA SE Inhaber-Aktien o.N. | 0,05 |
| GB00B3MBS747 | Ocado Group PLC Registered Shares LS -,02 | 0,05 |
| FI0009013296 | Neste Oyj Registered Shs o.N. | 0,05 |
| SE0000667925 | Telia Company AB Namn-Aktier SK 3,20 | 0,05 |
| NO0010310956 | Salmar ASA Navne-Aksjer NK -,25 | 0,05 |
| GB00BM8Q5M07 | JD Sports Fashion PLC Registered Shares LS -,0005 | 0,05 |
| DE0007010803 | RATIONAL AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,05 |
| IT0003796171 | Poste Italiane S.p.A. Azioni nom. EO -,51 | 0,05 |
| SE0000695876 | Alfa Laval AB Namn-Aktier SK 2,5 | 0,05 |
| DE000A12DM80 | Scout24 SE Namens-Aktien o.N. | 0,05 |
| CH0466642201 | Helvetia Holding AG Namens-Aktien SF 0,02 | 0,05 |
| SE0000872095 | Swedish Orphan Biovitrum AB Namn-Aktier SK 1 | 0,05 |
| SE0015949201 | Lifco AB Namn-Aktier B o.N. | 0,05 |
| GB0033195214 | Kingfisher PLC Reg. Shares LS -,157142857 | 0,05 |
| DE0006452907 | Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N. | 0,05 |
| FR0000120404 | ACCOR S.A. Actions Port. EO 3 | 0,05 |
| CH0016440353 | Ems-Chemie Holding AG Namens-Aktien SF -,01 | 0,04 |
| DE000PAG9113 | Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N | 0,04 |
| DE0008232125 | Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N. | 0,04 |
| GB00BGXQNP29 | Phoenix Group Holdings PLC Registered Shares LS -,10 | 0,04 |
| SE0000163594 | Securitas AB Namn-Aktier B SK 1 | 0,04 |
| SE0000107203 | Industrivärden AB Namn-Aktier C o.N. | 0,04 |
| DE000TLX1005 | Talanx AG Namens-Aktien o.N. | 0,04 |
| GB00BL6K5J42 | Endeavour Mining PLC Registered Shares DL-,01 | 0,04 |
| GB0007669376 | St. James Place PLC Registered Shares LS -,15 | 0,04 |
| SE0005190238 | Tele2 AB Namn-Aktier B SK -,625 | 0,04 |
| SE0011090018 | Holmen AB Namn-Aktier Cl. B SK 25 | 0,04 |
| FR0000121709 | SEB S.A. Actions Port. EO 1 | 0,04 |
| FR0004125920 | Amundi S.A. Actions au Porteur EO 2,5 | 0,04 |
| DE0005158703 | Bechtle AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,04 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)

| | | |
|--------------|--|------|
| GB00BP9LHF23 | Schroders PLC Registered Shares LS -,20 | 0,04 |
| SE0000190126 | Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria) o.N. | 0,04 |
| FR0013451333 | LA FRANCAISE DES JEUX Actions Port. (Prom.) EO -,40 | 0,04 |
| GB00BF8Q6K64 | Abrdn PLC Reg. Shares LS -,139682539 | 0,03 |
| DE000A2E4K43 | Delivery Hero SE Namens-Aktien o.N. | 0,03 |
| CH0012142631 | Clariant AG Namens-Aktien SF 2,18 | 0,03 |
| CH0531751755 | Banque Cantonale Vaudoise Namens-Aktien SF 1 | 0,03 |
| FR0000064578 | Covivio S.A. Actions Port. EO 3 | 0,03 |
| SE0001662230 | Husqvarna AB Namn-Aktier B SK 100 | 0,03 |
| IT0005090300 | Infrastrutt. Wireless Italiane Azioni nom. o.N. | 0,03 |
| BE0003717312 | Sofina S.A. Actions Nom. o.N. | 0,03 |
| SE0010100958 | Latour Investment AB Namn-Aktier B SK -,208325 | 0,03 |
| FR0000130395 | Rémy Cointreau S.A. Actions au Porteur EO 1,60 | 0,03 |
| FR0000121121 | Eurazeo SE Actions au Porteur o.N. | 0,03 |
| CH0012255144 | Swatch Group AG, The Namens-Aktien SF 0,45 | 0,03 |
| CH1176493729 | Bachem Holding AG Namens-Aktien SF 0,01 | 0,03 |
| FR0000131906 | Renault S.A. Actions Port. EO 3,81 | 0,03 |
| GB00B1VZ0M25 | Hargreaves Lansdown PLC Registered Shares DL-,004 | 0,03 |
| NO0010582521 | Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer NK 2 | 0,03 |
| NL0014332678 | JDE Peets N.V. Registered Shares EO-,01 | 0,03 |
| BE0974464977 | Syensqo N.V. Actions au Porteur o.N. | 0,03 |
| FR0011981968 | Worldline S.A. Actions Port. EO -,68 | 0,03 |
| ES0171996087 | Grifols S.A. Acciones Port. Class A EO -,25 | 0,03 |
| IT0003492391 | Diasorin S.p.A. Azioni nom. EO 1 | 0,03 |
| ES0130670112 | Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20 | 0,03 |
| DE0005439004 | Continental AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,03 |
| DE000A161408 | HelloFresh SE Inhaber-Aktien o.N. | 0,03 |
| LU1598757687 | ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN | 0,03 |
| DE0005190037 | Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien o.St. EO 1 | 0,03 |
| IT0003497168 | Telecom Italia S.p.A. Azioni nom. o.N. | 0,03 |
| IT0003153415 | Snam S.p.A. Azioni nom. o.N. | 0,02 |
| GB00B019KW72 | Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -,28571428 | 0,02 |
| DE0006062144 | Covestro AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,02 |
| DE000WCH8881 | Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,02 |
| NO0005052605 | Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer NK 1,098 | 0,02 |
| BE0974320526 | Umicore S.A. Actions Nom. o.N. | 0,01 |
| NO0010208051 | Yara International ASA Navne-Aksjer NK 1,70 | 0,01 |
| DE000EVNK013 | Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N. | 0,01 |
| ES0130960018 | Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50 | 0,01 |
| ES0116870314 | Naturgy Energy Group S.A. Acciones Port. EO 1 | 0,01 |
| AT0000937503 | voestalpine AG Inhaber-Aktien o.N. | 0,01 |
| SE0016844831 | Volvo Car AB Namn-Aktier B o.N. | 0,01 |
| NL0010558797 | OCI N.V. Registered Shares EO 0,02 | 0,01 |
| IE0002424939 | DCC PLC Registered Shares EO -,25 | 0,00 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Januar 2024.

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens ¹⁾ |
|------------------------------------|--------------------|-----------------------|---|
| I. Vermögensgegenstände | | 692.737.264,13 | 101,32 |
| 1. Aktien | | 682.491.158,73 | 99,82 |
| - Audiovisuelle Industrie | 3.824.294,45 | | 0,56 |
| - Banken | 67.808.885,52 | | 9,92 |
| - Bau und Baustoffe | 36.515.360,44 | | 5,34 |
| - Bergbau | 3.666.756,20 | | 0,54 |
| - Büroausstattung | 4.012.395,29 | | 0,59 |
| - Chemische Industrie | 18.900.723,12 | | 2,76 |
| - Einzelhandel | 26.890.515,46 | | 3,93 |
| - Elektrik / Elektronik | 76.689.373,38 | | 11,22 |
| - Energieversorger | 48.116.571,07 | | 7,04 |
| - Freizeit/Tourismus | 1.372.694,23 | | 0,20 |
| - Holdinggesellschaften | 4.593.905,78 | | 0,67 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 26.034.662,54 | | 3,81 |
| - Papier und andere Basisprodukte | 2.663.910,71 | | 0,39 |
| - Papier- und Verpackungsindustrie | 1.133.836,82 | | 0,17 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 152.308.503,35 | | 22,28 |
| - Real Estate | 8.200.399,51 | | 1,20 |
| - Software | 30.763.751,75 | | 4,50 |
| - Sonstige Dienstleistungen | 17.852.957,27 | | 2,61 |
| - Sonstige Finanzdienstleistungen | 8.643.282,20 | | 1,26 |
| - Sonstige industrielle Werte | 12.787.568,18 | | 1,87 |
| - Telekommunikation | 15.903.330,66 | | 2,33 |
| - Textilien und Kleidung | 32.197.052,85 | | 4,71 |
| - Transportation | 10.931.866,36 | | 1,60 |
| - Unterhaltungsindustrie | 5.870.075,64 | | 0,86 |
| - Verbrauchsgüter | 32.142.709,31 | | 4,70 |
| - Versicherungen | 32.665.776,64 | | 4,78 |
| 2. Forderungen | | 9.525.281,12 | 1,39 |
| 3. Bankguthaben | | 720.824,28 | 0,11 |
| II. Verbindlichkeiten | | -9.040.433,93 | -1,32 |
| III. Fondsvermögen | | 683.696.830,20 | 100,00 |

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

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.01.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---------------|----------------------------------|-------|--|-----------------------|--|----------------------|-----------------|--------------------|------------------------------|
| GB0000456144 | Antofagasta PLC | STK | | 34.014 | 13.669 | 7.300 | GBP 17,350 | 691.843,96 | 0,10 |
| LU1598757687 | ArcelorMittal S.A. | STK | | 6.873 | 7.127 | 254 | EUR 25,640 | 176.223,72 | 0,03 |
| NL0010832176 | argenx SE | STK | | 3.618 | 656 | 885 | EUR 348,800 | 1.261.958,40 | 0,18 |
| FR0010313833 | Arkema S.A. | STK | | 3.934 | 3.571 | 3.715 | EUR 101,300 | 398.514,20 | 0,06 |
| GB0000536739 | Ashtead Group PLC | STK | | 42.849 | 12.322 | 15.001 | GBP 52,020 | 2.613.135,97 | 0,38 |
| NL0000334118 | ASM International N.V. | STK | | 4.211 | 632 | 1.030 | EUR 516,200 | 2.173.718,20 | 0,32 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. | STK | | 38.049 | 10.812 | 13.410 | EUR 798,200 | 30.370.711,80 | 4,44 |
| NL0011872643 | ASR Nederland N.V. | STK | | 10.122 | 10.676 | 554 | EUR 43,710 | 442.432,62 | 0,06 |
| SE0007100581 | Assa-Abloy AB | STK | | 89.865 | 14.824 | 21.081 | SEK 286,700 | 2.295.566,94 | 0,34 |
| IT0000062072 | Assicurazioni Generali S.p.A. | STK | | 64.789 | 10.395 | 25.845 | EUR 20,690 | 1.340.484,41 | 0,20 |
| GB0006731235 | Associated British Foods PLC | STK | | 29.788 | 27.271 | 30.410 | GBP 23,410 | 817.511,23 | 0,12 |
| GB0009895292 | AstraZeneca PLC | STK | | 152.784 | 44.687 | 53.907 | GBP 105,000 | 18.806.940,21 | 2,75 |
| SE0017486897 | Atlas Copco AB | STK | | 146.103 | 42.772 | 51.928 | SEK 144,750 | 1.884.297,72 | 0,28 |
| SE0017486889 | Atlas Copco AB | STK | | 251.425 | 73.602 | 89.358 | SEK 166,950 | 3.739.956,68 | 0,55 |
| GB00BVYVFW23 | Auto Trader Group PLC | STK | | 57.032 | 8.714 | 18.029 | GBP 7,288 | 487.279,27 | 0,07 |
| GB00BPQY8M80 | Aviva PLC | STK | | 175.107 | 26.606 | 53.960 | GBP 138,300 | 887.441,45 | 0,13 |
| FR0000120628 | AXA S.A. | STK | | 115.355 | 17.762 | 37.425 | EUR 31,160 | 3.594.461,80 | 0,53 |
| CH1176493729 | Bachem Holding AG | STK | | 3.301 | 1.044 | 1.158 | CHF 58,200 | 206.179,65 | 0,03 |
| CH0012410517 | Bâloise Holding AG | STK | | 2.929 | 436 | 815 | CHF 138,300 | 434.729,23 | 0,06 |
| ES0113211835 | Banco Bilbao Vizcaya Argent. | STK | | 380.976 | 57.532 | 113.790 | EUR 8,676 | 3.305.347,78 | 0,48 |
| IT0005218380 | Banco BPM S.p.A. | STK | | 76.829 | 79.674 | 2.845 | EUR 5,010 | 384.913,29 | 0,06 |
| ES0113900J37 | Banco Santander S.A. | STK | | 1.034.868 | 158.936 | 337.093 | EUR 3,736 | 3.865.749,41 | 0,57 |
| IE00BD1RP616 | Bank of Ireland Group PLC | STK | | 67.125 | 10.096 | 19.634 | EUR 8,532 | 572.710,50 | 0,08 |
| CH0531751755 | Banque Cantonale Vaudoise | STK | | 1.915 | 287 | 543 | CHF 110,800 | 227.711,96 | 0,03 |
| GB0031348658 | Barclays PLC | STK | | 961.837 | 151.635 | 345.913 | GBP 1,484 | 1.673.573,83 | 0,24 |
| GB0000811801 | Barratt Developments PLC | STK | | 90.267 | 13.415 | 24.501 | GBP 5,404 | 571.867,37 | 0,08 |
| CH0009002962 | Barry Callebaut AG | STK | | 308 | 51 | 73 | CHF 1.266,000 | 418.467,48 | 0,06 |
| NL0012866412 | BE Semiconductor Inds N.V. | STK | | 6.961 | 7.254 | 293 | EUR 139,800 | 973.147,80 | 0,14 |
| SE0015949748 | Beijer Ref AB | STK | | 36.537 | 40.400 | 3.863 | SEK 142,800 | 464.871,35 | 0,07 |
| GB00BLJNXL82 | Berkeley Group Holdings PLC | STK | | 9.856 | 1.490 | 2.466 | GBP 48,010 | 554.732,19 | 0,08 |
| FR0013280286 | bioMerieux | STK | | 4.038 | 1.140 | 1.437 | EUR 100,000 | 403.800,00 | 0,06 |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. | STK | | 67.056 | 10.456 | 23.530 | EUR 62,550 | 4.194.352,80 | 0,61 |
| SE0020050417 | Boliden AB | STK | | 24.189 | 44.756 | 20.567 | SEK 276,950 | 596.885,42 | 0,09 |
| FR0000120503 | Bouygues S.A. | STK | | 44.943 | 7.096 | 16.643 | EUR 33,980 | 1.527.163,14 | 0,22 |
| GB0030913577 | BT Group PLC | STK | | 412.113 | 65.255 | 155.185 | GBP 1,122 | 542.075,96 | 0,08 |
| GB00B0744B38 | Bunzl PLC | STK | | 32.446 | 5.395 | 7.637 | GBP 32,150 | 1.222.906,10 | 0,18 |
| GB0031743007 | Burberry Group PLC | STK | | 33.449 | 5.123 | 10.300 | GBP 13,080 | 512.910,81 | 0,08 |
| FR0006174348 | Bureau Veritas SA | STK | | 18.400 | 2.725 | 4.950 | EUR 24,700 | 454.480,00 | 0,07 |
| ES0140609019 | Caixabank S.A. | STK | | 263.467 | 41.657 | 98.439 | EUR 3,954 | 1.041.748,52 | 0,15 |
| FR0000125338 | Capgemini SE | STK | | 9.989 | 1.565 | 3.406 | EUR 207,200 | 2.069.720,80 | 0,30 |
| DK0010181759 | Carlsberg AS | STK | | 6.452 | 1.155 | 1.485 | DKK 889,200 | 769.705,90 | 0,11 |
| FR0000120172 | Carrefour S.A. | STK | | 54.669 | 9.667 | 15.239 | EUR 15,820 | 864.863,58 | 0,13 |
| ES0105066007 | Cellnex Telecom S.A. | STK | | 35.260 | 6.414 | 8.010 | EUR 35,780 | 1.261.602,80 | 0,18 |
| CH0010570759 | Chocoladef. Lindt & Sprüngli | STK | | 10 | 0 | 0 | CHF 109.400,000 | 1.174.071,69 | 0,17 |
| CH0010570767 | Chocoladef. Lindt & Sprüngli | STK | | 86 | 14 | 27 | CHF 11.000,000 | 1.015.239,32 | 0,15 |
| CH0210483332 | Cie Financière Richemont AG | STK | | 50.120 | 10.917 | 12.623 | CHF 129,000 | 6.938.699,29 | 1,01 |
| FR001400AJ45 | Cie Générale États Michelin SCPA | STK | | 44.382 | 41.610 | 58.924 | EUR 30,820 | 1.367.853,24 | 0,20 |
| CH0012142631 | Clariant AG | STK | | 19.293 | 17.266 | 18.062 | CHF 11,110 | 230.033,52 | 0,03 |
| GB00BD142631 | Coca-Cola Europacific Pa. PLC | STK | | 17.940 | 3.000 | 4.221 | USD 68,900 | 1.137.920,37 | 0,17 |
| CH0198251305 | Coca-Cola HBC AG | STK | | 19.063 | 17.116 | 16.666 | GBP 23,280 | 520.265,70 | 0,08 |
| DK00060448595 | Coloplast AS | STK | | 13.315 | 4.765 | 3.751 | DKK 797,600 | 1.424.811,20 | 0,21 |
| FR0000125007 | Compagnie de Saint-Gobain S.A. | STK | | 41.426 | 37.571 | 43.963 | EUR 65,840 | 2.727.487,84 | 0,40 |
| GB00BD6K4575 | Compass Group PLC | STK | | 102.391 | 15.686 | 32.557 | GBP 21,780 | 2.614.391,54 | 0,38 |
| ES0105563003 | Corporacion Acciona Energias R | STK | | 20.088 | 24.756 | 4.668 | EUR 24,100 | 484.120,80 | 0,07 |
| FR0000064578 | Covivio S.A. | STK | | 4.985 | 1.756 | 1.710 | EUR 45,160 | 225.122,60 | 0,03 |
| FR0000045072 | Crédit Agricole S.A. | STK | | 68.266 | 11.541 | 30.667 | EUR 13,310 | 908.756,99 | 0,13 |
| IE0001827041 | CRH PLC | STK | | 41.768 | 37.603 | 41.475 | GBP 56,240 | 2.753.847,97 | 0,40 |
| GB00BJFFLV09 | Croda International PLC | STK | | 12.492 | 1.840 | 3.003 | GBP 48,050 | 703.681,83 | 0,10 |
| DK0010274414 | Danske Bank AS | STK | | 44.105 | 6.581 | 12.301 | DKK 185,650 | 1.098.534,71 | 0,16 |
| FR0014003TT8 | Dassault Systemes SE | STK | | 101.268 | 15.074 | 27.824 | EUR 48,235 | 4.884.661,98 | 0,71 |
| NL00154335975 | Davide Campari-Milano N.V. | STK | | 49.373 | 14.313 | 16.874 | EUR 9,410 | 464.599,93 | 0,07 |
| IE0002424939 | DCC PLC | STK | | 284 | 150 | 1.217 | GBP 57,560 | 19.164,17 | 0,00 |
| DK0060738599 | Demant AS | STK | | 9.634 | 2.618 | 2.395 | DKK 313,800 | 405.593,13 | 0,06 |
| GB0002374006 | Diageo PLC | STK | | 208.739 | 59.264 | 74.937 | GBP 28,605 | 6.999.975,50 | 1,02 |
| IT0003492391 | Diasorin S.p.A. | STK | | 2.180 | 698 | 1.137 | EUR 85,540 | 186.477,20 | 0,03 |
| BE0974259880 | D'leteren Group S.A. | STK | | 2.111 | 340 | 846 | EUR 187,700 | 396.234,70 | 0,06 |
| NO0010161896 | DNB Bank ASA | STK | | 59.170 | 8.864 | 16.889 | NOK 205,100 | 1.068.430,43 | 0,16 |
| CH1216478797 | DSM-Firmenich AG | STK | | 15.791 | 18.639 | 2.848 | EUR 98,080 | 1.548.781,28 | 0,23 |
| DK0060079531 | DSV Panalpina A/S | STK | | 17.479 | 2.578 | 4.526 | DKK 1.237,500 | 2.901.969,17 | 0,42 |
| FR0010908533 | Edenred S.A. | STK | | 15.410 | 2.300 | 4.306 | EUR 55,420 | 854.022,20 | 0,12 |
| ES0127797019 | EDP Renováveis S.A. | STK | | 92.408 | 21.984 | 22.828 | EUR 15,050 | 1.390.740,40 | 0,20 |
| FR0000130452 | Eiffage S.A. | STK | | 7.006 | 1.235 | 2.561 | EUR 97,080 | 680.142,48 | 0,10 |
| BE0003822393 | Elia Group | STK | | 8.847 | 1.558 | 3.261 | EUR 111,800 | 989.094,60 | 0,14 |
| FI0009007884 | Elisa Oyj | STK | | 8.948 | 1.331 | 2.466 | EUR 42,250 | 378.053,00 | 0,06 |
| CH0016440353 | Ems-Chemie Holding AG | STK | | 421 | 73 | 98 | CHF 655,500 | 296.163,88 | 0,04 |
| ES0130960018 | Enagas S.A. | STK | | 4.076 | 673 | 958 | EUR 15,090 | 61.506,84 | 0,01 |
| GB00BL6K5J42 | Endeavour Mining PLC | STK | | 16.169 | 18.078 | 1.909 | GBP 14,120 | 267.650,97 | 0,04 |
| ES0130670112 | Endesa S.A. | STK | | 10.088 | 10.462 | 374 | EUR 18,360 | 185.215,68 | 0,03 |
| IT0003128367 | ENEL S.p.A. | STK | | 731.037 | 779.089 | 48.052 | EUR 6,341 | 4.635.505,62 | 0,68 |
| FR0010208488 | Engie S.A. | STK | | 45.806 | 48.093 | 2.287 | EUR 14,810 | 678.386,86 | 0,10 |
| IM00BSVQMV65 | Entain PLC | STK | | 38.841 | 7.897 | 9.517 | GBP 9,682 | 440.865,84 | 0,06 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.01.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens | |
|--------------|--------------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|---------------------------------------|-------------------|------|-----------------|----------------------|------|
| NO0003054108 | Mowi ASA | STK | | 41.480 | 10.598 | 8.515 | NOK | 189,800 | 693.128,85 | 0,10 |
| GB00BDR05C01 | National Grid PLC | STK | | 108.705 | 34.705 | 23.865 | GBP | 10,550 | 1.344.475,67 | 0,20 |
| ES0116870314 | Naturgy Energy Group S.A. | STK | | 2.346 | 2.471 | 125 | EUR | 25,000 | 58.650,00 | 0,01 |
| GB00BM8PJY71 | NatWest Group PLC | STK | | 368.118 | 73.300 | 88.782 | GBP | 2,252 | 971.866,05 | 0,14 |
| FI0009013296 | Neste Oyj | STK | | 11.013 | 12.554 | 12.475 | EUR | 32,050 | 352.966,65 | 0,05 |
| GB0032089863 | NEXT PLC | STK | | 11.507 | 1.741 | 3.452 | GBP | 84,680 | 1.142.336,18 | 0,17 |
| SE0015988019 | NIBE Industrier AB | STK | | 371.805 | 107.001 | 122.865 | SEK | 62,740 | 2.078.410,99 | 0,30 |
| NL0010773842 | NN Group N.V. | STK | | 17.313 | 3.793 | 6.634 | EUR | 38,040 | 658.586,52 | 0,10 |
| FI0009000681 | Nokia Oyj | STK | | 516.908 | 81.112 | 115.006 | EUR | 3,322 | 1.717.168,38 | 0,25 |
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp | STK | | 204.681 | 244.046 | 282.222 | EUR | 11,428 | 2.339.094,47 | 0,34 |
| NO0005052605 | Norsk Hydro ASA | STK | | 21.512 | 10.471 | 77.254 | NOK | 61,940 | 117.308,91 | 0,02 |
| CH0012005267 | Novartis AG | STK | | 201.871 | 48.652 | 72.465 | CHF | 89,400 | 19.368.177,08 | 2,83 |
| DK0062498333 | Novo-Nordisk AS | STK | | 322.477 | 345.849 | 23.372 | DKK | 774,800 | 33.521.184,87 | 4,90 |
| DK0060336014 | Novozymes A/S | STK | | 67.555 | 25.700 | 11.904 | DKK | 354,300 | 3.211.143,06 | 0,47 |
| GB003MB5747 | Ocado Group PLC | STK | | 56.238 | 16.634 | 20.260 | GBP | 5,466 | 360.371,52 | 0,05 |
| NL0010558797 | OCI N.V. | STK | | 1.584 | 1.643 | 59 | EUR | 26,620 | 42.166,08 | 0,01 |
| FR000133308 | Orange S.A. | STK | | 114.674 | 18.103 | 42.562 | EUR | 10,998 | 1.261.184,65 | 0,18 |
| FR000120321 | Oréal S.A., L' | STK | | 23.118 | 6.688 | 8.141 | EUR | 444,700 | 10.280.574,60 | 1,50 |
| FI0009014377 | Orion Corp. | STK | | 10.588 | 3.044 | 3.584 | EUR | 42,720 | 452.319,36 | 0,07 |
| NO0003733800 | Orkla ASA | STK | | 61.442 | 10.893 | 19.841 | NOK | 82,500 | 446.270,63 | 0,07 |
| DK0060094928 | Orsted A/S | STK | | 55.775 | 11.671 | 11.771 | DKK | 391,500 | 2.929.559,68 | 0,43 |
| DK0060252690 | Pandora A/S | STK | | 7.758 | 1.340 | 2.491 | DKK | 1.009,000 | 1.050.199,84 | 0,15 |
| CH0024608827 | Partners Group Holding AG | STK | | 3.449 | 707 | 843 | CHF | 1.173,000 | 4.341.786,86 | 0,64 |
| GB0006776081 | Pearson PLC | STK | | 40.396 | 6.213 | 13.136 | GBP | 9,716 | 460.126,07 | 0,07 |
| FR000120693 | Pernod-Ricard S.A. | STK | | 19.224 | 6.119 | 6.977 | EUR | 152,500 | 2.931.660,00 | 0,43 |
| GB0006825383 | Persimmon PLC | STK | | 29.568 | 4.896 | 6.962 | GBP | 14,630 | 507.127,60 | 0,07 |
| GB00BGXQNP29 | Phoenix Group Holdings PLC | STK | | 48.031 | 7.158 | 13.306 | GBP | 5,054 | 284.582,26 | 0,04 |
| IT0003796171 | Poste Italiane S.p.A. | STK | | 32.476 | 4.871 | 9.277 | EUR | 10,065 | 326.870,94 | 0,05 |
| GB0007099541 | Prudential PLC | STK | | 174.009 | 26.011 | 49.056 | GBP | 8,184 | 1.669.507,22 | 0,24 |
| IT0004176001 | Prysmian S.p.A. | STK | | 23.347 | 21.191 | 22.074 | EUR | 40,990 | 956.993,53 | 0,14 |
| FR000130577 | Publicis Groupe S.A. | STK | | 14.284 | 2.128 | 3.958 | EUR | 93,100 | 1.329.840,40 | 0,19 |
| NL0015001WM6 | Qiagen N.V. | STK | | 21.681 | 21.878 | 197 | EUR | 40,405 | 876.020,81 | 0,13 |
| NL0000379121 | Randstad N.V. | STK | | 6.974 | 1.110 | 2.677 | EUR | 52,760 | 367.948,24 | 0,05 |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group | STK | | 63.238 | 10.590 | 14.851 | GBP | 57,080 | 4.231.682,34 | 0,62 |
| IT0003828271 | Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA | STK | | 10.199 | 2.983 | 3.611 | EUR | 51,300 | 523.208,70 | 0,08 |
| ES0173093024 | Red Electrica Corporacion S.A. | STK | | 111.898 | 33.267 | 41.951 | EUR | 15,430 | 1.726.586,14 | 0,25 |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC | STK | | 117.653 | 17.786 | 35.192 | GBP | 32,620 | 4.499.227,27 | 0,66 |
| FR000130395 | Rémy Cointreau S.A. | STK | | 2.193 | 605 | 752 | EUR | 94,280 | 206.756,04 | 0,03 |
| FR000131906 | Renault S.A. | STK | | 5.830 | 6.109 | 279 | EUR | 35,070 | 204.458,10 | 0,03 |
| GB00B082RF11 | Rentokil Initial PLC | STK | | 242.329 | 69.937 | 83.313 | GBP | 4,083 | 1.159.940,57 | 0,17 |
| GB0007188757 | Rio Tinto PLC | STK | | 18.047 | 3.024 | 4.402 | GBP | 55,030 | 1.164.274,81 | 0,17 |
| CH0012032113 | Roche Holding AG | STK | | 3.149 | 1.417 | 1.057 | CHF | 261,800 | 884.748,01 | 0,13 |
| DK0010219153 | Rockwool International A/S | STK | | 2.213 | 486 | 497 | DKK | 1.890,000 | 561.143,87 | 0,08 |
| GB00B8C3BL03 | Sage Group PLC, The | STK | | 62.396 | 9.252 | 16.823 | GBP | 11,780 | 861.693,88 | 0,13 |
| GB00B019KW72 | Sainsbury PLC, J. | STK | | 52.218 | 20.441 | 146.445 | GBP | 2,702 | 165.408,02 | 0,02 |
| NO0010310956 | Salmar ASA | STK | | 6.744 | 2.699 | 2.299 | NOK | 584,800 | 347.219,37 | 0,05 |
| FI4000552500 | Sampo Oyj | STK | | 28.866 | 30.746 | 1.880 | EUR | 38,785 | 1.119.567,81 | 0,16 |
| SE0000667891 | Sandvik AB | STK | | 95.133 | 17.126 | 22.810 | SEK | 219,400 | 1.859.685,50 | 0,27 |
| FR000120578 | Sanoft S.A. | STK | | 112.171 | 32.106 | 39.061 | EUR | 93,360 | 10.472.284,56 | 1,53 |
| FR0013154002 | Sartorius Stedim Biotech S.A. | STK | | 2.675 | 790 | 948 | EUR | 251,200 | 671.960,00 | 0,10 |
| CH0024638212 | Schindler Holding AG | STK | | 2.112 | 349 | 499 | CHF | 206,400 | 467.822,28 | 0,07 |
| CH0024638196 | Schindler Holding AG | STK | | 3.664 | 604 | 863 | CHF | 216,000 | 849.349,65 | 0,12 |
| FR000121972 | Schneider Electric SE | STK | | 127.289 | 19.146 | 31.045 | EUR | 182,900 | 23.281.158,10 | 3,41 |
| GB00BP9LHF23 | Schroders PLC | STK | | 51.186 | 11.225 | 12.523 | GBP | 4,062 | 243.748,57 | 0,04 |
| FR000121709 | SEB S.A. | STK | | 2.249 | 2.025 | 2.182 | EUR | 113,500 | 255.261,50 | 0,04 |
| SE000163594 | Securitas AB | STK | | 30.323 | 4.549 | 8.683 | SEK | 101,350 | 273.821,54 | 0,04 |
| GB00B5ZN1N88 | Segro PLC | STK | | 113.256 | 33.701 | 45.847 | GBP | 8,818 | 1.170.798,84 | 0,17 |
| GB00B1FH8J72 | Severn Trent PLC | STK | | 26.774 | 7.981 | 7.985 | GBP | 25,980 | 815.461,34 | 0,12 |
| CH1256740924 | SGS S.A. | STK | | 9.436 | 12.284 | 2.848 | CHF | 80,040 | 810.535,99 | 0,12 |
| CH0435377954 | SIG Group AG | STK | | 26.476 | 4.733 | 6.213 | CHF | 18,160 | 515.995,02 | 0,08 |
| CH0418792922 | Sika AG | STK | | 13.234 | 2.498 | 2.846 | CHF | 240,100 | 3.410.048,72 | 0,50 |
| SE000148884 | Skandinaviska Enskilda Banken | STK | | 101.470 | 15.355 | 30.613 | SEK | 148,150 | 1.339.402,19 | 0,20 |
| SE000113250 | Skanska AB | STK | | 33.135 | 29.825 | 31.607 | SEK | 181,150 | 534.806,90 | 0,08 |
| SE000108227 | SKF AB | STK | | 31.664 | 29.064 | 35.681 | SEK | 205,900 | 580.889,88 | 0,08 |
| GB0009223206 | Smith & Nephew PLC | STK | | 85.179 | 18.756 | 21.421 | GBP | 11,105 | 1.108.924,74 | 0,16 |
| GB00B1WY2338 | Smiths Group PLC | STK | | 20.819 | 3.213 | 6.905 | GBP | 16,225 | 396.000,33 | 0,06 |
| IE00B1RR8406 | Smurfit Kappa Group PLC | STK | | 22.133 | 20.421 | 15.617 | EUR | 34,550 | 764.695,15 | 0,11 |
| IT0003153415 | Snam S.p.A. | STK | | 37.653 | 34.321 | 32.004 | EUR | 4,529 | 170.530,44 | 0,02 |
| FR000130809 | Société Générale S.A. | STK | | 47.234 | 7.890 | 18.979 | EUR | 23,960 | 1.131.726,64 | 0,17 |
| FR000121220 | Sodexo S.A. | STK | | 5.268 | 786 | 1.474 | EUR | 104,600 | 551.032,80 | 0,08 |
| BE0003717312 | Sofina S.A. | STK | | 975 | 151 | 258 | EUR | 222,600 | 217.035,00 | 0,03 |
| CH0012549785 | Sonova Holding AG | STK | | 4.887 | 1.319 | 1.916 | CHF | 277,700 | 1.456.449,77 | 0,21 |
| GB00BWFGQN14 | Spirax-Sarco Engineering PLC | STK | | 6.904 | 2.034 | 2.431 | GBP | 100,050 | 809.783,35 | 0,12 |
| GB0007908733 | SSE PLC | STK | | 71.394 | 16.873 | 15.769 | GBP | 16,850 | 1.410.303,52 | 0,21 |
| GB0007669376 | St. James's Place PLC | STK | | 34.759 | 5.172 | 9.505 | GBP | 6,542 | 266.580,75 | 0,04 |
| GB0004082847 | Standard Chartered PLC | STK | | 146.540 | 23.575 | 57.549 | GBP | 5,988 | 1.028.700,49 | 0,15 |
| NL0000226223 | STMicroelectronics N.V. | STK | | 61.436 | 10.383 | 14.171 | EUR | 40,915 | 2.513.653,94 | 0,37 |
| FI0009005961 | Stora Enso Oyj | STK | | 52.293 | 47.322 | 47.079 | EUR | 11,815 | 617.841,80 | 0,09 |
| CH1175448666 | Straumann Holding AG | STK | | 10.718 | 3.132 | 3.782 | CHF | 132,400 | 1.522.926,81 | 0,22 |
| SE000112724 | Svenska Cellulosa AB | STK | | 55.356 | 9.083 | 13.408 | SEK | 142,050 | 700.612,09 | 0,10 |
| SE0007100599 | Svenska Handelsbanken AB | STK | | 93.267 | 13.913 | 26.008 | SEK | 112,550 | 935.287,64 | 0,14 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.01.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|----------------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-------------|-----------------|----------------------|
| CH0012255151 | Swatch Group AG, The | STK | | 2.680 | 459 | 644 | CHF 203,700 | 585.872,50 | 0,09 |
| CH0012255144 | Swatch Group AG, The | STK | | 4.872 | 833 | 1.170 | CHF 39,500 | 206.529,30 | 0,03 |
| SE0000242455 | Swedbank AB | STK | | 54.207 | 8.521 | 19.731 | SEK 212,800 | 1.027.776,50 | 0,15 |
| SE0000872095 | Swedish Orphan Biovitrum AB | STK | | 12.104 | 4.545 | 4.319 | SEK 292,000 | 314.907,83 | 0,05 |
| CH0014852781 | Swiss Life Holding AG | STK | | 1.887 | 291 | 631 | CHF 621,400 | 1.258.405,02 | 0,18 |
| CH0008038389 | Swiss Prime Site AG | STK | | 7.403 | 2.171 | 2.623 | CHF 87,700 | 696.762,29 | 0,10 |
| CH0126881561 | Swiss Re AG | STK | | 19.287 | 2.877 | 5.378 | CHF 99,100 | 2.051.235,99 | 0,30 |
| CH0008742519 | Swisscom AG | STK | | 1.615 | 240 | 451 | CHF 516,200 | 894.680,19 | 0,13 |
| BE0974464977 | Syensqo N.V. | STK | | 2.307 | 2.361 | 54 | EUR 82,490 | 190.304,43 | 0,03 |
| GB0008782301 | Taylor Wimpey PLC | STK | | 327.479 | 296.947 | 319.959 | GBP 1,482 | 568.961,17 | 0,08 |
| SE0005190238 | Tele2 AB | STK | | 33.405 | 5.246 | 12.105 | SEK 88,860 | 264.477,95 | 0,04 |
| IT0003497168 | Telecom Italia S.p.A. | STK | | 615.083 | 91.724 | 171.015 | EUR 0,279 | 171.546,65 | 0,03 |
| SE0000108656 | Telefonaktiebolaget LM.Erics. | STK | | 279.354 | 80.164 | 473.042 | SEK 57,300 | 1.436.905,28 | 0,21 |
| ES0178430E18 | Telefónica S.A. | STK | | 303.034 | 48.306 | 111.909 | EUR 3,770 | 1.142.438,18 | 0,17 |
| NO0010063308 | Telenor ASA | STK | | 38.043 | 6.300 | 16.039 | NOK 116,700 | 390.863,06 | 0,06 |
| FR0000051807 | Téléperformance SE | STK | | 3.626 | 542 | 1.017 | EUR 145,650 | 528.126,90 | 0,08 |
| SE0000667925 | Telia Company AB | STK | | 145.444 | 23.854 | 63.610 | SEK 26,880 | 348.334,72 | 0,05 |
| CH0012453913 | Temenos AG | STK | | 3.898 | 574 | 1.013 | CHF 88,380 | 369.720,15 | 0,05 |
| IT0003242622 | Terna Rete Elettrica Nazio.SpA | STK | | 331.228 | 92.741 | 115.704 | EUR 7,828 | 2.592.852,78 | 0,38 |
| DK0060636678 | Tryg AS | STK | | 22.326 | 3.413 | 7.096 | DKK 147,550 | 441.958,14 | 0,06 |
| CH0244767585 | UBS Group AG | STK | | 208.895 | 36.205 | 66.872 | CHF 25,990 | 5.826.551,89 | 0,85 |
| BE0003739530 | UCB S.A. | STK | | 12.486 | 3.651 | 4.418 | EUR 87,300 | 1.090.027,80 | 0,16 |
| BE0974320526 | Umicore S.A. | STK | | 4.799 | 2.306 | 17.911 | EUR 21,170 | 101.594,83 | 0,01 |
| FR0013326246 | Unibail-Rodamco-Westfield SE | STK | | 11.404 | 3.142 | 4.028 | EUR 66,980 | 763.839,92 | 0,11 |
| IT0005239360 | UniCredit S.p.A. | STK | | 102.308 | 18.065 | 53.658 | EUR 27,160 | 2.778.685,28 | 0,41 |
| GB00B39J2M42 | United Utilities Group PLC | STK | | 61.839 | 18.220 | 22.563 | GBP 10,665 | 773.168,75 | 0,11 |
| FI0009005987 | UPM Kymmene Corp. | STK | | 34.972 | 29.372 | 45.020 | EUR 33,670 | 1.177.507,24 | 0,17 |
| CH0311864901 | VAT Group AG | STK | | 2.527 | 740 | 894 | CHF 406,700 | 1.102.952,24 | 0,16 |
| FR0000124141 | Veolia Environnement S.A. | STK | | 41.208 | 36.766 | 38.520 | EUR 30,270 | 1.247.366,16 | 0,18 |
| AT0000746409 | Verbund AG | STK | | 20.772 | 6.082 | 7.345 | EUR 75,650 | 1.571.401,80 | 0,23 |
| DK0061539921 | Vestas Wind Systems AS | STK | | 297.748 | 57.046 | 69.011 | DKK 196,660 | 7.855.899,01 | 1,15 |
| FR0000125486 | VINCI S.A. | STK | | 48.948 | 8.220 | 14.161 | EUR 117,080 | 5.730.831,84 | 0,84 |
| FR0000127771 | Vivendi S.A. | STK | | 42.135 | 6.682 | 15.805 | EUR 10,455 | 440.521,43 | 0,06 |
| GB00BH4HKS39 | Vodafone Group PLC | STK | | 1.422.201 | 239.295 | 683.714 | GBP 0,673 | 1.122.421,70 | 0,16 |
| AT0000937503 | voestalpine AG | STK | | 1.738 | 833 | 6.166 | EUR 27,600 | 47.968,80 | 0,01 |
| SE0000115420 | Volvo (publ), AB | STK | | 17.772 | 15.899 | 17.339 | SEK 256,400 | 405.999,98 | 0,06 |
| SE0000115446 | Volvo (publ), AB | STK | | 133.931 | 119.816 | 130.669 | SEK 249,900 | 2.982.078,40 | 0,44 |
| SE0016844831 | Volvo Car AB | STK | | 18.998 | 16.973 | 18.371 | SEK 27,320 | 46.244,52 | 0,01 |
| BE0974349814 | Warehouses De Pauw N.V. | STK | | 16.865 | 4.811 | 28.664 | EUR 27,280 | 460.077,20 | 0,07 |
| FI0009003727 | Wärtsilä Corp. | STK | | 112.275 | 19.764 | 24.444 | EUR 13,700 | 1.538.167,50 | 0,22 |
| GB00B1KJJ408 | Whitbread PLC | STK | | 11.249 | 1.758 | 3.907 | GBP 35,960 | 474.225,13 | 0,07 |
| NL0000395903 | Wolters Kluwer N.V. | STK | | 15.621 | 2.446 | 5.410 | EUR 136,500 | 2.132.266,50 | 0,31 |
| FR0011981968 | Worldline S.A. | STK | | 15.057 | 2.238 | 4.115 | EUR 12,615 | 189.944,06 | 0,03 |
| JE00B8KF9B49 | WPP PLC | STK | | 67.218 | 10.160 | 20.149 | GBP 7,714 | 607.877,67 | 0,09 |
| NO0010208051 | Yara International ASA | STK | | 2.556 | 1.259 | 9.072 | NOK 349,400 | 78.625,38 | 0,01 |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG | STK | | 9.358 | 1.435 | 2.946 | CHF 439,100 | 4.409.849,54 | 0,65 |
| | | | | | | | EUR | 580.806.788,56 | 84,95 |
| Andere Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Ausland | | | | | | | | | |
| CH0012032048 | Roche Holding AG - Genussscheine | CHF | | 69.119 | 20.237 | 24.579 | % 247,100 | 18.329.367,78 | 2,68 |
| | | | | | | | EUR | 18.329.367,78 | 2,68 |
| | | | | | | | EUR | 682.491.158,73 | 99,82 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | | |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | | |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | EUR | | 733.813,58 | | | % 100,000 | 733.813,58 | 0,11 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | CHF | | 62,23 | | | % 100,000 | 66,78 | 0,00 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | NOK | | 10.142,93 | | | % 100,000 | 892,98 | 0,00 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | GBP | | 3.312,94 | | | % 100,000 | 3.883,87 | 0,00 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | |
| Dividendenansprüche | | EUR | | 302.348,13 | | | EUR | 9.525.281,12 | 1,39 |
| Forderungen Aktien | | EUR | | 6.035.647,84 | | | EUR | 302.348,13 | 0,04 |
| Geldforderungen | | EUR | | 2.752.194,38 | | | EUR | 6.035.647,84 | 0,88 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | EUR | | 435.090,77 | | | EUR | 2.752.194,38 | 0,40 |
| | | | | | | | EUR | 435.090,77 | 0,06 |
| Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme | | | | | | | | | |
| Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | DKK | | -31.809,92 | | | % 100,000 | -4.267,70 | -0,00 |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | SEK | | -82.453,84 | | | % 100,000 | -7.346,54 | -0,00 |
| Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| DekaBank Deutsche Girozentrale | | USD | | -6.755,05 | | | % 100,000 | -6.218,69 | -0,00 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| | | | | | | | EUR | -9.040.433,93 | -1,32 |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.01.2024 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|------|--|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------|-----------------|----------------------|
| | Geldverbindlichkeiten | | EUR | -2.761.371,66 | | | | -2.761.371,66 | -0,40 |
| | Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen | | EUR | -6.061.090,80 | | | | -6.061.090,80 | -0,89 |
| | Sonstige Verbindlichkeiten | | EUR | -75.329,00 | | | | -75.329,00 | -0,01 |
| | Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | | EUR | -142.642,47 | | | | -142.642,47 | -0,02 |
| | Fondsvermögen | | | | | | EUR | 683.696.830,20 | 100,00 ¹⁾ |
| | Anteilwert | | | | | | EUR | 15,17 | |
| | Umlaufende Anteile | | | | | | STK | 45.081.703,00 | |

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.01.2024

| Devisenkurse (in Mengennotiz) | | 31.01.2024 |
|-------------------------------|-------|-------------------------|
| Britisches Pfund | (GBP) | 0,85300 = 1 Euro (EUR) |
| Dänische Krone | (DKK) | 7,45365 = 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Krone | (NOK) | 11,35850 = 1 Euro (EUR) |
| Schwedische Krone | (SEK) | 11,22350 = 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken | (CHF) | 0,93180 = 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar | (USD) | 1,08625 = 1 Euro (EUR) |

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-------------------------------------|---|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE000A1J5RX9 | Telefónica Deutschland Hldg AG | STK | 9.306 | 82.049 | |
| DE0005089031 | United Internet AG | STK | 709 | 7.556 | |
| Ausland | | | | | |
| ES0167050246 | ACS, Act.de Constry Serv. SA | STK | 0 | 0 | |
| ES06670509N0 | ACS, Act.de Constry Serv. SA - Anrechte | STK | 5.393 | 5.393 | |
| ES06670509O8 | ACS, Act.de Constry Serv. SA - Anrechte | STK | 20.346 | 20.346 | |
| NL0000303709 | AEGON N.V. | STK | 13.634 | 142.659 | |
| NO0010345853 | Aker BP ASA | STK | 621 | 6.196 | |
| LU1673108939 | Aroundtown SA | STK | 10.687 | 113.853 | |
| SE0017768716 | Boliden AB | STK | 2.503 | 28.243 | |
| SE0020050425 | Boliden AB | STK | 25.302 | 25.302 | |
| GB0001367019 | British Land Co. PLC, The | STK | 22.814 | 113.831 | |
| GB00B033F229 | Centrica PLC | STK | 49.185 | 49.185 | |
| DK0060227585 | Christian Hansen Holding AS | STK | 2.979 | 13.793 | |
| NL0010545661 | CNH Industrial N.V. | STK | 83.221 | 181.454 | |
| CH0012138530 | Credit Suisse Group AG | STK | 19.745 | 210.340 | |
| FR000120644 | Danone S.A. | STK | 4.524 | 48.200 | |
| PTEDP0AM0009 | EDP - Energias de Portugal SA | STK | 978.797 | 978.797 | |
| ES0627797907 | EDP Renováveis S.A. - Anrechte | STK | 91.663 | 91.663 | |
| SE0016589188 | Electrolux, AB | STK | 2.169 | 23.104 | |
| SE0016828511 | Embracer Group AB | STK | 4.596 | 48.966 | |
| ES0118900010 | Ferrovial S.A. | STK | 16.269 | 66.850 | |
| FI0009007132 | Fortum Oyj | STK | 2.246 | 2.246 | |
| PTGALOAM0009 | Galp Energia SGPS S.A. | STK | 1.018 | 10.147 | |
| ES06445809Q1 | Iberdrola S.A. - Anrechte | STK | 570.416 | 570.416 | |
| ES06445809R9 | Iberdrola S.A. - Anrechte | STK | 1.431.822 | 1.431.822 | |
| SE0015811955 | Investor AB | STK | 3.719 | 39.626 | |
| GB00BZ4BQC70 | Johnson, Matthey PLC | STK | 1.962 | 19.532 | |
| NL0012015705 | Just Eat Takeaway.com N.V. | STK | 1.933 | 20.584 | |
| SE0015810247 | Kinnevik AB | STK | 1.811 | 19.282 | |
| NL0000009827 | Koninklijke DSM N.V. | STK | 615 | 16.636 | |
| NL0000009538 | Koninklijke Philips N.V. | STK | 13.074 | 101.535 | |
| FI4000552526 | Mandatum OYJ | STK | 29.873 | 29.873 | |
| GB00B1CRLC47 | Mondi PLC | STK | 27.891 | 60.585 | |
| CH0038863350 | Nestlé S.A. | STK | 0 | 192.784 | |
| DK0060534915 | Novo-Nordisk AS | STK | 210.039 | 383.617 | |
| NL0012169213 | Qiagen N.V. | STK | 6.662 | 30.209 | |
| FI0009003305 | Sampo OYJ | STK | 3.663 | 38.319 | |
| CH1243598427 | Sandoz Group AG | STK | 43.300 | 43.300 | |
| CH0002497458 | SGS S.A. | STK | 10.767 | 11.220 | |
| BE0003470755 | Solvay S.A. | STK | 1.753 | 6.513 | |
| SE0020846285 | Swedish Orphan Biovitrum AB - Anrechte | STK | 10.930 | 10.930 | |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--------------|----------------------------|--|---------------------------|------------------------------|-----------------------------|
| LU0156801721 | Tenaris S.A. | STK | 1.244 | 9.519 | |
| LU2598331598 | Tenaris S.A. | STK | 8.118 | 8.118 | |
| FR0000054470 | Ubisoft Entertainment S.A. | STK | 0 | 6.440 | |
| GB00B10RZP78 | Unilever PLC | STK | 25.154 | 267.967 | |
| FR0013176526 | Valéo S.E. | STK | 2.225 | 22.247 | |
| FR0000121204 | Wendel SE | STK | 249 | 2.135 | |

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.02.2023 bis zum 31.01.2024

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 1.697.851,02 | 0,038 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 17.012.430,54 | 0,377 |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | 68.485,52 | 0,002 |
| 4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -254.671,67 | -0,006 |
| 5. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -1.587.836,78 | -0,035 |
| 6. Sonstige Erträge | | 466,07 | 0,000 |
| davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern | 388,64 | | 0,000 |
| davon: Sonstiges | 77,43 | | 0,000 |
| Summe der Erträge | | 16.936.724,70 | 0,376 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme | | -3.321,37 | 0,000 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -1.641.910,54 | -0,036 |
| 3. Sonstige Aufwendungen | | -2.555,20 | 0,000 |
| davon: Bankgebühren | -179,91 | | 0,000 |
| davon: Sonstiges | -2.375,29 | | 0,000 |
| Summe der Aufwendungen | | -1.647.787,11 | -0,037 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 15.288.937,59 | 0,339 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 27.674.893,72 | 0,614 |
| 2. Realisierte Verluste | | -14.629.288,41 | -0,325 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 13.045.605,31 | 0,289 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 28.334.542,90 | 0,629 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | 52.505.172,22 | 1,165 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -9.493.720,99 | -0,211 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 43.011.451,23 | 0,954 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 71.345.994,13 | 1,583 |
| Entwicklung des Sondervermögens | | 2023 / 2024 | |
| | EUR | EUR | |
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 701.179.644,09 | |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -478.625,22 | |
| 2. Zwischenausschüttungen | | -14.060.140,90 | |
| 3. Mittelzufluss (netto) | | -74.630.363,46 | |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 65.812.374,70 | | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -140.442.738,16 | | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | 340.321,56 | |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 71.345.994,13 | |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | 52.505.172,22 | | |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -9.493.720,99 | | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | 683.696.830,20 | |
| Verwendung der Erträge des Sondervermögens | | | |
| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 83.224.642,95 | 1,846 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 54.890.100,05 | 1,218 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 28.334.542,90 | 0,629 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 68.262.867,99 | 1,514 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 0,00 | 0,000 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 68.262.867,99 | 1,514 |
| III. Gesamtausschüttung | | 14.961.774,96 | 0,332 |
| 1. Zwischenausschüttung | | 14.060.140,90 | 0,312 |
| 2. Endausschüttung | | 901.634,06 | 0,020 |

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

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre Geschäftsjahr

| | Sondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|-----------|---|---------------------------|
| 2023/2024 | 683.696.830,20 | 15,17 |
| 2022/2023 | 701.179.644,09 | 13,98 |
| 2021/2022 | 229.588.869,12 | 14,62 |
| 2020/2021 | 83.862.781,77 | 12,42 |

Deka MSCI Europe 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 | 15,17 |
| Umlaufende Anteile | STK | 45.081.703,00 |

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,82

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 31.01.2024 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 31.01.2024 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 %)

0,25

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

Transaktionskosten

EUR

351.807,80

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

131.986,42

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,01 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 26.037,85 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) | 0,07 |
| Höhe der Annual Tracking Difference | -0,01 |

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.

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Erträgen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Erträgen sind Korrektur Sollzinsen in Höhe von EUR 35,14 und Zinszahlungen in Höhe von EUR 409,30 und Vergleichszahlungen in Höhe von EUR 44,22 enthalten.

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind Domizilierungsgebühren in Höhe von EUR -182,62, Rückerstattung von Dividenden in Höhe von EUR -1158,00, Korrektur Habenzinsen in Höhe von EUR -1.450,77 und Korrekturzahlungen in Höhe von EUR -32,27 enthalten.

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

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

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

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

Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken:

Informationen zu den wesentlichen allgemeinen mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens sind im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Risikohinweise“ aufgeführt. Für die konkreten wesentlichen Risiken im Rumpfgeschäftsjahr 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. Verleiene 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 Geschäftsführungs-Ebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des 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 |
|---|----------------------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitendenvergütung | 63.521.373,38 |
| davon feste Vergütung | 47.888.259,53 |
| davon variable Vergütung | 15.633.113,85 |
| Zahl der Mitarbeitenden der KVG | 489 |
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitendengruppen** | 8.109.790,91 |
| 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 Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5299008L6EMCZCTOT769

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja
 Nein

| | |
|---|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 99,76% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es <input type="text"/> % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: <input type="text"/> % | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: <input type="text"/> % | <input type="checkbox"/> 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 Europe Climate Change ESG UCITS ETF ist ein passiv gemanagter börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF), der den MSCI Europe Climate Change ESG Select (Preisindex) nachbildet. Der zugrundeliegende Index umfasst Aktien von großen und mittelgroßen europäischen Unternehmen 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 gewichtete CO2-Intensität des Portfolios gegenüber der eines breiten Marktindex signifikant zu reduzieren. Dazu wurden Unternehmen, die dazu beitragen, dass CO2-Emissionen reduziert werden und über ein zukunftsfähiges Geschäftsmodell verfügen, hoch gewichtet. Gleichzeitig wurden Unternehmen, die bislang nicht zu einer Verringerung des CO2-Ausstoßes beitragen, stark untergewichtet. Diese Umgewichtung der Indextitel wurde anhand des sogenannten LCT Scores

vorgenommen. Der LCT-Score wird mit einem Wert zwischen 0 und 10 angegeben und ist ein Indikator dafür, wie hoch die Risiken und Chancen eines Unternehmens in Bezug auf den Wandel zu einer CO₂-emissionsarmen Wirtschaft sind und wie gut diese Risiken im Unternehmen gemanagt werden. Grundlage für die Zuordnung des LCT-Scores ist die CO₂- Intensität eines Unternehmens. Die CO₂-Intensität ist eine Kennzahl, die ausdrückt, wie hoch die CO₂-Emissionen im Verhältnis zum Unternehmenswert (EVIC = enterprise value including cash) sind. Die Unternehmen werden nach ihrem LCT-Score in eine der fünf LCT-Kategorien (Asset Stranding, Product Transition, Operational Transition, Neutral und Solution) eingeordnet.

Die Basis der Gewichte der einzelnen Unternehmen im Index bildet die Streubesitz-basierte Marktkapitalisierung. Dieses Gewicht wird anschließend mit einem Faktor, der sich aus LCT-Kategorie und -Score zusammensetzt, adjustiert. Unternehmen der Kategorie „Solution“, die aktiv dazu beitragen, dass CO₂- Emissionen reduziert werden, wurden dabei übergewichtet. Unternehmen der Kategorien „Asset Stranding“, „Product Transition“ und „Operational Transition“ wurden untergewichtet, da diese Unternehmen hohe Nachhaltigkeitsrisiken in Bezug auf den Übergang zu einer emissionsarmen Wirtschaft aufweisen.

- 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 entwickelt 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 5 % oder mehr ihres Umsatzes mit Waffensystemen, Komponenten oder unterstützenden Systemen und Dienstleistungen erzielten.
- die als „Produzent“ von Tabakwaren eingestuft waren oder 5 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel, dem Angebot und der Lizenzierung von Tabakerzeugnissen erzielten.
- die 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus Kohleverstromung 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 mehr als 0 % ihres Umsatzes mit unkonventionellem Erdöl und Erdgas erzielten, ihren eigenen Angaben zur Folge Erdöl oder Erdgas mit der Methode des hydraulischen Frackings oder Ölsand förderten.
- die mehr als 0 % ihres Umsatzes aus dem Abbau von Kohle und dem Verkauf an externe Parteien erzielten, ihren eigenen Angaben zur Folge Kohle förderten.
- die Atomkraftwerke betrieben oder besaßen oder mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielten.
- die Uranminen betrieben oder besaßen.

- mit einer CO₂Emissionsintensität (gemessen in Scope1 und 2 CO₂e/ Mio. USD Umsatz) von mehr als 1.500.
- mit einer Energieverbrauchsintensität (gemessen in GWh/ Mio. EUR Umsatz) von mehr als 300.
- die in den letzten drei Jahren mehr als eine schwere oder sehr schwere Kontroverse im Zusammenhang mit Menschenrechtsverletzungen hatten.
- 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.

Darüber hinaus wurden im Laufe des Berichtszeitraums zweimal neue Ausschlusskriterien eingeführt.

Mit Wirkung vom 01.06.2023 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.
- Zudem wurde die Umsatzschwelle für Unternehmen, die Uran abbauen von 0% auf 5% erhöht.

Außerdem wurden am 01.12.2023 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 CO₂-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 Europe 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 CO₂-Intensität von mindestens 30% im Vergleich zu einem

breiten Marktindex erfolgt. Darüber hinaus wird sichergestellt, dass die gewichtete CO₂-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 wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?“ wieder.

2. CO₂-Intensität

Der Indikator „CO₂-Intensität“ betrug im Berichtszeitraum 218,57 tCO₂e je 1 Mio. Euro Unternehmenswert 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 der Summe der CO₂-Emissionen der Unternehmen, in die das Finanzprodukt investiert, gemessen in tCO₂e. Diese wird mit 1 Mio. Euro Unternehmenswert der im Fonds enthaltenen Unternehmen, ins Verhältnis gesetzt. 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 13,57%. Die Abweichung resultiert aus der Offenlegung im letzten Berichtsjahr unter Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088.

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

| Referenzperiode | 01.02.2023- 31.01.2024 | 01.02.2022- 31.01.2023 |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Anzahl Verletzungen der Ausschlusskriterien | 0,00 | 0,00 |
| | Verletzungen | Verletzungen |
| CO2-Emissionsintensität (je 1 Mio. € Unternehmenswert) | 218,57 tCO2e | 233,50 tCO2e |
| Anteil nachhaltige Investitionen | 99,76% | 20,60% |
| Anteil Investitionen mit Umweltziel | 99,76% | 7,03% |
| Anteil der taxonomiekonformen Investitionen | 0,00% | 0,00% |
| Anteil Investitionen mit anderen Umweltzielen | 99,76% | 7,03% |
| Anteil Investitionen mit sozialem Ziel | 0,00% | 0,00% |
| Anteil nicht nachhaltige Investitionen | 0,24% | 79,40% |

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)

1)

- Anzahl der Fälle von schwerwiegenden Menschenrechtsverletzungen und sonstigen Vorfällen (PAI 14, aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 3)

Bei allen nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts, hielten die investierten Unternehmen einen definierten Schwellenwert bei der CO₂-Intensität (Scope 1 und Scope 2) und Energieverbrauchsintensität ein und waren nicht an der Herstellung oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen beteiligt. Zudem wurden keinem der Unternehmen bei den nachhaltigen Investitionen mehrfach Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren und/ oder UN Global Compact Verstöße vorgeworfen.

Die Bewertung erfolgte hauptsächlich auf Basis von ESG-Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC.

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 CO₂-Emissionsintensität (PAI 3, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) und Energieverbrauchsintensität (PAI 6, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) einen definierten Schwellenwert überschritt, die definierte Umsatzschwellen in kontroversen Geschäftsfeldern wie fossilen Brennstoffen (PAI 4, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) oder kontroversen Waffen (PAI 14, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) überschritten und die gegen soziale Mindeststandards verstießen, indem ihnen z.B. Verstöße gegen den UN Global Compact (PAI 10, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) oder mehrfach Menschenrechtsverletzungen (PAI 14, Tabelle 3, (EU) 2022/1288) vorgeworfen wurden. Eine ausführliche Beschreibung der Kriterien und Schwellenwerte bzw. Ausprägungen, die zum Ausschluss der Unternehmen geführt haben, findet sich im Abschnitt „Inwieweit 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 Finanzprodukts ausgeschlossen. Folgende PAI-Indikatoren für Unternehmen wurden im Rahmen dieser Maßnahme betrachtet:

- Treibhausgasemissionen (PAI 1 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- CO₂-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: 01.02.2023 - 31.01.2024

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 |
|--|---|-------------------------|------------------------|
| ASML Holding N.V. Aandelen op naam (NL0010273215) | Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion | 3,92% | Niederlande |
| LVMH Moët Hennessy L. Vuitton SE Action Port.(C.R.) (FR0000121014) | Gebrauchsgüter & Bekleidung | 3,32% | Frankreich |
| Schneider Electric SE Actions Port. (FR0000121972) | Investitionsgüter | 3,20% | Frankreich |
| SAP SE Inhaber-Aktien (DE0007164600) | Software & Dienste | 3,16% | Deutschland |
| AstraZeneca PLC Reg.Shares (GB0009895292) | Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 3,08% | Vereinigtes Königreich |
| Novartis AG Namens-Aktien (CH0012005267) | Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 3,04% | Schweiz |
| Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine (CH0012032048) | Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 2,98% | Schweiz |
| Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B (DK0062498333) | Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 2,49% | Dänemark |
| Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B (DK0060534915) | Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 1,95% | Dänemark |
| Sanofi S.A. Actions Port. (FR0000120578) | Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 1,68% | Frankreich |
| L'Oréal S.A. Actions Port. (FR0000120321) | Haushaltsartikel & Pflegeprodukte | 1,57% | Frankreich |
| HSBC Holdings PLC Reg.Shares (GB0005405286) | Banken | 1,39% | Vereinigtes Königreich |
| Diageo PLC Reg.Shares (GB0002374006) | Lebensmittel, Getränke & Tabak | 1,26% | Vereinigtes Königreich |
| Siemens AG Namens-Aktien (DE0007236101) | Investitionsgüter | 1,11% | Deutschland |
| Vestas Wind Systems A/S Navne-Aktier (DK0061539921) | Investitionsgüter | 1,10% | Dänemark |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

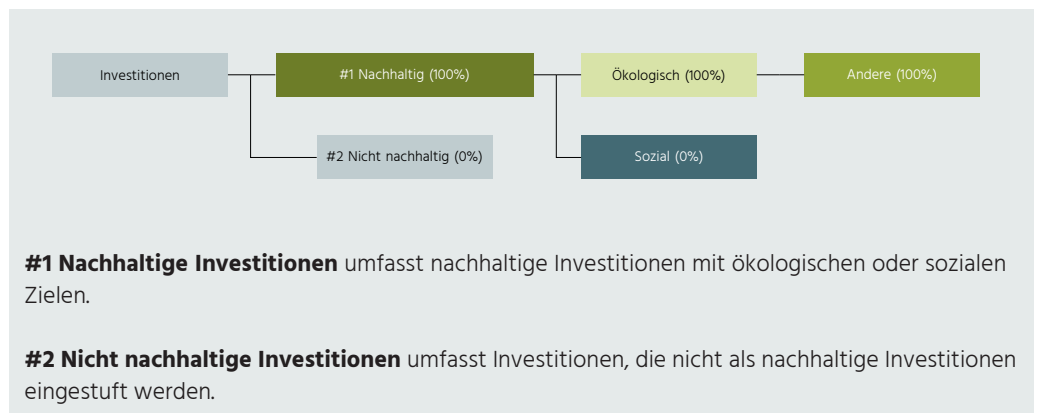
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels beitrugen (#1 Nachhaltig) betrug im Berichtszeitraum 99,76%. 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 Teilssektoren das Finanzprodukt während des Berichtszeitraums investierte, ist in der nachfolgenden Tabelle dargestellt.

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

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 3,24% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilssektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC zurückgegriffen. Der Anteil beinhaltet Unternehmen, die Umsätze im Bereich der fossilen Brennstoffe, einschließlich der Förderung, Verarbeitung, Lagerung und dem Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie thermischer und metallurgischer Kohle erwirtschaften.

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

| Sektor | Anteil |
|---|---------------|
| Basiskonsumgüter | 8,33% |
| Haushaltsartikel & Pflegeprodukte | 3,30% |
| Lebensmittel, Getränke & Tabak | 4,15% |
| Vertrieb und Einzelhandel von Basiskonsumgütern | 0,88% |
| Energie | 0,06% |
| Energie | 0,06% |
| Finanzwesen | 16,99% |
| Banken | 7,66% |
| Finanzdienstleistungen | 4,41% |
| Versicherungen | 4,92% |
| Gesundheitswesen | 21,50% |
| Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste | 2,77% |
| Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 18,73% |
| Immobilien | 1,20% |
| Gebäudemanagement & Immobilienentwicklung | 0,54% |
| Immobilienvermögensgesellschaften | 0,66% |
| Industrie | 18,49% |
| Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe | 1,97% |
| Investitionsgüter | 14,74% |
| Transportwesen | 1,78% |
| Informationstechnologie | 10,72% |
| Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion | 5,25% |
| Hardware & Ausrüstung | 1,14% |
| Software & Dienste | 4,33% |
| Kommunikationsdienste | 2,71% |
| Medien & Unterhaltung | 0,58% |
| Telekommunikationsdienste | 2,13% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 10,61% |
| Automobile & Komponenten | 0,67% |
| Dienstleistungsunternehmen | 1,69% |
| Gebrauchsgüter & Bekleidung | 7,14% |
| Vertrieb u. Einzelhandel für Nicht-Basiskonsumgüter | 1,11% |
| Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 4,38% |
| Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 4,38% |
| Sonstige | 0,25% |
| Sonstige | 0,25% |
| Versorgungsbetriebe | 4,78% |
| Versorgungsbetriebe | 4,78% |



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 CO2-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

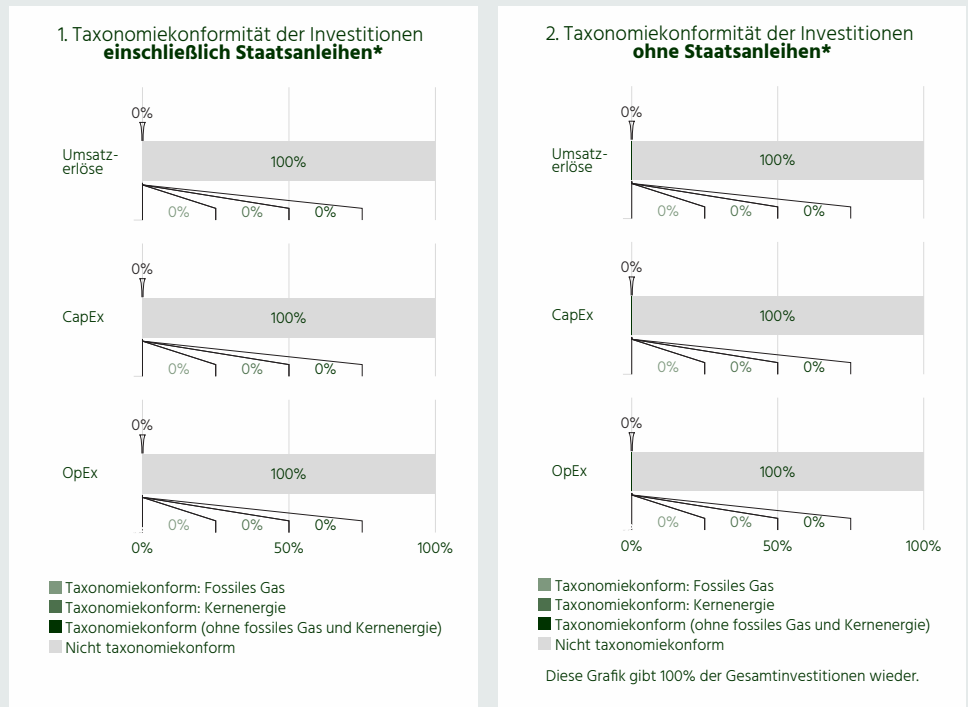
Nein

¹Tätigkeiten 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 CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

| Art der Wirtschaftstätigkeit | Anteil |
|------------------------------|--------|
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00% |
| Übergangstätigkeiten | 0,00% |

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der 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 CO₂-Intensität des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant reduziert. Zudem musste der Index sicherstellen, dass die CO₂-Intensität jährlich um mindestens 7 % im Vergleich zum Vorjahr sinkt. So wird dafür Sorge getragen, dass die CO₂-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 99,76%.

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 „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Unter „nicht nachhaltige Investitionen“ fielen alle Investitionen, die nicht nach den verbindlichen Elementen der ESG-Anlagestrategie ausgewählt wurden und damit nicht ausgerichtet auf das nachhaltige Investitionsziel 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 Europe Climate Change ESG Select (Preisindex) als Referenzwert bestimmt. Dieser erfüllt die Anforderungen an EU-Referenzwerte für den klimabedingten Wandel (EU Climate Transition Benchmarks, EU CTB). Hiermit wird dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung getragen.

Der zugrundeliegende Index unterscheidet sich von einem breiten Marktindex zum einen durch die reduzierte Anzahl der enthaltenen Titel in Folge der Anwendung der im Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“ beschriebenen Ausschlusskriterien. Zum anderen wird bei den verbleibenden Indextiteln zusätzlich eine Umgewichtung anhand des LCT Scores vorgenommen. Dadurch wird erreicht, dass die CO₂-Intensität des Portfolios um 30% gegenüber einem breiten Marktindex reduziert wird. Darüber hinaus sorgt die Umgewichtung dafür, dass die gewichtete CO₂-Intensität des

Portfolios jährlich um mindestens 7% im Vergleich zum Vorjahr sinkt. Darüber hinaus kann sich bspw. der ESG-Score bzw. das ESG-Rating des zugrundeliegenden Index insgesamt von dem Wert eines breiten Marktindex unterscheiden.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

| 01.02.2023 - 31.01.2024 | Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF |
|---|---|
| CO2-Emissionsintensität (in tCO2e je 1 Mio. € Unternehmenswert) | 218,57 |

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

| 01.02.2023 - 31.01.2024 | Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF | Referenzindex |
|---|---|---------------|
| CO2-Emissionsintensität (in tCO2e je 1 Mio. € Unternehmenswert) | 218,57 | 219,58 |

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

| 01.02.2023 - 31.01.2024 | Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF | Breiter Marktindex |
|---|---|--------------------|
| CO2-Emissionsintensität (in tCO2e je 1 Mio. € Unternehmenswert) | 218,57 | 619,01 |

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 Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Frankfurt am Main, den 26. April 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 Europe Climate Change ESG UCITS ETF – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Januar 2024, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2024, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Januar 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 Europe 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 30. April 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: 31. Januar 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

