Jahresbericht
zum 31. Januar 2022.

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

Deka Investments

Deka Investment GmbH

Finanzgruppe

Lizenzvermerk

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

Bericht der Geschäftsführung.

31. Januar 2022

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 2021 bis zum 31. Januar 2022.

In den vergangenen zwölf Monaten setzte sich die Erholung der globalen Wirtschaft und der internationalen Kapitalmärkte von den Belastungen der Corona-Pandemie fort. Die Mischung aus voranschreitenden Impfkampagnen und hoher Liquidität am Markt auf der Suche nach auskömmlichen Renditen führte trotz wechselhafter Konjunkturaussichten zu einer lebhaften Nachfrage an den Aktienmärkten. Für Beunruhigung sorgten hingegen im Jahresverlauf Lieferengpässe bei Rohstoffen und Vorprodukten sowie kräftig ansteigende Inflationsraten. Vor diesem Hintergrund trübten sich seit dem Herbst die Aussichten leicht ein.

Die Geld- und Fiskalpolitik war zunächst von Unterstützungsmaßnahmen wegen der Corona-Krise geprägt. In der zweiten Berichtshälfte rückte dann jedoch die Inflationsentwicklung in den Vordergrund. Nach anfänglichen Verlautbarungen der Notenbanken, dass es sich nur um ein kurzzeitiges Phänomen handeln sollte, wurden die Äußerungen Ende 2021 vorsichtiger und eine Anpassung in der Geldpolitik erkennbar. Sowohl die EZB wie auch die Fed in den USA haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet, wobei in den USA ein baldiges Ende der Kaufprogramme erwartet wird und sogar mehrere Leitzinsanhebungen in 2022 angedeutet wurden. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen im Jahresverlauf unter Schwankungen insgesamt merklich an. Ende Januar rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 0,0 Prozent gegenüber minus 0,5 Prozent vor einem Jahr, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen zuletzt bei plus 1,8 Prozent (Vorjahr plus 1,1 Prozent).

Ungeachtet der pandemischen Entwicklung sowie der Lieferkettenprobleme und wachsender Inflationssorgen verzeichneten auf Jahressicht die meisten Aktienmärkte steigende Kurse. Die Belastungsfaktoren ließen jedoch die Aufwärtsbewegung im Verlauf abebben und führten insbesondere im letzten Monat zu einem schwachen Jahresauftakt 2022. Zudem verzeichneten Technologiewerte nach den vorangegangenen starken Kurszuwächsen spürbare Abschläge und dokumentierten damit auch eine Branchenrotation hin zu defensiveren Segmenten.

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 Anteilinhaber 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 2022	20
Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2022	21
Anhang	30
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	33
Besteuerung der Erträge	35
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	40

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

Jahresbericht 01.02.2021 bis 31.01.2022
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 aus europäischen Industriestaaten. Für die Auswahl der Indexkonstituenten werden Unternehmen auf Grundlage von umweltbezogenen, sozialen und die Unternehmensführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) bewertet. Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrunde liegenden 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 zugrunde liegenden 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.

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.

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 13,01 Prozent.

Wichtige Kennzahlen
Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

	1 Jahr	3 Jahre p.a.	seit Auflegung p.a.
Performance *	19,9%	-	19,9%
Gesamtkostenquote	0,25%		
ISIN	DE000ETFL565		

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

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 Securities Services S. C. A. – Zweigniederlassung Frankfurt am Main, 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

Offenlegung gemäß Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung)

Der Fonds bildete im Berichtszeitraum den MSCI Europe Climate Change ESG Select Index durch direkte Investitionen (physische Replikation) in die im Index enthaltenen Wertpapiere nach. Hierbei hat der Anteil der im Fonds befindlichen Vermögensgegenstände stets eine Übereinstimmung mit dem Anteil der Wertpapiere im Index (Duplizierungsgrad) von mindestens 95 % aufgewiesen. Der Index berücksichtigt ESG-Kriterien, E (Environmental/Umwelt) Kriterien mit dem Ziel, die gewichtete CO2-Intensität des Indexportfolios signifikant zu reduzieren. S (social/sozial) und G (Governance/Unternehmensführung) –Kriterien werden als Ausschlüsse berücksichtigt, z.B. keine Investition des Indexes in Wertpapiere von Unternehmen, die geächtete oder Atomwaffen produzieren oder die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen. Dieses nachhaltige Anlageziel wurde durch die Anwendung umfassender Ausschlüsse und einer Umgewichtung der Indextitel auf Basis des „Low Carbon Transition Scores" (nachfolgend „LCT-Score") im Berichtsjahr umgesetzt.

Im zugrundeliegenden Index kamen umfassende und verbindliche Ausschlüsse von Einzelemittenten zur Anwendung. Die im folgenden genannten Ausschlusskriterien kamen über den gesamten Berichtszeitraum zur Anwendung. Es wurden keine Wertpapiere von Unternehmen in den Index integriert, die geächtete Waffen oder Atomwaffen produzierten, Atomkraftwerke betrieben oder besaßen, unkonventionell Öl und Gas (Fracking) förderten, Tabak herstellten oder gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen haben. Es wurden keine Unternehmen in den Index selektiert, die Umsätze (aus Herstellung oder Vertrieb) im Geschäftsfeld Tabakwaren (mehr als 5%) erzielten. Zudem mussten alle im Index enthaltenen Unternehmen einen MSCI LCT-Score aufweisen. Der LCT-Score ist ein Indikator dafür, wie hoch die Risiken und Chancen eines Unternehmens in Bezug auf den Wandel zu einer CO2-emissionsärmeren Wirtschaft sind und wie gut diese Risiken im Unternehmen gemanagt werden.

Darüber hinaus wurden eine Reihe an Ausschlusskriterien im Laufe des Berichtszeitraums angepasst oder neu eingeführt. Bis 01.06.2021 wurden keine Wertpapiere von Unternehmen in den Index integriert, die Umsätze (mehr als 5%) aus Kohleförderung erzielten. Am 01.06.2021 wurde die Umsatz-Toleranzgrenze bei Unternehmen, die Kohle fördern, von 5% auf 1% reduziert. Außerdem wurde am 01.06.2021 ein zusätzlicher Ausschluss von Unternehmen, die sehr schwere ESG-Kontroversen aufweisen oder die schweren Umwelt-Kontroversen unterliegen, aufgenommen.

Bis 01.12.2021 wurden keine Unternehmen in den Index selektiert, die Umsätze (aus Herstellung und Vertrieb) im Geschäftsfeld Rüstungsgüter (mehr als 10%) erzielten. Zudem mussten bis zu diesem Zeitpunkt alle im Index enthaltenen Unternehmen ein MSCI Rating von mindestens B[1)] aufweisen. Am 01.12.2021 wurde die Umsatz-Toleranzgrenze bei Unternehmen, die Rüstungsgüter herstellten oder vertrieben, von 10% auf 5% reduziert und das zulässige Mindest-MSCI-ESG-Rating von B auf BB erhöht. Zusätzlich wurden seit dem 01.12.2021 keine Wertpapiere von Unternehmen in den Index integriert, die über die genannten Schwellenwerte hinaus Umsätze durch Kohleverstromung (mehr als 10%) oder aus Stromerzeugung durch Atomkraft (mehr als 5%) erzielten.

Die Überprüfung der Ausschlusskriterien durch den Indexanbieter findet zu jeder halbjährlichen Indexanpassung statt (jeweils im Mai und November).

Bei dem reduzierten Anlageuniversum wurde zusätzlich eine Umgewichtung zum Zeitpunkt der Indexanpassungen anhand des LCT-Scores vorgenommen. Im Berichtszeitraum wurden Unternehmen, die aktiv dazu beitragen, dass CO2-Emissionen reduziert werden, mit einem Faktor von bis zu 3 übergewichtet. Unternehmen, die besonders hohe Nachhaltigkeitsrisiken in Bezug auf den Übergang zu einer emissionsarmen Wirtschaft aufwiesen, wurden mit Faktoren kleiner 1 untergewichtet.

Durch die beschriebene Umgewichtung der im Index enthaltenen Unternehmen wurde sichergestellt, dass eine Reduktion der CO2-Intensität von mindestens 30% im Vergleich zum MSCI Europe Index erfolgt. Darüber hinaus wurde sichergestellt, dass die gewichtete CO2-Intensität des Indexportfolios jährlich um mindestens 7% im Vergleich zum Vorjahr sinkt. Damit trägt der zugrundeliegende Index im Berichtsjahr (seit Juni 2021) den Anforderungen an die EU Referenzwerte für den klimabedingten Wandel (EU Climate Transition Benchmarks, EU CTB) mit dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung.

Die Methodologie des zugrundeliegenden Index finden Sie im Internet auf folgender Webseite: https://www.msci.com/index-methodology.

Die Messung der Nachhaltigkeitswirkung des Fonds und der Vergleich mit dem zugrundeliegenden Index erfolgt durch den Nachhaltigkeitsindikator „CO2-Intensität". Die CO2-Intensität berechnet sich aus der Summe der CO2-Emissionen der investierten Unternehmen gemessen in tCO2 je 1 Mio. Euro Unternehmenswert. Zum Stichtag 31.01.2022 wies dieser Indikator folgende Werte aus:

Fonds: CO2-Intensität: 258 tCO2e / 1 Mio. €

Zugrundeliegender Index – MSCI Europe Climate Change ESG Select: CO2-Intensität: [258 tCO2e / 1 Mio. €]

Breiter Marktindex - MSCI Europe: CO2-Intensität: 596 tCO2e / 1 Mio. €

Die Nachhaltigkeitsindikatoren wurden auf Basis von aktuell zur Verfügung stehenden Unternehmensdaten von Research-

bzw. Ratingagenturen, wie z.B. MSCI, ermittelt. Die Indikatoren spiegeln die Datenlage am Stichtag wieder.

Weitere Informationen zur Anlagepolitik sowie zur Definition und Berechnung von Nachhaltigkeitsindikatoren finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen auf der produktspezifischen Internetseite (https://www.deka-etf.de/etfs/Deka-MSCI-Europe-Climate-Change-ESG-UCITS-ETF).

Offenlegung nach Artikel 5 der Verordnung (EU) 2020/852 (Taxonomieverordnung)

Der MSCI Europe Climate Change ESG Select Index enthielt im Berichtsjahr Wertpapiere von Emittenten, die anhand von ökologischen Merkmalen ausgewählt wurden und deren potenziell taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten zur Erfüllung des Umweltziels Klimaschutz entsprechend der Taxonomieverordnung beitragen.

Dies erfolgt dadurch, dass die Indexmethodologie darauf ausgerichtet ist, Unternehmen der LCT-Kategorie Solution systematisch höher zu gewichten. Das Gewicht dieser Unternehmen im Portfolio ist bis zu dreimal so hoch wie in einem konventionellen nach Streubesitz-basierter Marktkapitalisierung gewichteten Index.

Unternehmen werden der LCT-Kategorie Solution zugeordnet, wenn sie an der Bereitstellung von Produkten, die zur Verringerung der CO2-Emissionen beitragen, beteiligt sind und somit ein hohes Potenzial aufweisen, durch das Wachstum von kohlenstoffarmen Produkten und Dienstleistungen zu profitieren. Dies sind Produkte im Bereich erneuerbarer Energien oder Energieeffizienz- Technologien. Diese Unternehmen wurden von MSCI ESG Research anhand der Kennzahl „geschätzte vermiedene CO2- Intensität" bestimmt. Unternehmen werden dem Bereich erneuerbarer Energien zugeordnet, wenn sie Produkte oder Dienstleistungen bereitstellen oder an Infrastrukturprojekten beteiligt sind, die die Entwicklung oder Bereitstellung von erneuerbaren Energien und alternativen Kraftstoffen unterstützen. Darunter fallen die Erzeugung, Übertragung und Verteilung von Strom aus erneuerbaren Energiequellen wie Wind, Sonne, Erdwärme, Biomasse, kleine Wasserkraftwerke (bis zu 25 MW Leistung), Energie aus Abfall und Gezeiten. Alternative Kraftstoffe umfassen Technologien und Infrastruktur für die Produktion und Verteilung von saubereren Hybridkraftstoffen, Wasserstoff, Brennstoffzellen und alternativen Kraftstoffen wie beispielsweise Biogas. Auch Unternehmen, die Batterien und Energiespeichertechnologien zur Unterstützung alternativer Energien herstellen, zählen zu diesem Bereich.

Energieeffizienz-Technologien umfassen Produkte, Dienstleistungen, Infrastrukturen oder Technologien, welche die wachsende globale Energienachfrage decken und gleichzeitig die Auswirkungen auf die Umwelt minimieren. Dazu zählten Technologien und Systeme, die die Energieeffizienz von industriellen Abläufen (z. B. Turbinen, Motoren und Triebwerke), Geschäftsabläufen (z. B. Telepräsenzdienste) und IT-Systemen (z.B. Cloud-Computing-Infrastruktur oder Optimierung von Rechenzentren) verbessern. Infrastruktur, Technologie und Systeme, die die Effizienz des Energiemanagements, der Energieverteilung und der Nachfragesteuerung erhöhen (z. B. drahtlose Sensoren, fortschrittliche Zähler) werden ebenfalls berücksichtigt. Auch im Bereich Transport zählen relevante Technologien und Systeme zur Senkung des Kraftstoffverbrauchs von Verkehrsmitteln und Industrieanlagen (z. B. Hybrid-/Elektrofahrzeuge) sowie nachhaltige Verkehrsinfrastruktur, einschließlich des städtischen Nahverkehrs oder Effizienzsteigerungen bei öffentlichen Verkehrsmitteln, zu Energieeffizienz. Des Weiteren gehören Geräte und Systeme, die für die Planung und den Bau umweltverträglicher Gebäude konzipiert sind wie z.B. energieeffiziente Beleuchtung, Isolierung sowie Gebäudeautomatisierung und -steuerung in diesen Bereich.

Eine Beschreibung in welchem Umfang die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Investitionen solche in Wirtschaftsaktivitäten sind, die ökologisch nachhaltig im Sinne des Art. 3 der Taxonomieverordnung sind, kann aufgrund unzureichender Datenverfügbarkeit derzeit nicht erfolgen. Deshalb wird dem Index eine Taxonomiekonformität von 0 % unterstellt.

Die technischen Bewertungskriterien gemäß der Delegierten Verordnung zur Taxonomieverordnung (EU) 2021/2139 für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten sind teilweise noch nicht final entwickelt worden (dies gilt für die vier Umweltziele gemäß Art. 9 lit. c bis f Taxonomieverordnung). Zum gegenwärtigen Zeitpunkt liegen der Kapitalverwaltungsgesellschaft nicht genügend aussagekräftige, aktuelle und überprüfbare Daten vor, um die Investitionen anhand der technischen Bewertungskriterien zu bewerten.

Darüber hinaus sind die technischen Regulierungsstandards (RTS) zur Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung), in denen die Methodik für die Berechnung des Anteils ökologisch nachhaltiger Investitionen und die Vorlagen für diese Offenlegungen festgelegt sind, noch nicht in Kraft getreten. Zum gegenwärtigen Zeitpunkt kann die Kapitalverwaltungsgesellschaft keine standardisierten und vergleichbaren Angaben zum Anteil der ökologisch nachhaltigen Anlagen gemäß der Taxonomieverordnung machen.

Obwohl der zugrundeliegende Index Emittenten enthält, die ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten durchführen, die zu einem Umweltziel beitragen und somit für eine Bewertung nach den technischen Bewertungskriterien in Frage kommen, ist es der Kapitalverwaltungsgesellschaft derzeit nicht möglich die nachfolgend genannten Informationen gemäß Artikel 5 der Taxonomieverordnung offenzulegen:

a) Umfang und prozentualer Anteil der Investitionen des Fonds, die in wirtschaftliche Tätigkeiten fließen, die als ökologisch nachhaltig gelten und mit der Taxonomieverordnung in Einklang stehen;

b) prozentualer Anteil des Fonds an den ermöglichenden Tätigkeiten und Übergangsaktivitäten gemäß der Taxonomieverordnung.

Sobald ausreichend aussagekräftige, aktuelle und überprüfbare Daten über die Anlagen des Fonds verfügbar sind, wird die Kapitalverwaltungsgesellschaft den Verkaufsprospekt um die oben genannten Informationen ergänzen und diese in den folgenden Jahresberichten veröffentlichen.

Lizenzdisclaimer:

Quelle: ©2022 MSCI ESG Research LLC. angegeben mit Genehmigung, abgerufen am: 20.04.2022 auf Grundlage der Fondsbestände per 31.01.2022.

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.

Ereignisse nach dem Berichtsstichtag

Die Invasion russischer Truppen in die Ukraine Ende Februar gilt als Zäsur in der europäischen Nachkriegsgeschichte. Der Westen hat mit massiven Sanktionen gegenüber Russland reagiert: Es wurden weitreichende Exportbeschränkungen erlassen und der EU-Luftraum für russische Fluggesellschaften gesperrt. Der Zugang zahlreicher russischer Unternehmen zur internationalen Finanzierung wurde gestoppt und einige große russische Finanzinstitute haben keinen Zugang mehr zu Hartwährungs-Transaktionen sowie zu dem Zahlungsnachrichtensystem SWIFT. Zudem wird ein Teil der Währungsreserven des Landes eingefroren. Die Energieversorgung Europas und die Versorgung mit anderen wichtigen Rohstoffen unterliegen wachsenden Risiken. Noch wenig einschätzbar sind die langfristigen Konsequenzen der veränderten Sicherheitslage in Europa. Kriege zur Durchsetzung nationaler Ziele sind wieder vorstellbar geworden. Das hat Auswirkungen auf viele Politikbereiche. Aspekte wie höhere Rüstungsausgaben, eine neue Energiearchitektur für Europa sowie die Signalwirkungen in den asiatischen Raum werden zu langfristigen Verschiebungen führen.

Die globalen Aktien- und weitere Risikomärkte reagierten mit signifikanten Abschlägen und starken Schwankungen auf die Kriegssituation. Gleichzeitig waren Anlageformen, die als relativ sicher gelten, zunächst nachgefragt, wie etwa Staatsanleihen westlicher Industrienationen oder Gold als Krisenwährung. Bei einer Eskalation des Konflikts drohen weitere Turbulenzen. Mittelfristig werden die Rahmenbedingungen der globalen Wirtschaft und an den Finanzmärkten von erhöhter Unsicherheit geprägt sein. Damit einher geht eine steigende Volatilität an den Finanzplätzen. Insofern unterliegt auch die zukünftige Wertentwicklung dieses Sondervermögens erhöhten Schwankungsrisiken.

1) 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.

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	IT0003506190	Atlantia S.p.A. Azioni Nom. o.N.
Löschung	FR0000051732	Atos SE Actions au Porteur EO 1
Löschung	CH0531751755	Banque Cantonale Vaudoise Namens-Aktien SF 1
Löschung	DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien o.N.
Löschung	GB00B02L3W35	Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,05
Löschung	SE0012455673	Boliden AB Namn-Aktier o.N. (Post Split)
Löschung	FR0000039299	Bolloré S.A. Actions Port. EO 0,16
Löschung	DE0007100000	Daimler AG Namens-Aktien o.N.
Löschung	FR0000130650	Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,50
Löschung	DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE Inhaber-Aktien o.N.
Löschung	GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares LS-,109090909
Löschung	NO0010031479	DNB ASA Navne-Aksjer A NK 10
Löschung	SE0000103814	Electrolux, AB Namn-Aktier B o.N.
Löschung	GB00B71N6K86	Evraz PLC Registered Shares DL 0,05
Löschung	GB00B2QPKJ12	Fresnillo PLC Registered Shares DL -,50
Löschung	DE0005790430	FUCHS PETROLUB SE Inhaber-Vorzugsakt. o.St.o.N.
Löschung	BE0003818359	Galapagos N.V. Actions Nom. o.N.
Löschung	JE00B4T3BW64	Glencore PLC Registered Shares DL -,01
Löschung	DK0010287234	H. Lundbeck A/S Navne-Aktier DK 5
Löschung	SE0000103699	Hexagon AB Namn-Aktier B (fria)SK1,333
Löschung	DE0006070006	HOCHTIEF AG Inhaber-Aktien o.N.
Löschung	SE0000652216	ICA Gruppen AB Aktier SK 2,50
Löschung	FR0004035913	Iliad S.A. Actions au Porteur o.N.
Löschung	SE0000107419	Investor AB Namn-Aktier B (fria) SK 6,25
Löschung	GB00BYX91H57	JD Sports Fashion PLC Registered Shares LS -,0025
Löschung	SE0014684528	Kinnevik AB Namn-Aktier B SK 0,05
Löschung	NL0009432491	Koninklijke Vopak N.V. Aandelen aan toonder EO -,50
Löschung	GB0006043169	Morrison Supermarkets PLC, Wm. Registered Shares LS -,10
Löschung	DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG Namens-Aktien o.N.
Löschung	FR0000120685	Natixis S.A. Actions Port. EO 11,20
Löschung	SE0008321293	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.
Löschung	FR0000131906	Renault S.A. Actions Port. EO 3,81
Löschung	GB00BKKMKR23	RSA Insurance Group PLC Registered Shares LS 1
Löschung	FR0010411983	SCOR SE Act.au Porteur EO 7,8769723
Löschung	LU0088087324	SES S.A. Bearer FDRs (rep.Shs A) o.N.
Löschung	SE0007439112	Sinch AB Namn-Aktier o.N.
Löschung	NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen aan toonder EO -,01
Löschung	FR0010613471	Suez S.A. Actions Port. EO 4
Löschung	IT0003497176	Telecom Italia S.p.A. Azioni Port.Risp.Non Cnv. o.N.
Löschung	NL0015000IY2	Universal Music Group N.V. Aandelen op naam EO1
Löschung	DK0010268606	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier DK 1
Neuaufnahme	SE0005127818	AB Sagax Namn-Aktier B o.N.
Neuaufnahme	NO0010345853	Aker BP ASA Navne-Aksjer NK 1
Neuaufnahme	NL0000334118	ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04

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	CH0012530207	Bachem Holding AG Namens-Aktien B SF 0,05
Neuaufnahme	GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,054141
Neuaufnahme	SE0015811559	Boliden AB Namn-Aktier o.N.
Neuaufnahme	FR0014003TT8	Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10
Neuaufnahme	NO0010161896	DNB Bank ASA Navne-Aksjer NK 100
Neuaufnahme	ES0127797019	EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5
Neuaufnahme	SE0016589188	Electrolux, AB Namn-Aktier B
Neuaufnahme	NL0006294274	Euronext N.V. Aandelen an toonder WI EO 1,60
Neuaufnahme	DE000A3E5D64	FUCHS PETROLUB SE Namens-Vorzugsakt. o.St.o.N.
Neuaufnahme	SE0000202624	Getinge AB Namn-Aktier B (fria) SK 2
Neuaufnahme	SE0015961909	Hexagon AB Namn-Aktier B (fria) o.N.
Neuaufnahme	NL0010801007	IMCD N.V. Aandelen op naam EO -,16
Neuaufnahme	LU2290522684	InPost S.A. Actions au Nomin. EO -,01
Neuaufnahme	SE0015811955	Investor AB Namn-Aktier A (fria) o.N.
Neuaufnahme	SE0015811963	Investor AB Namn-Aktier B (fria) o.N.
Neuaufnahme	GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC Registered Shares LS -,0005
Neuaufnahme	NL0014332678	JDE Peets B.V. Registered Shares EO 1
Neuaufnahme	SE0015810247	Kinnevik AB Namn-Aktier B SK 0,025
Neuaufnahme	SE0015949201	Lifco AB Namn-Aktier B o.N.
Neuaufnahme	SE0015988019	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.
Neuaufnahme	CH0012032113	Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1
Neuaufnahme	SE0016101844	Sinch AB Namn-Aktier o.N.
Neuaufnahme	SE0007439112	Sinch AB Namn-Aktier o.N.
Neuaufnahme	NL0015000IY2	Universal Music Group N.V. Aandelen op naam EO1
Neuaufnahme	CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10
Neuaufnahme	DK0061539921	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier DK -,20
Neuaufnahme	SE0000115420	Volvo (publ), AB Namn-Aktier A (fria) o.N.

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	3,24
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	3,18
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	2,99
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	2,73
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	2,62
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	2,27
GB0009895292	AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	2,16
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20	2,01
CH0012221716	ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	1,56
GB00B10RZP78	Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	1,48
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	1,42
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	1,38
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC Registered Shares LS -,25	1,33
GB0002374006	Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	1,32
FR0000120321	Oréal S.A., L Actions Port. EO 0,2	1,24
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	1,18
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien o.N.	1,12
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	1,00
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier DK -,20	0,99
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	0,88
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	0,76
FR0014003TT8	Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10	0,73
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	0,70
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	0,69
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	0,68
DK0060094928	Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10	0,66
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10	0,64
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	0,64
GB0007188757	Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10	0,63
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port. EO 4	0,63
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	0,61
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien o.N.	0,60
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	0,60
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	0,60
FR0000120628	AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	0,58
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	0,58
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	0,57
CH0013841017	Lonza Group AG Namens-Aktien SF 1	0,55
GB00B2B0DG97	Relx PLC Registered Shares LS -,144397	0,55
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	0,55
CH0418792922	Sika AG Namens-Aktien SF 0,01	0,54
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	0,54
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	0,51
DK0060079531	DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier DK 1	0,49
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	0,48
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,46

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC Registered Shares LS -,10	0,46
IE0004927939	Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13	0,46
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC Registered Shares DL 0,2095238	0,45
CH0432492467	Alcon AG Namens-Aktien SF -,04	0,45
SE0011166610	Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125	0,45
DK0060336014	Novozymes A/S Navne-Aktier B DK 2	0,44
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Aktier B (fria) o.N.	0,44
GB0031348658	Barclays PLC Registered Shares LS 0,25	0,43
CH0010645932	Givaudan SA Namens-Aktien SF 10	0,42
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC Reg.Shares LS 0,1	0,42
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	0,42
GB00B1YW4409	3i Group PLC Registered Shares LS -,738636	0,42
GB0007099541	Prudential PLC Registered Shares LS -,05	0,41
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	0,40
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	0,40
SE0015988019	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.	0,40
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	0,39
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	0,39
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	0,39
FI0009000681	Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	0,38
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	0,38
GB0000536739	Ashtead Group PLC Registered Shares LS -,10	0,38
SE0015811963	Investor AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	0,37
FI4000297767	Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	0,36
SE0000115446	Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	0,36
GB00B19NLV48	Experian PLC Registered Shares DL -,10	0,36
GB00BD6K4575	Compass Group PLC Registered Shares LS -,1105	0,36
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	0,36
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	0,35
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50	0,35
FR0000125338	Capgemini SE Actions Port. EO 8	0,34
FR0010220475	Alstom S.A. Actions Port. EO 7	0,33
SE0000667891	Sandvik AB Namn-Aktier o.N.	0,33
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port. EO-,25	0,33
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.	0,33
FR0010307819	Legrand S.A. Actions au Port. EO 4	0,32
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,32
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	0,31
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22	0,31
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	0,31
SE0007100581	Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33	0,31
SE0015961909	Hexagon AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	0,31
FR0000121261	Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom. EO 2	0,30
GB00B0SWJX34	London Stock Exchange GroupPLC Reg. Shares LS 0,069186047	0,30
CH0024608827	Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	0,29
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50	0,29

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	0,29
FR0000130809	Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25	0,28
IE0001827041	CRH PLC Registered Shares EO -,32	0,28
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N.	0,27
CH0030170408	Geberit AG Nam.-Akt. (Dispost.) SF -,10	0,27
AT0000746409	Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N.	0,27
DE0005140008	Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.	0,27
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -,12	0,25
GB00B5ZN1N88	Segro PLC Registered Shares LS -,10	0,25
FI0009013403	KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N.	0,25
CH0012138530	Credit Suisse Group AG Namens-Aktien SF -,04	0,24
FI0009003305	Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N.	0,23
NL0000009165	Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	0,23
ES0178430E18	Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1	0,23
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC Registered Shares EO -,09	0,23
CH0012549785	Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05	0,23
SE0011166628	Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria)SK0,052125	0,23
ES0127797019	EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5	0,22
GB0030913577	BT Group PLC Registered Shares LS 0,05	0,22
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,22
GB0005603997	Legal & General Group PLC Registered Shares LS -,025	0,22
IE0004906560	Kerry Group PLC Registered Shares A EO -,125	0,22
GB0002162385	Aviva PLC Registered Shares LS -,25	0,22
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien o.N.	0,22
NL0013267909	Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder EO0,5	0,21
FR0000133308	Orange S.A. Actions Port. EO 4	0,21
FI0009005987	UPM Kymmene Corp. Registered Shares o.N.	0,21
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.	0,21
NO0010161896	DNB Bank ASA Navne-Aksjer NK 100	0,21
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A. Acciones Port. EO -,25	0,21
BE0003565737	KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.	0,21
DK0010272202	GENMAB AS Navne Aktier DK 1	0,21
DK0060448595	Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1	0,20
FR0000051807	Téléperformance SE Actions Port. EO 2,5	0,20
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) SK 10	0,20
CH0012280076	Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	0,20
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 5,10	0,19
ES0143416115	Siemens Gamesa Renew. En. S.A. Acciones Port. EO -,17	0,19
DE000KGX8881	KION GROUP AG Inhaber-Aktien o.N.	0,19
SE0009922164	Essity AB Namn-Aktier B	0,19
SE0012673267	Evolution Gaming Gr.AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	0,19
FR0010533075	Getlink SE Actions Port. EO -,40	0,18
GB0004082847	Standard Chartered PLC Registered Shares DL -,50	0,18
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1	0,18
NL0000334118	ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	0,18
GB00B7T77214	Natwest Group PLC	0,18

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0000124141	Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	0,18
GB0009223206	Smith & Nephew PLC Registered Shares DL -,20	0,18
FR0000045072	Crédit Agricole S.A. Actions Port. EO 3	0,18
NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam EO -,01	0,17
JE00B8KF9B49	WPP PLC Registered Shares LS -,10	0,17
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B SK 0,125	0,17
GB00BDR05C01	National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289	0,17
DE000SYM9999	Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	0,17
SE0000242455	Swedbank AB Namn-Aktier A o.N.	0,17
DE0007165631	Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	0,17
GB0007908733	SSE PLC Shs LS-,50	0,17
GB00BJFFLV09	Croda International PLC Regist.Shares LS -,10609756	0,17
CH0025751329	Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -,25	0,17
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	0,16
GB0032089863	NEXT PLC Registered Shares LS 0,10	0,16
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000	0,16
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E. Actions Port. EO 0,01	0,16
ES0118900010	Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -,20	0,16
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	0,16
DE000A1DAHH0	Brenntag SE Namens-Aktien o.N.	0,16
CH0002497458	SGS S.A. Namens-Aktien SF 1	0,16
CH0012032113	Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1	0,16
BE0003822393	Elia Group Actions au Port. o.N.	0,15
GB00B0744B38	Bunzl PLC Registered Shares LS -,3214857	0,15
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC Registered Shares LS 0,01	0,15
AT0000652011	Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien o.N.	0,15
BE0003739530	UCB S.A. Actions Nom. o.N.	0,15
IT0004965148	Moncler S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,15
GB00BWFGQN14	Spirax-Sarco Engineering PLC Reg. Shares LS -,26923076	0,15
GB0004052071	Halma PLC Registered Shares LS -,10	0,15
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE Namens-Aktien o.N.	0,15
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A (fria) SK 1,433	0,15
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	0,14
FR0000120172	Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5	0,14
ES0105046009	Aena SME S.A. Acciones Port. EO 10	0,14
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	0,14
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	0,14
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port. EO -,20	0,14
CH0008742519	Swisscom AG Namens-Aktien SF 1	0,14
CH0010570759	Chocoladef. Lindt & Sprüngli vink.Namens-Aktien SF 100	0,14
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02	0,14
ES0140609019	Caixabank S.A. Acciones Port. EO 1	0,14
CH0010570767	Chocoladef. Lindt & Sprüngli Inhaber-Part.sch. SF 10	0,13
NL0012169213	Qiagen N.V. Aandelen op naam EO -,01	0,13
DK0010181759	Carlsberg AS Navne-Aktier B DK 20	0,13
DE000A161408	HelloFresh SE Inhaber-Aktien o.N.	0,13

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FI0009005961	Stora Enso Oyj Reg. Shares Cl.R EO 1,70	0,13
GB00BDCPN049	Coca-Cola European Partn. PLC Registered Shares EO -,01	0,13
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.	0,13
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N.	0,13
CH0012214059	Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	0,13
DK0010274414	Danske Bank AS Navne-Aktier DK 10	0,13
DK0060252690	Pandora A/S Navne-Aktier DK 1	0,12
CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	0,12
SE0015811559	Boliden AB Namn-Aktier o.N.	0,12
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB Namn-Aktier B (fria) SK 10	0,12
NO0003054108	Mowi ASA Navne-Aksjer NK 7,50	0,12
GB0006825383	Persimmon PLC Registered Shares LS -,10	0,12
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC Registered Shares LS -,9789	0,12
DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien o.N.	0,12
GB0031743007	Burberry Group PLC Registered Shares LS-,0005	0,12
NL0010801007	IMCD N.V. Aandelen op naam EO -,16	0,12
GB00B3MBS747	Ocado Group PLC Registered Shares LS -,02	0,12
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N.	0,12
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.	0,12
CH0024638196	Schindler Holding AG Inhaber-Part.sch. SF -,10	0,11
LU1598757687	ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN	0,11
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	0,11
IM00B5VQMV65	GVC Holdings PLC Registered Shares EO -,01	0,11
BE0003797140	Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Actions au Porteur o.N.	0,11
NL0010832176	argenx SE Aandelen aan toonder EO -,10	0,11
NL0011585146	Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	0,11
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC Registered Shares LS -,05	0,11
SE0012853455	EQT AB Namn-Aktier o.N.	0,11
DE000LEG1110	LEG Immobilien AG Namens-Aktien o.N.	0,11
GB0031638363	Intertek Group PLC Registered Shares LS -,01	0,11
SE0015811955	Investor AB Namn-Aktier A (fria) o.N.	0,11
FR0011981968	Worldline S.A. Actions Port. EO -,68	0,11
SE0000202624	Getinge AB Namn-Aktier B (fria) SK 2	0,11
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001	0,11
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group Reg.Shares LS -,208521303	0,11
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.V. Registered Shares EO -,04	0,11
NO0010063308	Telenor ASA Navne-Aksjer NK 6	0,11
GB00BMJ6DW54	Informa PLC Registered Shares LS -,001	0,11
GB0007669376	St. Jamess Place PLC Registered Shares LS -,15	0,10
CH0364749348	Vifor Pharma AG Nam.-Akt. SF 0,01	0,10
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port. EO 4	0,10
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder EO -,04	0,10
FI0009000202	Kesko Oyj Registered Shares Cl. B o.N.	0,10
GB0006731235	Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568	0,10
SE0000113250	Skanska AB Namn-Aktier B (fria) SK 3	0,10
DK0060227585	Christian Hansen Holding AS Navne-Aktier DK 10	0,10

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
SE0000108227	SKF AB Namn-Aktier B SK 0,625	0,10
FR0000120503	Bouygues S.A. Actions Port. EO 1	0,10
GB0000811801	Barratt Developments PLC Registered Shares LS -,10	0,10
FR0010908533	Edenred S.A. Actions Port. EO 2	0,10
CH0012255151	Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25	0,10
IT0000072170	Finecobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33	0,10
SE0000667925	Telia Company AB Namn-Aktier SK 3,20	0,10
GB00B1CRLC47	Mondi PLC Registered Shares EO -,20	0,10
NL0000303709	AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)EO-,12	0,10
IT0004176001	Prysmian S.p.A. Azioni nom. EO 0,10	0,10
DK0010219153	Rockwool International A/S Navne-Aktier B DK 10	0,09
FR0000127771	Vivendi SE Actions Port. EO 5,5	0,09
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The Registered Shares LS-,01051948	0,09
DE0006048408	Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien o.N.	0,09
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	0,09
GB00BYW0PQ60	Land Securities Group PLC Registered Shares LS 0,106666	0,09
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg. Shares LS -,157142857	0,09
CH0009002962	Barry Callebaut AG Namensaktien SF 0,02	0,09
CH0008038389	Swiss Prime Site AG Nam.-Aktien SF 15,3	0,09
DK0010272632	GN Store Nord AS Navne-Aktier DK 1	0,09
BE0974320526	Umicore S.A. Actions Nom. o.N.	0,09
NL0012059018	EXOR N.V. Aandelen aan toonder o.N.	0,08
DE0006602006	GEA Group AG Inhaber-Aktien o.N.	0,08
NL0000008977	Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	0,08
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC Registered Shares LS -,01	0,08
SE0000455057	Fastighets AB Balder Namn-Aktier B SK 1	0,08
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -,28571428	0,08
DK0010244425	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier A DK 1000	0,08
DE000CBK1001	Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	0,08
DK0060636678	Tryg AS Navne-Aktier DK 5	0,08
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC Registered Shares LS 0,01	0,08
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A. Acções Nominativas EO 1	0,08
NO0005052605	Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer NK 1,098	0,08
NO0003733800	Orkla ASA Navne-Aksjer NK 1,25	0,08
BE0974264930	AGEAS SA/NV Actions Nominatives o.N.	0,08
FI0009007884	Elisa Oyj Registered Shares Class A o.N.	0,08
GB0001367019	British Land Co. PLC, The Registered Shares LS -,25	0,08
GB00B02J6398	Admiral Group PLC Registered Shares LS -,001	0,08
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. EO -,50	0,08
GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC Registered Shares LS -,0005	0,08
NL0006294274	Euronext N.V. Aandelen an toonder WI EO 1,60	0,08
FR0006174348	Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12	0,08
CH0012410517	Bâloise Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	0,08
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.	0,08
FR0010040865	Gecina S.A. Actions Nom. EO 7,50	0,07
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,054141	0,07

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
NL0015435975	Davide Campari-Milano N.V. Aandelen op naam EO -,05	0,07
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC Registered Shares LS -,375	0,07
NL0000379121	Randstad N.V. Aandelen aan toonder EO 0,10	0,07
FR0013176526	Valéo S.A. Actions Port. EO 1	0,07
LU1673108939	Aroundtown SA Bearer Shares EO -,01	0,07
FR0000121220	Sodexo S.A. Actions Port. EO 4	0,07
CH0012453913	Temenos AG Nam.-Aktien SF 5	0,07
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien SF 6,70	0,07
FI0009003727	Wärtsilä Corp. Reg. Shares o.N.	0,07
FR0010313833	Arkema S.A. Actions au Porteur EO 10	0,07
GB00B1KJJ408	Whitbread PLC Reg. Shares LS -,76797385	0,07
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA Azioni nom. EO -,125	0,07
CH0012138605	Adecco Group AG Namens-Aktien SF 0,1	0,07
SE0015810247	Kinnevik AB Namn-Aktier B SK 0,025	0,07
BE0003470755	Solvay S.A. Actions au Porteur A o.N.	0,07
SE0005190238	Tele2 AB Namn-Aktier B SK -,625	0,07
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom. EO 0,50	0,07
GB00BF8Q6K64	Standard Life Aberdeen PLC Reg. Shares LS -,139682539	0,07
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A. Azioni nom. EO -,51	0,07
IT0004056880	Amplifon S.p.A. Azioni nom. EO -,02	0,06
SE0001662230	Husqvarna AB Namn-Aktier B SK 100	0,06
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V. Aand.op naam Dep.Rec./EO 1	0,06
FR0000121964	Klépierre S.A. Actions Port. EO 1,40	0,06
GB00B1VZ0M25	Hargreaves Lansdown PLC Registered Shares DL-,004	0,06
NO0010208051	Yara International ASA Navne-Aksjer NK 1,70	0,06
GB0006776081	Pearson PLC Registered Shares LS -,25	0,06
GB0000456144	Antofagasta PLC Registered Shares LS -,05	0,06
FR0000121147	Faurecia S.A. Actions Port. EO 7	0,06
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC Registered Shares LS -,10	0,06
BE0003717312	Sofina S.A. Actions Nom. o.N.	0,06
FR0013280286	bioMerieux Actions au Porteur (P.S.) o.N.	0,06
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC Registered Shares LS 1,101698	0,06
CH0024638212	Schindler Holding AG Namens-Aktien SF -,10	0,06
DE0006047004	HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien o.N.	0,06
FI0009013296	Neste Oyj Registered Shs o.N.	0,06
DK0060738599	Demant AS Navne Aktier A DK 0,2	0,06
GB00BGXQNP29	Phoenix Group Holdings PLC Registered Shares LS -,10	0,06
SE0005127818	AB Sagax Namn-Aktier B o.N.	0,05
FR0000130395	Rémy Cointreau S.A. Actions au Porteur EO 1,60	0,05
DE000EVNK013	Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N.	0,05
CH0016440353	Ems-Chemie Holding AG Namens-Aktien SF -,01	0,05
GB0002405495	Schroders PLC Registered Shares LS 1	0,05
SE0016589188	Electrolux, AB Namn-Aktier B	0,05
FR0000064578	Covivio S.A. Actions Port. EO 3	0,05
FI0009014377	Orion Corp. Registered Shares Cl.B o.N.	0,05
SE0000115420	Volvo (publ), AB Namn-Aktier A (fria) o.N.	0,05

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
CH0012142631	Clariant AG Namens-Aktien SF 3,70	0,05
SE0015949201	Lifco AB Namn-Aktier B o.N.	0,05
DE0006452907	Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N.	0,05
DE0007010803	RATIONAL AG Inhaber-Aktien o.N.	0,05
SE0016101844	Sinch AB Namn-Aktier o.N.	0,05
DE000A12DM80	Scout24 AG Namens-Aktien o.N.	0,05
ES0171996087	Grifols S.A. Acciones Port. Class A EO -,25	0,05
FR0000121709	SEB S.A. Actions Port. EO 1	0,05
FR0000054470	Ubisoft Entertainment S.A. Actions Port. EO 0,0775	0,05
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3	0,05
SE0000107203	Industrivärden AB Namn-Aktier C o.N.	0,05
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer NK 2	0,05
IT0003492391	Diasorin S.p.A. Azioni nom. EO 1	0,05
DE0005158703	Bechtle AG Inhaber-Aktien o.N.	0,04
FR0004125920	Amundi S.A. Actions au Porteur EO 2,5	0,04
GB00BBG9VN75	AVEVA Group PLC Registered Shares LS -,03555	0,04
FR0010259150	Ipsen S.A. Actions au Porteur EO 1	0,04
SE0000695876	Alfa Laval AB Namn-Aktier SK 2,5	0,04
CH0012530207	Bachem Holding AG Namens-Aktien B SF 0,05	0,04
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,04
DK0060946788	Ambu A/S Navne-Aktier B DK -,50	0,04
DE0005470405	LANXESS AG Inhaber-Aktien o.N.	0,04
FR0000120222	CNP Assurances S.A. Actions Port. EO 1	0,04
SE0010100958	Latour Investment AB Namn-Aktier B SK -,208325	0,04
SE0000190126	Industrivärden AB Namn-Aktier A (fria) o.N.	0,04
AT0000606306	Raiffeisen Bank Intl AG Inhaber-Aktien o.N.	0,04
FR0000120404	ACCOR S.A. Actions Port. EO 3	0,04
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	0,04
SE0000108847	L E Lundbergföretagen AB Namn-Aktier B (fria) SK 10	0,04
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N.	0,04
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX Actions Port. (Prom.) EO -,40	0,04
DE0005089031	United Internet AG Namens-Aktien o.N.	0,04
SE0000163594	Securitas AB Namn-Aktier B SK 1	0,03
CH0012255144	Swatch Group AG, The Namens-Aktien SF 0,45	0,03
DE000A3E5D64	FUCHS PETROLUB SE Namens-Vorzugsakt. o.St.o.N.	0,03
IT0005090300	Infrastrutt. Wireless Italiane Azioni nom. o.N.	0,03
BE0003810273	Proximus S.A. Actions au Porteur o.N.	0,03
FR0000121121	Eurazeo SE Actions au Porteur o.N.	0,03
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien o.N.	0,03
AT0000937503	voestalpine AG Inhaber-Aktien o.N.	0,03
FR0000121204	Wendel SE Actions Port. EO 4	0,03
NL0014332678	JDE Peets B.V. Registered Shares EO 1	0,02
BE0974256852	Établissements Fr. Colruyt SA Actions au Porteur o.N.	0,02
NO0010736879	Schibsted ASA Navne-Aksjer B NK -,50	0,02
IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,02
FR0000184798	Orpea Actions Port. EO 1,25	0,02

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien o.St. EO 1	0,02
NO0003028904	Schibsted ASA Navne-Aksjer A NK -,50	0,02
LU2290522684	InPost S.A. Actions au Nomin. EO -,01	0,02
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	0,02
SE0000825820	Lundin Energy AB Namn-Aktier SK -,01	0,02
IE0002424939	DCC PLC Registered Shares EO -,25	0,01
PTGAL0AM0009	Galp Energia SGPS S.A. Acções Nominativas EO 1	0,01
LU0156801721	Tenaris S.A. Actions Nom. DL 1	0,01
ES0130960018	Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50	0,01
NO0010345853	Aker BP ASA Navne-Aksjer NK 1	0,01

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF
Vermögensübersicht zum 31. Januar 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens[1)]
I. Vermögensgegenstände		**229.629.506,15**	**100,02**
1. Aktien		229.371.593,94	99,91
- Audiovisuelle Industrie	1.276.341,27		0,56
- Banken	23.341.965,24		10,17
- Bau und Baustoffe	10.813.343,83		4,71
- Bergbau	2.361.206,21		1,03
- Büroausstattung	1.720.479,17		0,75
- Chemische Industrie	7.545.581,25		3,29
- Einzelhandel	9.678.658,24		4,22
- Elektrik / Elektronik	22.102.822,08		9,63
- Energieversorger	9.254.362,85		4,03
- Freizeit/Tourismus	493.283,66		0,21
- Holdinggesellschaften	2.181.915,43		0,95
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	9.113.521,06		3,97
- Papier und andere Basisprodukte	1.525.257,88		0,66
- Pharmaindustrie / Biotech	47.855.199,50		20,84
- Real Estate	3.679.878,76		1,60
- Software	5.192.162,79		2,26
- Sonstige Dienstleistungen	6.482.732,47		2,82
- Sonstige Finanzdienstleistungen	2.655.806,64		1,16
- Sonstige industrielle Werte	4.630.640,84		2,02
- Telekommunikation	8.283.980,44		3,61
- Textilien und Kleidung	10.612.578,80		4,62
- Transportation	4.388.463,80		1,91
- Unterhaltungsindustrie	2.009.637,64		0,88
- Verbrauchsgüter	20.012.885,56		8,72
- Versicherungen	12.158.888,53		5,30
2. Forderungen		101.265,67	0,04
3. Bankguthaben		156.646,64	0,07
II. Verbindlichkeiten		**-40.637,13**	**-0,02**
III. Fondsvermögen		**229.588.869,12**	**100,00**

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

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF
Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs		Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					Im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	5.651	5.390	2.007	EUR	242,250	1.368.954,75	0,60
DE0008404005	Allianz SE		STK	10.136	9.871	5.084	EUR	227,350	2.304.419,60	1,00
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	3.531	3.365	1.249	EUR	92,950	328.206,45	0,14
DE0005190037	Bayerische Motoren Werke AG		STK	615	582	210	EUR	76,100	46.801,50	0,02
DE0005158703	Bechtle AG		STK	1.952	2.323	709	EUR	52,720	102.909,44	0,04
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	2.998	2.854	1.059	EUR	88,080	264.063,84	0,12
DE000A1DAHH0	Brenntag SE		STK	4.826	4.604	1.726	EUR	75,660	365.135,16	0,16
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	1.230	1.171	434	EUR	141,550	174.106,50	0,08
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	24.572	23.866	12.120	EUR	7,587	186.427,76	0,08
DE0005439004	Continental AG		STK	3.206	3.039	1.105	EUR	84,940	272.317,64	0,12
DE0006062144	Covestro AG		STK	3.960	3.856	1.404	EUR	52,860	209.325,60	0,09
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE		STK	5.011	5.101	1.689	EUR	67,920	340.347,12	0,15
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	49.976	47.958	22.928	EUR	12,254	612.405,90	0,27
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	4.590	4.456	2.258	EUR	157,200	721.548,00	0,31
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	12.180	12.641	2.899	EUR	6,807	82.909,26	0,04
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	30.051	28.614	10.537	EUR	52,990	1.592.402,49	0,69
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	78.789	76.448	38.715	EUR	16,672	1.313.570,21	0,57
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	4.310	4.092	1.502	EUR	28,790	124.084,90	0,05
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	4.886	4.789	2.546	EUR	60,060	293.453,16	0,13
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA		STK	9.989	9.677	4.879	EUR	36,560	365.197,84	0,16
DE000A3E5D64	Fuchs Petrolub SE		STK	1.976	2.529	553	EUR	38,320	75.720,32	0,03
DE0006602006	GEA Group AG		STK	4.602	4.376	1.631	EUR	41,750	192.133,50	0,08
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	1.482	1.438	729	EUR	178,000	263.796,00	0,11
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	2.121	2.003	717	EUR	61,260	129.932,46	0,06
DE000A161408	HelloFresh SE		STK	5.142	5.107	1.797	EUR	58,540	301.012,68	0,13
DE0006048408	Henkel AG & Co. KGaA		STK	3.028	2.879	1.063	EUR	69,950	211.808,60	0,09
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	5.192	4.938	1.823	EUR	72,460	376.212,32	0,16
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	37.580	35.639	12.931	EUR	36,335	1.365.469,30	0,59
DE000KGX8881	KION GROUP AG		STK	5.357	5.389	2.049	EUR	81,280	435.416,96	0,19
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	5.552	5.243	1.870	EUR	89,660	497.792,32	0,22
DE0005470405	LANXESS AG		STK	1.714	1.616	581	EUR	53,720	92.076,08	0,04
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	2.101	2.007	782	EUR	117,500	246.867,50	0,11
DE0006599905	Merck KGaA		STK	3.855	3.691	1.408	EUR	193,900	747.484,50	0,33
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	3.444	3.344	1.696	EUR	279,050	961.048,20	0,42
DE0006452907	Nemetschek SE		STK	1.388	1.349	687	EUR	81,140	112.622,32	0,05
DE0006969603	PUMA SE		STK	3.119	2.984	1.027	EUR	94,200	293.809,80	0,13
DE0007010803	RATIONAL AG		STK	151	142	51	EUR	739,800	111.709,80	0,05
DE0007164600	SAP SE		STK	24.550	24.026	12.642	EUR	110,400	2.710.320,00	1,18
DE0007165631	Sartorius AG		STK	809	790	417	EUR	476,100	385.164,90	0,17
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	2.097	2.173	1.418	EUR	52,580	110.260,26	0,05
DE0007236101	Siemens AG		STK	18.293	19.777	4.753	EUR	139,880	2.558.824,84	1,11
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	31.835	41.449	11.271	EUR	19,760	629.059,60	0,27
DE000SYM9999	Symrise AG		STK	3.675	3.494	1.284	EUR	105,950	389.366,25	0,17
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	24.759	23.977	12.062	EUR	2,540	62.887,86	0,03
DE0005089031	United Internet AG		STK	2.337	2.328	1.326	EUR	34,630	80.930,31	0,04
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	21.676	21.907	6.745	EUR	50,380	1.092.036,88	0,48
DE000ZAL1111	Zalando SE		STK	6.938	7.514	2.487	EUR	69,980	485.521,24	0,21
							EUR		25.987.871,92	11,32
Ausland										
GB00B1YW4409	3i Group PLC		STK	58.537	56.283	27.698	GBP	13,700	959.795,22	0,42
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S		STK	116	114	47	DKK	23.670,000	369.028,55	0,16
DK0010244425	A.P.Møller-Mærsk A/S		STK	63	58	20	DKK	22.100,000	187.127,04	0,08
SE0005127818	AB Sagax		STK	4.900	5.554	654	SEK	269,000	125.971,23	0,05
CH0012221716	ABB Ltd.		STK	117.534	110.776	45.941	CHF	31,710	3.570.952,52	1,56
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V.		STK	10.394	10.090	5.111	EUR	14,228	147.885,83	0,06
FR0000120404	ACCOR S.A.		STK	2.770	3.232	2.531	EUR	32,360	89.637,20	0,04
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA		STK	8.004	7.694	3.174	EUR	22,290	178.409,16	0,08
CH0012138605	Adecco Group AG		STK	3.804	3.694	1.874	CHF	43,820	159.711,87	0,07
GB00B02J6398	Admiral Group PLC		STK	4.746	4.592	2.297	GBP	31,440	178.582,06	0,08
NL0012969182	Adyen N.V.		STK	486	459	204	EUR	1.789,000	869.454,00	0,38
NL0000303709	AEGON N.V.		STK	43.917	42.652	21.643	EUR	4,995	219.365,42	0,10
ES0105046009	Aena SME S.A.		STK	2.297	2.263	784	EUR	143,150	328.815,55	0,14
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.		STK	898	858	322	EUR	119,650	107.445,70	0,05
BE0974264930	AGEAS SA/NV		STK	4.227	4.144	2.162	EUR	42,590	180.027,93	0,08
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.		STK	32.002	29.458	10.908	EUR	28,755	920.217,51	0,40
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl.		STK	9.029	8.500	3.133	EUR	151,380	1.366.810,02	0,60
NO0010345853	Aker BP ASA		STK	672	762	90	NOK	306,600	20.614,03	0,01
NL0013267909	Akzo Nobel N.V.		STK	5.381	5.137	1.976	EUR	91,560	492.684,36	0,21
CH0432492467	Alcon AG		STK	15.205	14.558	5.324	CHF	70,840	1.032.022,80	0,45
SE0000695876	Alfa Laval AB		STK	3.355	6.133	6.531	SEK	311,500	99.878,86	0,04
FR0010220475	Alstom S.A.		STK	26.786	26.700	8.470	EUR	28,650	767.418,90	0,33
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.		STK	10.850	10.528	5.332	EUR	60,540	656.859,00	0,29
DK0060946788	Ambu A/S		STK	5.067	4.868	1.773	DKK	139,250	94.830,89	0,04
IT0004056880	Amplifon S.p.A.		STK	3.945	3.758	1.393	EUR	37,530	148.055,85	0,06
FR0004125920	Amundi S.A.		STK	1.485	1.438	724	EUR	68,650	101.945,25	0,04

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs		Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.		STK	16.026	15.246	5.618	EUR	55,720	892.968,72	0,39
GB0000456144	Antofagasta PLC		STK	8.412	8.020	2.979	GBP	13,325	134.151,04	0,06
LU1598757687	ArcelorMittal S.A.		STK	9.958	9.911	4.351	EUR	26,195	260.849,81	0,11
NL0010832176	argenx SE		STK	1.090	1.051	515	EUR	234,300	255.387,00	0,11
FR0010313833	Arkema S.A.		STK	1.259	1.177	494	EUR	130,450	164.236,55	0,07
LU1673108939	Aroundtown SA		STK	30.549	29.840	11.520	EUR	5,456	166.675,34	0,07
GB0000536739	Ashtead Group PLC		STK	13.731	13.127	4.931	GBP	52,460	862.100,72	0,38
NL0000334118	ASM International N.V.		STK	1.366	1.858	492	EUR	302,000	412.532,00	0,18
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	12.260	11.696	4.490	EUR	594,200	7.284.892,00	3,17
SE0007100581	Assa-Abloy AB		STK	29.261	27.722	10.264	SEK	253,000	707.510,20	0,31
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.		STK	27.209	26.367	13.303	EUR	18,580	505.543,22	0,22
GB0006731235	Associated British Foods PLC		STK	10.045	9.526	3.469	GBP	19,410	233.347,44	0,10
GB0009895292	AstraZeneca PLC		STK	47.972	46.653	14.947	GBP	86,170	4.947.336,77	2,15
SE0011166628	Atlas Copco AB		STK	11.516	10.999	4.048	SEK	470,900	518.266,78	0,23
SE0011166610	Atlas Copco AB		STK	19.818	18.927	6.965	SEK	543,200	1.028.827,60	0,45
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC		STK	22.987	22.402	11.481	GBP	6,676	183.664,90	0,08
GB00BBG9VN75	AVEVA Group PLC		STK	2.916	3.084	981	GBP	29,180	101.835,77	0,04
GB0002162385	Aviva PLC		STK	96.160	93.560	47.760	GBP	4,342	499.702,85	0,22
FR0000120628	AXA S.A.		STK	47.584	46.179	23.394	EUR	27,955	1.330.210,72	0,58
CH0012530207	Bachem Holding AG		STK	189	214	25	CHF	547,000	99.054,33	0,04
CH0012410517	Bâloise Holding AG		STK	1.140	1.106	560	CHF	161,700	176.619,72	0,08
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.		STK	163.659	158.883	80.588	EUR	5,634	922.054,81	0,40
ES0113900J37	Banco Santander S.A.		STK	426.306	413.838	209.867	EUR	3,095	1.319.203,92	0,57
GB0031348658	Barclays PLC		STK	414.222	407.327	214.183	GBP	1,972	977.713,64	0,43
GB0000811801	Barratt Developments PLC		STK	30.745	29.288	10.850	GBP	6,116	225.045,08	0,10
CH0009002962	Barry Callebaut AG		STK	100	101	35	CHF	2.122,000	203.315,13	0,09
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC		STK	3.392	4.396	1.004	GBP	41,980	170.422,07	0,07
FR0013280286	bioMerieux		STK	1.267	1.207	448	EUR	104,050	131.831,35	0,06
FR0000131104	BNP Paribas S.A.		STK	27.614	26.793	13.557	EUR	63,000	1.739.682,00	0,76
SE0015811559	Boliden AB		STK	7.769	10.511	2.742	SEK	373,500	277.318,44	0,12
FR0000120503	Bouygues S.A.		STK	7.249	6.943	2.569	EUR	31,190	226.096,31	0,10
GB0001367019	British Land Co. PLC, The		STK	27.138	25.834	9.574	GBP	5,502	178.700,59	0,08
GB0030913577	BT Group PLC		STK	219.451	213.021	108.007	GBP	1,956	513.597,55	0,22
GB00B0744B38	Bunzl PLC		STK	10.548	10.057	3.724	GBP	27,670	349.306,64	0,15
GB0031743007	Burberry Group PLC		STK	12.136	11.564	4.288	GBP	18,675	271.246,25	0,12
FR0006174348	Bureau Veritas SA		STK	7.029	6.839	3.485	EUR	25,290	177.763,41	0,08
ES0140609019	Caixabank S.A.		STK	108.990	103.077	40.102	EUR	2,846	310.185,54	0,14
FR0000125338	Capgemini SE		STK	3.942	3.829	1.948	EUR	197,450	778.347,90	0,34
DK0010181759	Carlsberg AS		STK	2.142	2.049	772	DKK	1.068,000	307.464,11	0,13
FR0000120172	Carrefour S.A.		STK	19.460	18.459	6.576	EUR	16,920	329.263,20	0,14
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A.		STK	11.821	14.193	6.122	EUR	40,300	476.386,30	0,21
CH0010570759	Chocoladef. Lindt & Sprüngli		STK	3	3	1	CHF	106.700,000	306.697,33	0,13
CH0010570767	Chocoladef. Lindt & Sprüngli		STK	30	27	9	CHF	10.720,000	308.134,52	0,13
DK0060227585	Christian Hansen Holding AS		STK	3.195	3.031	1.117	DKK	529,400	227.330,92	0,10
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG		STK	15.771	15.029	5.577	CHF	132,950	2.008.962,78	0,88
FR0000121261	Cie Génle Éts Michelin SCpA		STK	4.681	4.497	1.719	EUR	147,700	691.383,70	0,30
CH0012142631	Clariant AG		STK	6.113	6.624	2.207	CHF	19,490	114.153,85	0,05
NL0010545661	CNH Industrial N.V.		STK	30.003	28.356	10.364	EUR	13,335	400.090,01	0,17
FR0000120222	CNP Assurances S.A.		STK	4.220	4.097	2.078	EUR	21,800	91.996,00	0,04
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC		STK	5.813	5.526	2.033	USD	57,150	296.354,10	0,13
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG		STK	5.643	5.394	1.981	GBP	24,410	164.856,24	0,07
DK0060448595	Coloplast AS		STK	3.640	3.472	1.293	DKK	958,400	468.869,42	0,20
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.		STK	14.855	14.024	5.272	EUR	59,650	886.100,75	0,39
GB00BD6K4575	Compass Group PLC		STK	41.004	39.790	20.172	GBP	16,690	819.049,44	0,36
FR0000064578	Covivio S.A.		STK	1.609	1.538	576	EUR	73,900	118.905,10	0,05
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.		STK	30.394	30.745	15.146	EUR	13,280	403.632,32	0,18
CH0012138530	Credit Suisse Group AG		STK	64.873	62.738	29.107	CHF	8,760	544.493,13	0,24
IE0001827041	CRH PLC		STK	14.492	13.788	5.130	EUR	44,410	643.589,72	0,28
GB00BJFFLV09	Croda International PLC		STK	4.032	3.966	1.427	GBP	79,720	384.693,96	0,17
FR0000120644	Danone S.A.		STK	13.564	13.192	4.761	EUR	55,250	749.411,00	0,33
DK0010274414	Danske Bank AS		STK	16.908	16.417	8.326	DKK	127,900	290.647,44	0,13
FR0014003TT8	Dassault Systemes SE		STK	39.342	52.713	13.371	EUR	42,450	1.670.067,90	0,73
NL0015435975	Davide Campari-Milano N.V.		STK	15.287	14.197	5.749	EUR	11,090	169.532,83	0,07
IE0002424939	DCC PLC		STK	450	436	218	GBP	62,060	33.423,49	0,01
DK0060738599	Demant AS		STK	3.255	3.084	1.134	DKK	291,000	127.305,66	0,06
GB0002374006	Diageo PLC		STK	68.087	64.921	24.178	GBP	37,230	3.033.784,94	1,32
IT0003492391	Diasorin S.p.A.		STK	777	738	272	EUR	136,900	106.371,30	0,05
NO0010161896	DNB Bank ASA		STK	22.813	31.170	8.357	NOK	210,700	480.915,18	0,21
DK0060079531	DSV Panalpina A/S		STK	6.280	6.869	2.315	DKK	1.337,500	1.128.904,36	0,49
FR0010908533	Edenred S.A.		STK	5.928	5.722	2.851	EUR	37,900	224.671,20	0,10
ES0127797019	EDP Renováveis S.A.		STK	27.660	31.354	3.694	EUR	18,620	515.029,20	0,22
FR0000130452	Eiffage S.A.		STK	2.549	2.399	904	EUR	92,760	236.445,24	0,10
SE0016589188	Electrolux, AB		STK	6.523	7.729	1.206	SEK	191,400	119.319,75	0,05
BE0003822393	Elia Group		STK	2.965	2.827	1.050	EUR	119,700	354.910,50	0,15
FI0009007884	Elisa Oyj		STK	3.440	3.322	1.659	EUR	52,080	179.155,20	0,08
CH0016440353	Ems-Chemie Holding AG		STK	138	130	57	CHF	929,500	122.900,26	0,05
ES0130960018	Enagas S.A.		STK	1.327	1.266	471	EUR	19,200	25.478,40	0,01
IM00B5VQMV65	Entain PLC		STK	13.608	13.211	6.712	GBP	15,910	259.114,69	0,11
SE0012853455	EQT AB		STK	7.213	7.118	2.927	SEK	359,600	247.889,79	0,11

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
AT0000652011	Erste Group Bank AG		STK	8.442	8.322	3.457	EUR	41,230	348.063,66	0,15
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.		STK	8.734	8.384	3.137	EUR	166,820	1.457.005,88	0,63
SE0009922164	Essity AB		STK	17.068	16.293	5.979	SEK	261,900	427.209,75	0,19
BE0974256852	Établissements Fr. Colruyt SA		STK	1.569	1.861	529	EUR	36,080	56.609,52	0,02
FR0000121121	Eurazeo SE		STK	912	882	443	EUR	70,150	63.976,80	0,03
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E.		STK	4.143	3.947	1.442	EUR	88,770	367.774,11	0,16
NL0006294274	Euronext N.V.		STK	2.087	2.365	278	EUR	85,300	178.021,10	0,08
SE0012673267	Evolution AB (publ)		STK	3.921	3.800	1.383	SEK	1.135,400	425.469,81	0,19
NL0012059018	EXOR N.V.		STK	2.628	2.515	1.208	EUR	73,820	193.998,96	0,08
GB00B19NLV48	Experian PLC		STK	22.291	21.575	10.839	GBP	30,810	821.956,45	0,36
SE0000455057	Fastighets AB Balder		STK	3.216	3.136	1.130	SEK	613,000	188.408,09	0,08
FR0000121147	Faurecia SE		STK	3.424	3.685	1.214	EUR	38,630	132.269,12	0,06
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC		STK	7.008	6.732	2.555	GBP	116,000	972.925,62	0,42
NL0011585146	Ferrari N.V.		STK	1.251	1.174	423	EUR	202,900	253.827,90	0,11
ES0118900010	Ferrovial S.A.		STK	14.888	14.071	5.093	EUR	24,570	365.798,16	0,16
IT0000072170	Finecobank Banca Fineco S.p.A.		STK	14.937	14.483	7.314	EUR	14,805	221.142,29	0,10
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC		STK	3.880	3.692	1.698	EUR	134,300	521.084,00	0,23
PTGAL0AM0009	Galp Energia SGPS S.A.		STK	2.886	2.657	984	EUR	9,778	28.219,31	0,01
CH0030170408	Geberit AG		STK	1.044	1.012	401	CHF	625,200	625.379,71	0,27
FR0010040865	Gecina S.A.		STK	1.431	1.360	501	EUR	120,100	171.863,10	0,07
DK0010272202	GENMAB AS		STK	1.573	1.528	773	DKK	2.231,000	471.663,22	0,21
SE0000202624	Getinge AB		STK	7.038	7.978	940	SEK	361,600	243.220,80	0,11
FR0010533075	Getlink SE		STK	30.160	28.366	10.290	EUR	13,950	420.732,00	0,18
CH0010645932	Givaudan SA		STK	266	250	91	CHF	3.818,000	973.065,06	0,42
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA		STK	4.917	4.775	2.422	NOK	216,600	106.556,56	0,05
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC		STK	155.112	148.022	54.908	GBP	16,430	3.050.074,99	1,33
DK0010272632	GN Store Nord AS		STK	3.720	3.600	1.415	DKK	397,600	198.789,31	0,09
ES0171996087	Grifols S.A.		STK	7.056	6.855	3.485	EUR	15,610	110.144,16	0,05
BE0003797140	Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL)		STK	2.695	2.615	1.322	EUR	94,900	255.755,50	0,11
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB		STK	22.542	20.884	8.285	SEK	183,340	394.977,81	0,17
GB0004052071	Halma PLC		STK	11.444	10.771	4.055	GBP	24,960	341.861,34	0,15
GB00B1VZ0M25	Hargreaves Lansdown PLC		STK	8.661	8.251	3.802	GBP	13,410	139.003,06	0,06
NL0000008977	Heineken Holding N.V.		STK	2.458	2.343	870	EUR	77,750	191.109,50	0,08
NL0000009165	Heineken N.V.		STK	5.514	5.263	1.965	EUR	95,020	523.940,28	0,23
FR0000052292	Hermes International S.C.A.		STK	933	891	332	EUR	1.318,500	1.230.160,50	0,54
SE0015961909	Hexagon AB		STK	59.262	79.854	20.592	SEK	124,200	703.430,06	0,31
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC		STK	5.311	5.053	1.861	GBP	20,780	132.083,75	0,06
CH0012214059	Holcim Ltd.		STK	6.148	5.840	2.194	CHF	49,750	293.056,43	0,13
GB0005405286	HSBC Holdings PLC		STK	500.506	484.626	244.075	GBP	5,276	3.160.396,94	1,38
SE0001662230	Husqvarna AB		STK	12.024	11.504	4.329	SEK	128,750	147.951,45	0,06
NL0010801007	IMCD N.V.		STK	1.778	2.016	238	EUR	152,200	270.611,60	0,12
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA		STK	33.862	32.294	12.017	EUR	26,740	905.469,88	0,39
SE0000190126	Industrivärden AB		STK	3.263	3.250	1.353	SEK	291,600	90.934,28	0,04
SE0000107203	Industrivärden AB		STK	3.902	3.790	1.929	SEK	286,900	106.989,42	0,05
GB00BMJ6DW54	Informa PLC		STK	36.270	35.202	17.843	GBP	5,550	240.917,36	0,10
IT0005090300	Infrastrutt. Wireless Italiane		STK	7.817	7.591	3.862	EUR	9,544	74.605,45	0,03
NL0011821202	ING Groep N.V.		STK	95.977	93.128	47.163	EUR	13,062	1.253.651,57	0,55
LU2290522684	InPost S.A.		STK	6.013	6.815	802	EUR	7,184	43.197,39	0,02
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group		STK	4.168	3.985	1.877	GBP	48,610	242.482,77	0,11
GB0031638363	Intertek Group PLC		STK	3.858	3.745	1.900	GBP	53,440	246.749,47	0,11
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.		STK	406.030	394.293	200.291	EUR	2,620	1.063.595,59	0,46
SE0015811955	Investor AB		STK	12.222	13.855	1.633	SEK	210,200	245.526,30	0,11
SE0015811963	Investor AB		STK	44.650	65.217	20.567	SEK	200,350	854.936,45	0,37
FR0010259150	Ipsen S.A.		STK	1.172	1.116	413	EUR	86,300	101.143,60	0,04
GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC		STK	79.214	90.456	11.242	GBP	1,881	178.280,09	0,08
NL0014332678	JDE Peet's N.V.		STK	2.141	2.868	727	EUR	26,605	56.961,31	0,02
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.		STK	8.588	8.279	2.738	EUR	21,360	183.439,68	0,08
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC		STK	5.647	5.374	1.991	GBP	19,400	131.113,40	0,06
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG		STK	5.418	5.292	2.731	CHF	60,020	311.572,64	0,14
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.V.		STK	5.563	5.514	1.513	EUR	43,465	241.795,80	0,11
BE0003565737	KBC Groep N.V.		STK	6.137	5.954	3.011	EUR	76,940	472.180,78	0,21
FR0000121485	Kering S.A.		STK	2.193	2.085	781	EUR	656,300	1.439.265,90	0,63
IE0004906560	Kerry Group PLC		STK	4.479	4.198	1.530	EUR	112,000	501.648,00	0,22
FI0009000202	Kesko Oyj		STK	8.434	8.032	2.973	EUR	27,930	235.561,62	0,10
GB0033195214	Kingfisher PLC		STK	51.910	50.378	25.523	GBP	3,311	205.701,65	0,09
IE0004927939	Kingspan Group PLC		STK	12.481	11.832	4.373	EUR	85,120	1.062.382,72	0,46
SE0015810247	Kinnevik AB		STK	5.934	8.832	2.898	SEK	275,200	156.069,84	0,07
FR0000121964	Klépierre S.A.		STK	6.238	6.129	2.285	EUR	23,460	146.343,48	0,06
NL0000009082	Kon. KPN N.V.		STK	80.575	79.543	43.596	EUR	2,927	235.843,03	0,10
FI0009013403	KONE Oyj		STK	9.935	9.431	3.505	EUR	57,220	568.480,70	0,25
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.		STK	4.888	4.647	1.708	EUR	166,050	811.652,40	0,35
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.		STK	27.770	26.366	9.642	EUR	29,385	816.021,45	0,36
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG		STK	1.663	1.579	578	CHF	260,300	414.754,14	0,18
SE0000108847	L E Lundbergföretagen AB		STK	1.868	1.786	863	SEK	472,600	84.371,08	0,04
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX		STK	2.236	2.109	922	EUR	36,640	81.927,04	0,04
GB00BYW0PQ60	Land Securities Group PLC		STK	21.840	20.772	7.650	GBP	7,902	206.546,20	0,09
SE0010100958	Latour Investment AB		STK	3.351	3.274	1.692	SEK	286,900	91.881,48	0,04
GB0005603997	Legal & General Group PLC		STK	146.766	142.438	72.176	GBP	2,874	504.823,74	0,22
FR0010307819	Legrand S.A.		STK	8.224	7.906	3.023	EUR	89,800	738.515,20	0,32

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
SE0015949201	Lifco AB		STK	5.476	6.207	731	SEK	215,600	112.832,76	0,05
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC		STK	1.739.942	1.688.354	856.029	GBP	0,511	1.063.060,73	0,46
CH0025751329	Logitech International S.A.		STK	5.155	4.978	1.756	CHF	76,760	379.129,83	0,17
GB00B0SWJX34	London Stock Exchange GroupPLC		STK	7.956	7.614	3.646	GBP	72,200	687.479,15	0,30
CH0013841017	Lonza Group AG		STK	2.079	1.964	739	CHF	633,400	1.261.702,21	0,55
SE0000825820	Lundin Energy AB		STK	1.078	1.051	372	SEK	375,400	38.675,51	0,02
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE		STK	8.316	7.927	2.945	EUR	722,600	6.009.141,60	2,62
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA		STK	15.269	14.780	7.426	EUR	10,110	154.369,59	0,07
IT0004965148	Moncler S.p.A.		STK	6.127	5.860	2.018	EUR	56,340	345.195,18	0,15
GB00B1CRLC47	Mondi PLC		STK	9.978	9.481	3.478	GBP	18,390	219.610,34	0,10
NO0003054108	Mowi ASA		STK	12.683	12.100	4.525	NOK	217,400	275.869,11	0,12
GB00BDR05C01	National Grid PLC		STK	30.309	29.405	10.189	GBP	10,796	391.617,45	0,17
GB00B7T77214	NatWest Group PLC		STK	141.460	138.508	59.139	GBP	2,424	410.387,22	0,18
FI0009013296	Neste Oyj		STK	3.228	3.093	1.043	EUR	39,770	128.377,56	0,06
CH0038863350	Nestlé S.A.		STK	60.047	57.937	22.517	CHF	119,080	6.851.007,72	2,98
GB0032089863	NEXT PLC		STK	4.134	3.939	1.461	GBP	74,980	370.973,99	0,16
SE0015988019	NIBE Industrier AB		STK	109.735	147.129	37.394	SEK	87,560	918.277,50	0,40
NL0010773842	NN Group N.V.		STK	6.643	6.631	3.684	EUR	49,580	329.359,94	0,14
FI0009000681	Nokia Oyj		STK	167.092	155.559	59.316	EUR	5,247	876.731,72	0,38
FI4000297767	Nordea Bank Abp		STK	79.625	77.278	39.132	SEK	109,940	836.619,92	0,36
NO0005052605	Norsk Hydro ASA		STK	26.726	25.439	9.398	NOK	67,980	181.776,05	0,08
CH0012005267	Novartis AG		STK	67.803	65.010	24.686	CHF	80,130	5.205.570,94	2,27
DK0060534915	Novo-Nordisk AS		STK	52.231	50.379	19.559	DKK	656,100	4.605.768,39	2,01
DK0060336014	Novozymes A/S		STK	16.674	15.879	6.017	DKK	452,900	1.014.952,77	0,44
GB00B3MBS747	Ocado Group PLC		STK	15.013	14.221	5.140	GBP	15,040	270.235,80	0,12
AT0000743059	OMV AG		STK	785	748	278	EUR	53,960	42.358,60	0,02
FR0000133308	Orange S.A.		STK	47.251	45.879	23.280	EUR	10,420	492.355,42	0,21
FR0000120321	Oréal S.A., L'		STK	7.570	7.232	2.704	EUR	376,850	2.852.754,50	1,24
FI0009014377	Orion Corp.		STK	3.285	3.132	1.159	EUR	36,050	118.424,25	0,05
NO0003733800	Orkla ASA		STK	21.421	20.395	7.542	NOK	84,800	181.742,77	0,08
FR0000184798	Orpea		STK	1.226	1.190	602	EUR	38,800	47.568,80	0,02
DK0060094928	Orsted A/S		STK	16.032	15.114	5.495	DKK	699,000	1.506.151,28	0,66
DK0060252690	Pandora A/S		STK	2.987	2.842	1.050	DKK	714,000	286.640,23	0,12
CH0024608827	Partners Group Holding AG		STK	553	517	202	CHF	1.277,000	676.613,01	0,29
GB0006776081	Pearson PLC		STK	18.353	17.768	8.936	GBP	6,152	135.129,75	0,06
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.		STK	6.190	5.899	2.196	EUR	189,000	1.169.910,00	0,51
GB0006825383	Persimmon PLC		STK	9.620	9.165	3.393	GBP	23,940	275.630,18	0,12
GB00BGXQNP29	Phoenix Group Holdings PLC		STK	15.971	15.096	6.171	GBP	6,602	126.192,97	0,05
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.		STK	12.603	12.208	6.152	EUR	11,855	149.408,57	0,07
BE0003810273	Proximus S.A.		STK	3.645	3.539	1.794	EUR	18,115	66.029,18	0,03
GB0007099541	Prudential PLC		STK	63.760	61.816	31.203	GBP	12,355	942.797,92	0,41
IT0004176001	Prysmian S.p.A.		STK	7.374	7.153	2.597	EUR	29,730	219.229,02	0,10
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.		STK	5.473	5.346	2.584	EUR	59,700	326.738,10	0,14
NL0012169213	Qiagen N.V.		STK	7.028	6.742	2.557	EUR	43,750	307.475,00	0,13
AT0000606306	Raiffeisen Bank Intl AG		STK	3.621	3.519	1.793	EUR	24,780	89.728,38	0,04
NL0000379121	Randstad N.V.		STK	2.907	2.818	1.420	EUR	57,560	167.326,92	0,07
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group		STK	20.502	19.520	7.187	GBP	60,110	1.474.926,96	0,64
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA		STK	3.228	3.068	1.126	EUR	49,540	159.915,12	0,07
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.		STK	37.673	35.568	12.738	EUR	17,910	674.723,43	0,29
GB00B2B0DG97	Relx PLC		STK	46.294	44.891	22.692	GBP	22,700	1.257.703,07	0,55
FR0000130395	Rémy Cointreau S.A.		STK	680	649	240	EUR	184,500	125.460,00	0,05
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC		STK	56.246	53.171	19.372	GBP	5,182	348.832,23	0,15
ES0173516115	Repsol S.A.		STK	7.737	7.425	2.923	EUR	11,242	86.979,35	0,04
GB0007188757	Rio Tinto PLC		STK	23.275	22.159	8.188	GBP	51,850	1.444.328,59	0,63
CH0012032113	Roche Holding AG		STK	991	1.341	350	CHF	380,000	360.812,49	0,16
DK0010219153	Rockwool International A/S		STK	642	631	237	DKK	2.524,000	217.785,07	0,09
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The		STK	24.620	24.331	12.917	GBP	7,208	212.388,20	0,09
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.		STK	53.946	49.993	18.026	GBP	2,907	187.685,98	0,08
FI0009003305	Sampo OYJ		STK	12.261	11.721	5.499	EUR	43,850	537.644,85	0,23
SE0000667891	Sandvik AB		STK	32.485	30.901	11.426	SEK	242,300	752.244,99	0,33
FR0000120578	Sanofi S.A.		STK	35.225	33.487	12.307	EUR	92,750	3.267.118,75	1,42
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.		STK	840	797	291	EUR	387,100	325.164,00	0,14
NO0003028904	Schibsted ASA		STK	1.747	1.713	908	NOK	261,500	45.707,36	0,02
NO0010736879	Schibsted ASA		STK	2.325	2.262	1.158	NOK	232,000	53.967,52	0,02
CH0024638212	Schindler Holding AG		STK	590	561	209	CHF	230,400	130.244,32	0,06
CH0024638196	Schindler Holding AG		STK	1.194	1.136	423	CHF	230,100	263.235,99	0,11
FR0000121972	Schneider Electric SE		STK	41.933	39.494	14.269	EUR	149,360	6.263.112,88	2,73
GB0002405495	Schroders PLC		STK	3.037	2.948	1.493	GBP	33,780	122.781,23	0,05
FR0000121709	SEB S.A.		STK	814	836	289	EUR	134,100	109.157,40	0,05
SE0000163594	Securitas AB		STK	7.463	7.223	3.629	SEK	111,850	79.776,04	0,03
GB00B5ZN1N88	Segro PLC		STK	36.911	35.100	12.859	GBP	13,020	575.167,52	0,25
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC		STK	7.954	7.569	2.658	GBP	28,730	273.494,61	0,12
CH0002497458	SGS S.A.		STK	145	140	71	CHF	2.625,000	364.688,13	0,16
ES0143416115	Siemens Gamesa Renew. En. S.A.		STK	22.883	21.813	8.100	EUR	19,095	436.950,89	0,19
CH0418792922	Sika AG		STK	4.050	3.823	1.396	CHF	321,100	1.246.004,60	0,54
SE0016101844	Sinch AB		STK	12.288	16.198	3.910	SEK	94,140	110.555,01	0,05
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken		STK	40.011	38.840	19.696	SEK	119,400	456.569,35	0,20
SE0000113250	Skanska AB		STK	10.636	10.139	3.766	SEK	226,100	229.827,46	0,10
SE0000108227	SKF AB		STK	11.696	11.121	4.071	SEK	202,800	226.687,90	0,10

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
GB0009223206	Smith & Nephew PLC		STK	26.992	25.709	9.486	GBP	12,535	404.936,53	0,18
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC		STK	9.130	8.874	4.502	GBP	15,505	169.422,12	0,07
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC		STK	5.210	5.036	1.757	EUR	46,550	242.525,50	0,11
IT0003153415	Snam S.p.A.		STK	10.752	10.250	3.807	EUR	4,960	53.329,92	0,02
FR0000130809	Société Générale S.A.		STK	19.930	19.330	9.763	EUR	32,685	651.412,05	0,28
FR0000121220	Sodexo S.A.		STK	2.027	1.967	997	EUR	82,040	166.295,08	0,07
BE0003717312	Sofina S.A.		STK	374	364	185	EUR	352,400	131.797,60	0,06
BE0003470755	Solvay S.A.		STK	1.454	1.375	496	EUR	106,500	154.851,00	0,07
CH0012549785	Sonova Holding AG		STK	1.658	1.590	596	CHF	327,000	519.465,36	0,23
GB00BWFGQN14	Spirax-Sarco Engineering PLC		STK	2.170	2.054	765	GBP	132,550	344.244,51	0,15
GB0007908733	SSE PLC		STK	20.315	19.377	7.213	GBP	15,825	384.758,40	0,17
GB0007669376	St. James's Place PLC		STK	13.201	12.786	6.427	GBP	15,180	239.831,46	0,10
GB0004082847	Standard Chartered PLC		STK	64.594	63.378	33.129	GBP	5,368	414.984,85	0,18
GB00BF8Q6K64	Standard Life Aberdeen PLC		STK	53.284	52.141	27.436	GBP	2,409	153.624,75	0,07
NL0000226223	STMicroelectronics N.V.		STK	19.728	19.344	7.048	EUR	41,240	813.582,72	0,35
FI0009005961	Stora Enso Oyj		STK	16.629	15.793	5.609	EUR	17,920	297.991,68	0,13
CH0012280076	Straumann Holding AG		STK	311	297	111	CHF	1.515,500	451.586,18	0,20
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB		STK	17.989	17.155	6.383	SEK	160,950	276.707,56	0,12
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB		STK	35.858	35.447	19.537	SEK	98,740	338.378,07	0,15
CH0012255151	Swatch Group AG, The		STK	871	830	308	CHF	268,300	223.904,67	0,10
CH0012255144	Swatch Group AG, The		STK	1.583	1.509	561	CHF	51,600	78.262,72	0,03
SE0000242455	Swedbank AB		STK	22.264	21.612	10.959	SEK	181,540	386.276,73	0,17
CH0014852781	Swiss Life Holding AG		STK	775	747	362	CHF	592,000	439.589,92	0,19
CH0008038389	Swiss Prime Site AG		STK	2.321	2.213	822	CHF	91,250	202.923,49	0,09
CH0126881561	Swiss Re AG		STK	7.415	7.093	3.342	CHF	100,300	712.584,55	0,31
CH0008742519	Swisscom AG		STK	622	605	307	CHF	528,200	314.784,33	0,14
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC		STK	105.006	99.932	36.995	GBP	1,508	189.514,75	0,08
SE0005190238	Tele2 AB		STK	11.986	11.516	5.652	SEK	134,950	154.586,01	0,07
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A.		STK	236.352	217.996	84.158	EUR	0,416	98.369,70	0,04
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics.		STK	91.213	86.968	32.331	SEK	114,800	1.000.740,90	0,44
ES0178430E18	Telefónica S.A.		STK	126.306	128.236	65.167	EUR	4,129	521.454,32	0,23
NO0010063308	Telenor ASA		STK	16.422	15.863	7.925	NOK	146,650	240.951,52	0,10
FR0000051807	Téléperformance SE		STK	1.380	1.332	664	EUR	333,400	460.092,00	0,20
SE0000667925	Telia Company AB		STK	62.938	59.747	27.035	SEK	36,610	220.209,32	0,10
CH0012453913	Temenos AG		STK	1.568	1.516	756	CHF	110,050	165.333,33	0,07
LU0156801721	Tenaris S.A.		STK	2.518	5.686	6.842	EUR	10,765	27.106,27	0,01
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA		STK	102.642	96.677	34.817	EUR	6,950	713.361,90	0,31
DK0060636678	Tryg AS		STK	8.852	10.537	3.235	DKK	156,450	186.131,85	0,08
FR0000054470	Ubisoft Entertainment S.A.		STK	2.149	2.085	1.051	EUR	50,740	109.040,26	0,05
CH0244767585	UBS Group AG		STK	85.895	85.179	45.934	CHF	17,100	1.407.305,26	0,61
BE0003739530	UCB S.A.		STK	3.931	3.747	1.390	EUR	88,020	346.006,62	0,15
BE0974320526	Umicore S.A.		STK	5.841	5.546	1.992	EUR	33,420	195.206,22	0,09
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE		STK	3.856	3.572	1.424	EUR	67,290	259.470,24	0,11
IT0005239360	UniCredit S.p.A.		STK	52.203	50.560	25.485	EUR	13,990	730.319,97	0,32
GB00B10RZP78	Unilever PLC		STK	75.080	88.995	27.494	GBP	37,875	3.403.333,13	1,48
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC		STK	19.549	18.645	6.941	GBP	10,675	249.758,34	0,11
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.		STK	15.192	14.469	5.376	EUR	32,150	488.422,80	0,21
FR0013176526	Valéo S.E.		STK	6.789	6.754	2.883	EUR	24,620	167.145,18	0,07
CH0311864901	VAT Group AG		STK	795	900	105	CHF	372,200	283.509,63	0,12
FR0000124141	Veolia Environnement S.A.		STK	12.849	12.549	3.933	EUR	31,930	410.268,57	0,18
AT0000746409	Verbund AG		STK	6.536	6.232	2.315	EUR	93,800	613.076,80	0,27
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS		STK	95.567	130.619	35.052	DKK	176,950	2.272.805,31	0,99
CH0364749348	Vifor Pharma AG		STK	1.508	1.474	527	CHF	163,700	236.523,52	0,10
FR0000125486	VINCI S.A.		STK	16.703	16.238	6.209	EUR	96,660	1.614.511,98	0,70
FR0000127771	Vivendi S.A.		STK	18.749	18.890	10.604	EUR	11,600	217.488,40	0,09
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC		STK	665.584	637.654	307.166	GBP	1,300	1.035.715,78	0,45
AT0000937503	voestalpine AG		STK	2.134	2.017	760	EUR	29,420	62.782,28	0,03
SE0000115420	Volvo (publ), AB		STK	5.813	7.907	2.094	SEK	211,400	117.443,32	0,05
SE0000115446	Volvo (publ), AB		STK	41.503	39.634	14.955	SEK	208,250	826.014,22	0,36
FI0009003727	Wärtsilä Corp.		STK	15.146	17.296	15.204	EUR	10,860	164.485,56	0,07
FR0000121204	Wendel SE		STK	641	624	318	EUR	96,000	61.536,00	0,03
GB00B1KJJ408	Whitbread PLC		STK	4.456	4.358	2.259	GBP	30,220	161.163,69	0,07
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.		STK	6.462	6.298	3.262	EUR	90,240	583.130,88	0,25
FR0011981968	Worldline S.A.		STK	5.743	5.580	2.846	EUR	42,685	245.139,96	0,11
JE00B8KF9B49	WPP PLC		STK	28.684	28.245	14.916	GBP	11,515	395.304,00	0,17
NO0010208051	Yara International ASA		STK	2.995	2.870	1.152	NOK	454,600	136.222,17	0,06
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG		STK	3.699	3.592	1.822	CHF	440,700	1.561.894,51	0,68
							EUR		195.947.193,99	85,35
Sonstige Beteiligungswertpapiere										
Ausland										
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine		STK	21.747	20.721	7.683	CHF	356,900	7.436.528,03	3,24
							EUR		7.436.528,03	3,24
Summe Wertpapiervermögen							EUR		229.371.593,94	99,91
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR		156.646,64	0,07
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	156.646,31			%	100,000	156.646,31	0,07

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs		Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					Im Berichtszeitraum					
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
Verwahrstelle			CHF	0,29			%	100,000	0,28	0,00
Verwahrstelle			DKK	0,13			%	100,000	0,02	0,00
Verwahrstelle			SEK	0,32			%	100,000	0,03	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR		101.265,67	0,04
Dividendenansprüche			EUR	45.646,88					45.646,88	0,02
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	55.618,79					55.618,79	0,02
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR		-0,10	-0,00
Kredite in EU/EWR-Währungen										
Verwahrstelle			NOK	-0,33			%	100,000	-0,03	-0,00
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Verwahrstelle			GBP	-0,06			%	100,000	-0,07	-0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR		-40.637,03	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-40.637,03					-40.637,03	-0,02
Fondsvermögen							EUR		229.588.869,12	100,00[1)]
Anteilwert							EUR		14,62	
Umlaufende Anteile							STK		15.704.361,00	

[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 31.01.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)		31.01.2022	
Britisches Pfund	(GBP)	0,83555	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	(DKK)	7,44040	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	9,99490	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	10,46350	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,04370	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,12100	= 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					
DE000BASF111	BASF SE	STK	5.272	15.554	
DE0007100000	Daimler AG	STK	1.844	5.440	
DE000A3E5B58	Deutsche Lufthansa AG - Anrechte	STK	4.264	4.264	
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE	STK	4.826	8.825	
DE0005790430	FUCHS PETROLUB SE	STK	0	783	
DE0006070006	HOCHTIEF AG	STK	154	453	
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	STK	804	1.456	
DE000A3H3LR9	Scout24 AG - Anrechte	STK	1.829	1.829	
DE000VTSC017	Vitesco Technologies Group AG	STK	446	446	
DE000A3MQB30	Vonovia SE - Anrechte	STK	11.324	11.324	
Ausland					
SE0016589162	AB Electrolux	STK	4.293	4.293	
ES06670509J8	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte	STK	5.067	5.067	
ES06670509K6	ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. - Anrechte	STK	5.616	5.616	
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	STK	3.119	9.203	
FR0000051732	Atos SE	STK	2.760	5.571	
CH0531751755	Banque Cantonale Vaudoise	STK	379	763	
GB00B02L3W35	Berkeley Group Holdings PLC	STK	1.186	2.705	
SE0012455673	Boliden AB	STK	1.504	4.619	
SE0015811567	Boliden AB	STK	4.619	4.619	
FR0000039299	Bolloré S.A.	STK	3.728	7.505	
ES0605066937	Cellnex Telecom S.A. - Anrechte	STK	5.111	5.111	
FR0000130650	Dassault Systemes SE	STK	2.337	6.357	
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC	STK	17.271	34.767	
NO0010031479	DNB ASA	STK	6.833	18.990	
SE0000103814	Electrolux, AB	STK	0	2.612	

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
GB00B71N6K86	Evraz PLC	STK	3.427	6.241	
ES06189009I5	Ferrovial S.A. - Anrechte	STK	10.149	10.149	
GB00B2QPKJ12	Fresnillo PLC	STK	1.059	3.125	
BE0003818359	Galapagos N.V.	STK	272	803	
JE00B4T3BW64	Glencore PLC	STK	18.429	54.375	
DK0010287234	H. Lundbeck A/S	STK	445	1.313	
SE0000103699	Hexagon AB	STK	1.716	5.063	
SE0000652216	ICA Gruppen AB	STK	2.068	3.315	
FR0004035913	Iliad S.A.	STK	149	332	
SE0000107419	Investor AB	STK	2.872	8.474	
NL0015000LU4	Iveco Group N.V.	STK	4.294	4.294	
US46817M1071	Jackson Financial Inc.	STK	1.074	1.074	
GB00BYX91H57	JD Sports Fashion PLC	STK	8.814	14.192	
SE0014684528	Kinnevik AB	STK	1.488	4.571	
SE0015797600	Kinnevik AB	STK	4.571	4.571	
NL0009432491	Koninklijke Vopak N.V.	STK	181	331	
GB0006043169	Morrison Supermarkets PLC, Wm.	STK	32.498	62.115	
FR0000120685	Natixis S.A.	STK	7.062	19.201	
SE0008321293	NIBE Industrier AB	STK	4.908	14.482	
FR0014003307	Publicis Groupe S.A. - Anrechte	STK	3.682	3.682	
FR0000131906	Renault S.A.	STK	402	1.187	
GB00BKKMKR23	RSA Insurance Group Ltd.	STK	6.800	20.065	
FR0010411983	SCOR SE	STK	2.007	4.040	
LU0088087324	SES S.A.	STK	2.452	7.235	
NL00150001Q9	Stellantis N.V.	STK	4.359	12.861	
FR0010613471	Suez S.A.	STK	6.710	10.579	
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A.	STK	72.784	146.684	
ES06784309F4	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	82.417	82.417	
ES06784309E7	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	79.245	79.245	
DK0061534450	Tryg AS - Anrechte	STK	14.784	14.784	
NL0015000IY2	Universal Music Group N.V.	STK	13.775	13.775	
FR0014005GA0	Veolia Environnement S.A. - Anrechte	STK	7.416	7.416	
DK0010268606	Vestas Wind Systems AS	STK	3.657	11.232	

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.02.2021 bis zum 31.01.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil[1] EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		343.171,57	0,022
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		3.314.924,33	0,211
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		0,01	0,000
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-51.437,77	-0,003
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-296.453,22	-0,019
6. Sonstige Erträge		1,13	0,000
Summe der Erträge		3.310.206,05	0,211
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-121,53	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-434.095,83	-0,028
3. Sonstige Aufwendungen		-3.854,94	0,000
davon: Bankgebühren	-179,85		0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-3.457,42		0,000
Summe der Aufwendungen		-438.072,30	-0,028
III. Ordentlicher Nettoertrag		2.872.133,75	0,183
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		19.844.120,60	1,264
2. Realisierte Verluste		-2.792.738,83	-0,178
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		17.051.381,77	1,086
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		19.923.515,52	1,269
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		10.200.691,26	0,650
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-4.240.232,68	-0,270
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		5.960.458,58	0,380
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		25.883.974,10	1,648

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2021 / 2022 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		83.862.781,77
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00
2. Zwischenausschüttungen		-2.730.292,14
3. Mittelzufluss (netto)		128.947.517,75
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	211.828.309,48	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-82.880.791,73	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-6.375.112,36
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		25.883.974,10
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	10.200.691,26	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-4.240.232,68	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		229.588.869,12

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil[1] EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		21.938.983,12	1,397
1. Vortrag aus dem Vorjahr		2.015.467,60	0,128
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		19.923.515,52	1,269
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		19.051.647,37	1,213
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		19.051.647,37	1,213
III. Gesamtausschüttung		2.887.335,75	0,184
1. Zwischenausschüttung		2.730.292,14	0,174
2. Endausschüttung		157.043,61	0,010

[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
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	14,62
Umlaufende Anteile	STK	15.704.361,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	**99,91**
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 31.01.2022 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 31.01.2022 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 %) Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.		**0,25**
Transaktionskosten Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.	**EUR**	**180.559,07**
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: Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 24,48 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 78.200.447,24 EUR.	**EUR**	**162.657,30**

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)	0,08
Höhe der Annual Tracking Difference	0,03

Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error bei Fonds mit vergleichbarer Allokation und vergleichbarem Anlageuniversum unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Bei der Prognose des Tracking Errors wurde eine Marktvolatilität der vergangenen Geschäftsjahre als Grundlage herangezogen. Der niedrige Cash Anteil ist maßgeblich dafür, dass der realisierte Tracking Error unterhalb der prognostizierten Bandbreite liegt

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -2.743,50 enthalten.

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

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

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

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

Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken:

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

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten:

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

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

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

Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF

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

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

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft
Die Deka Investment GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme. Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.
Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung" (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft

Vergütungskomponenten
Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.
Für die Mitarbeiter und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.
Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlageerfolgsprämien, werden bei der Deka Investment GmbH nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools
Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.
Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Deka Investment GmbH bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeiters werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt.
Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeiter erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern
Die variable Vergütung der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und von Mitarbeitern, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitern (zusammen als "risikorelevante Mitarbeiter") unterliegt folgenden Regelungen:
· Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
· Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitern unterhalb der Geschäftsführungs-Ebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
· Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
· Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
· Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 75 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems
Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2021 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 2021 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

	EUR
Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung	**52.919.423,38**
davon feste Vergütung	43.285.414,31
davon variable Vergütung	9.634.009,07
Zahl der Mitarbeiter der KVG	455,00
Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**	**7.381.436,36**
Geschäftsführer	2.103.677,90
weitere Risktaker	1.913.005,27
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	488.811,00
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risktaker	2.875.942,19

* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt
** weitere Risktaker: alle sonstigen Risktaker, die nicht Geschäftsführer oder Risktaker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risktaker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risktaker oder Geschäftsführer befinden.

Frankfurt am Main, den 10. Mai 2022
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 2021 bis zum 31. Januar 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Februar 2021 bis zum 31. Januar 2022 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der 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 übrigen Darstellungen und Ausführungen zum Sondervermögen im Gesamtdokument Jahresbericht, mit Ausnahme der im Prüfungsurteil genannten Bestandteile des geprüften Jahresberichts sowie unseres Vermerks.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

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

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht oder unseren bei der Prüfung 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 des Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Investmentvermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die 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 – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen 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 Verstößen oder Unrichtigkeiten 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 – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – falscher Darstellungen 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 wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches 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 die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresberichts, 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 Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 12. Mai 2022

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Kühn Wirtschaftsprüfer	Nägele Wirtschaftsprüferin

Besteuerung der Erträge.

Der Fonds ist als Zweckvermögen grundsätzlich von der Körperschaft- und Gewerbesteuer befreit. Er ist jedoch partiell körperschaftsteuerpflichtig mit seinen inländischen Beteiligungseinnahmen und sonstigen inländischen Einkünften im Sinne der beschränkten Einkommensteuerpflicht mit Ausnahme von Gewinnen aus dem Verkauf von Anteilen an Kapitalgesellschaften. Der Steuersatz beträgt 15 Prozent. Soweit die steuerpflichtigen Einkünfte im Wege des Kapitalertragsteuerabzugs erhoben werden, umfasst der Steuersatz von 15 Prozent bereits den Solidaritätszuschlag.

Die Investmenterträge werden jedoch beim Privatanleger als Einkünfte aus Kapitalvermögen der Einkommensteuer unterworfen, soweit diese zusammen mit sonstigen Kapitalerträgen den Sparer-Pauschbetrag von jährlich 801,– Euro (für Alleinstehende oder getrennt veranlagte Ehegatten) bzw. 1.602,– Euro (für zusammen veranlagte Ehegatten) übersteigen.

Einkünfte aus Kapitalvermögen unterliegen grundsätzlich einem Steuerabzug von 25 Prozent (zuzüglich Solidaritätszuschlag und gegebenenfalls Kirchensteuer). Zu den Einkünften aus Kapitalvermögen gehören auch die Erträge aus Investmentfonds (Investmenterträge), d.h. die Ausschüttungen des Fonds, die Vorabpauschalen und die Gewinne aus der Veräußerung der Anteile.

Der Steuerabzug hat für den Privatanleger grundsätzlich Abgeltungswirkung (sog. Abgeltungsteuer), sodass die Einkünfte aus Kapitalvermögen regelmäßig nicht in der Einkommensteuererklärung anzugeben sind. Bei der Vornahme des Steuerabzugs werden durch die depotführende Stelle grundsätzlich bereits Verlustverrechnungen vorgenommen und aus der Direktanlage stammende ausländische Quellensteuern angerechnet.

Der Steuerabzug hat u.a. aber dann keine Abgeltungswirkung, wenn der persönliche Steuersatz geringer ist als der Abgeltungssatz von 25 Prozent. In diesem Fall können die Einkünfte aus Kapitalvermögen in der Einkommensteuererklärung angegeben werden. Das Finanzamt setzt dann den niedrigeren persönlichen Steuersatz an und rechnet auf die persönliche Steuerschuld den vorgenommenen Steuerabzug an (sog. Günstigerprüfung).

Sofern Einkünfte aus Kapitalvermögen keinem Steuerabzug unterlegen haben (weil z.B. ein Gewinn aus der Veräußerung von Fondsanteilen in einem ausländischen Depot erzielt wird), sind diese in der Steuererklärung anzugeben. Im Rahmen der Veranlagung unterliegen die Einkünfte aus Kapitalvermögen dann ebenfalls dem Abgeltungssatz von 25 Prozent oder dem niedrigeren persönlichen Steuersatz.

Sofern sich die Anteile im Betriebsvermögen befinden, werden die Erträge als Betriebseinnahmen steuerlich erfasst.

Anteile im Privatvermögen (Steuerinländer)

Ausschüttungen
Ausschüttungen des Fonds sind grundsätzlich steuerpflichtig. Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, sind 30 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei. Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen Mischfonds, dann sind 15 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei. Die steuerpflichtigen Ausschüttungen unterliegen i.d.R. dem Steuerabzug von 25 Prozent (zuzüglich Solidaritätszuschlag und gegebenenfalls Kirchensteuer).

Vom Steuerabzug kann Abstand genommen werden, wenn der Anleger Steuerinländer ist und einen Freistellungsauftrag vorlegt, sofern die steuerpflichtigen Ertragsteile 801,– Euro bei Einzelveranlagung bzw. 1.602,– Euro bei Zusammenveranlagung von Ehegatten nicht übersteigen.

Entsprechendes gilt auch bei Vorlage einer Bescheinigung für Personen, die voraussichtlich nicht zur Einkommensteuer veranlagt werden (sogenannte Nichtveranlagungsbescheinigung, nachfolgend „NV-Bescheinigung“).

Verwahrt der inländische Anleger die Anteile in einem inländischen Depot, so nimmt die depotführende Stelle als Zahlstelle vom Steuerabzug Abstand, wenn ihr vor dem festgelegten Ausschüttungstermin ein in ausreichender Höhe ausgestellter Freistellungsauftrag nach amtlichem Muster oder eine NV-Bescheinigung, die vom Finanzamt für die Dauer von maximal drei Jahren erteilt wird, vorgelegt wird. In diesem Fall erhält der Anleger die gesamte Ausschüttung ungekürzt gutgeschrieben.

Vorabpauschalen
Die Vorabpauschale ist der Betrag, um den die Ausschüttungen des Fonds innerhalb eines Kalenderjahrs den Basisertrag für dieses Kalenderjahr unterschreiten. Der Basisertrag wird durch Multiplikation des Rücknahmepreises des Anteils zu Beginn eines Kalenderjahrs mit 70 Prozent des Basiszinses, der aus der langfristig erzielbaren Rendite öffentlicher Anleihen abgeleitet wird, ermittelt. Der Basisertrag ist auf den Mehrbetrag begrenzt, der sich zwischen dem ersten und dem letzten im Kalenderjahr festgesetzten Rücknahmepreis zuzüglich der Ausschüttungen innerhalb des Kalenderjahrs ergibt. Im Jahr des Erwerbs der Anteile vermindert sich die Vorabpauschale um ein Zwölftel für jeden vollen Monat, der dem Monat des Erwerbs vorangeht. Die Vorabpauschale gilt am ersten Werktag des folgenden Kalenderjahres als zugeflossen.

Vorabpauschalen sind grundsätzlich steuerpflichtig. Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, sind 30 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei. Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen Mischfonds, sind 15 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei. Die steuerpflichtigen Vorabpauschalen unterliegen i.d.R. dem Steuerabzug von 25 Prozent (zuzüglich Solidaritätszuschlag und gegebenenfalls Kirchensteuer).

Vom Steuerabzug kann Abstand genommen werden, wenn der Anleger Steuerinländer ist und einen Freistellungsauftrag vorlegt, sofern die steuerpflichtigen Ertragsteile 801,– Euro bei Einzelveranlagung bzw. 1.602,– Euro bei Zusammenveranlagung von Ehegatten nicht übersteigen. Entsprechendes gilt auch bei Vorlage einer NV-Bescheinigung.

Verwahrt der inländische Anleger die Anteile in einem inländischen Depot, so nimmt die depotführende Stelle als Zahlstelle vom Steuerabzug Abstand, wenn ihr vor dem Zuflusszeitpunkt ein in ausreichender Höhe ausgestellter Freistellungsauftrag nach amtlichem Muster oder eine NV-Bescheinigung, die vom Finanzamt für die Dauer von maximal drei Jahren erteilt wird, vorgelegt wird. In diesem Fall wird keine Steuer abgeführt. Andernfalls hat der Anleger der inländischen depotführenden Stelle den Betrag der abzuführenden Steuer zur Verfügung zu stellen. Zu diesem Zweck darf die depotführende Stelle den Betrag der abzuführenden Steuer von einem bei ihr unterhaltenen und auf den Namen des Anlegers lautenden Konto ohne Einwilligung des Anlegers einziehen. Soweit der Anleger nicht vor Zufluss der Vorabpauschale widerspricht, darf die depotführende Stelle insoweit den Betrag der abzuführenden Steuer von einem auf den Namen des Anlegers lautenden Konto einziehen, wie ein mit dem Anleger vereinbarter Kontokorrentkredit für dieses Konto nicht in Anspruch genommen wurde. Soweit der Anleger seiner Verpflichtung, den Betrag der abzuführenden Steuer der inländischen depotführenden Stelle zur Verfügung zu stellen, nicht nachkommt, hat die depotführende Stelle dies dem für sie zuständigen Finanzamt anzuzeigen. Der Anleger muss in diesem Fall die Vorabpauschale insoweit in seiner Einkommensteuererklärung angeben.

Veräußerungsgewinne auf Anlegerebene
Werden Anteile an dem Fonds nach dem 31. Dezember 2017 veräußert, unterliegt der Veräußerungsgewinn dem Abgeltungssatz von 25 Prozent. Dies gilt sowohl für Anteile, die vor dem 1. Januar 2018 erworben wurden und die zum 31. Dezember 2017 als veräußert und zum 1. Januar 2018 wieder als angeschafft gelten, als auch für nach dem 31. Dezember 2017 erworbene Anteile. Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, sind 30 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei. Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen Mischfonds, dann sind 15 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei.

Bei Gewinnen aus dem Verkauf von Anteilen, die vor dem 1. Januar 2018 erworben wurden und die zum 31. Dezember 2017 als veräußert und zum 1. Januar 2018 wieder als angeschafft gelten, ist zu beachten, dass im Zeitpunkt der tatsächlichen Veräußerung auch die Gewinne aus der zum 31. Dezember 2017 erfolgten fiktiven Veräußerung zu versteuern sind, falls die Anteile tatsächlich nach dem 31. Dezember 2008 erworben worden sind.

Sofern die Anteile in einem inländischen Depot verwahrt werden, nimmt die depotführende Stelle den Steuerabzug unter Berücksichtigung etwaiger Teilfreistellungen vor. Der Steuerabzug von 25 Prozent (zuzüglich Solidaritätszuschlag und gegebenenfalls Kirchensteuer) kann durch die Vorlage eines ausreichenden Freistellungsauftrags bzw. einer NV-Bescheinigung vermieden werden. Werden solche Anteile von einem Privatanleger mit Verlust veräußert, dann ist der Verlust mit anderen positiven Einkünften aus Kapitalvermögen verrechenbar. Sofern die Anteile in einem inländischen Depot verwahrt werden und bei derselben depotführenden Stelle im selben Kalenderjahr positive Einkünfte aus Kapitalvermögen erzielt wurden, nimmt die depotführende Stelle die Verlustverrechnung vor.

Bei einer Veräußerung der vor dem 1. Januar 2009 erworbenen Fondsanteile nach dem 31. Dezember 2017 ist der Gewinn, der nach dem 31. Dezember 2017 entsteht, bei Privatanlegern grundsätzlich bis zu einem Betrag von 100.000 Euro steuerfrei. Dieser Freibetrag kann nur in Anspruch genommen werden, wenn diese Gewinne gegenüber dem für den Anleger zuständigen Finanzamt erklärt werden.

Bei der Ermittlung des Veräußerungsgewinns ist der Gewinn um die während der Besitzzeit angesetzten Vorabpauschalen zu mindern.

Anteile im Betriebsvermögen (Steuerinländer)

Erstattung der Körperschaftsteuer des Fonds
Ist der Anleger eine inländische Körperschaft, Personenvereinigung oder Vermögensmasse, die nach der Satzung, dem Stiftungsgeschäft oder der sonstigen Verfassung und nach der tatsächlichen Geschäftsführung ausschließlich und unmittelbar gemeinnützigen, mildtätigen oder kirchlichen Zwecken dient oder eine Stiftung des öffentlichen Rechts, die ausschließlich und unmittelbar gemeinnützigen oder mildtätigen Zwecken dient, oder eine juristische Person des öffentlichen Rechts, die ausschließlich und unmittelbar kirchlichen Zwecken dient, dann erhält er auf Antrag vom Fonds die auf der Fondsebene angefallene Körperschaftsteuer anteilig für seine Besitzzeit erstattet; dies gilt nicht, wenn die Anteile in einem wirtschaftlichen Geschäftsbetrieb gehalten werden. Dasselbe gilt für vergleichbare ausländische Anleger mit Sitz und Geschäftsleitung in einem Amts- und Beitreibungshilfe leistenden ausländischen Staat. Die Erstattung setzt voraus, dass der Anleger seit mindestens drei Monaten vor dem Zufluss der körperschaftsteuerpflichtigen Erträge des Fonds zivilrechtlicher und wirtschaftlicher Eigentümer der Anteile ist, ohne dass eine Verpflichtung zur Übertragung der Anteile auf eine andere Person besteht. Ferner setzt die Erstattung im Hinblick auf die auf der Fondsebene angefallene Körperschaftsteuer auf deutsche Dividenden und Erträge aus deutschen eigenkapitalähnlichen Genussrechten im Wesentlichen voraus, dass deutsche Aktien und deutsche eigenkapitalähnliche Genussrechte vom Fonds als wirtschaftlichem Eigentümer ununterbrochen 45 Tage innerhalb von 45 Tagen vor und nach dem Fälligkeitszeitpunkt der Kapitalerträge gehalten wurden und in diesen 45 Tagen ununterbrochen Mindestwertänderungsrisiken i.H.v. 70 Prozent bestanden.

Dem Antrag sind Nachweise über die Steuerbefreiung und ein von der depotführenden Stelle ausgestellter Investmentanteil-Bestandsnachweis beizufügen. Der Investmentanteil-Bestandsnachweis ist eine nach amtlichem Muster erstellte Bescheinigung über den Umfang der durchgehend während des Kalenderjahres vom Anleger gehaltenen Anteile sowie den Zeitpunkt und Umfang des Erwerbs und der Veräußerung von Anteilen während des Kalenderjahres.

Aufgrund der hohen Komplexität der Regelung erscheint die Hinzuziehung eines steuerlichen Beraters sinnvoll.

Ausschüttungen
Ausschüttungen des Fonds sind grundsätzlich einkommen- bzw. körperschaftsteuer- und gewerbesteuerpflichtig. Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, sind 60 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei für Zwecke der Einkommensteuer und 30 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer, wenn die Anteile von natürlichen Personen im Betriebsvermögen gehalten werden. Für steuerpflichtige Körperschaften sind generell 80 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 40 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer. Für Körperschaften, die Lebens- oder Krankenversicherungsunternehmen sind und bei denen die Anteile den Kapitalanlagen zuzurechnen sind, oder die Kreditinstitute sind und bei denen die Anteile dem Handelsbuch zuzurechnen sind oder von denen mit dem Ziel der kurzfristigen Erzielung eines Eigenhandelserfolgs erworben wurden, sind 30 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 15 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer.

Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen Mischfonds, sind 30 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei für Zwecke der Einkommensteuer und 15 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer, wenn die Anteile von natürlichen Personen im Betriebsvermögen gehalten werden. Für steuerpflichtige Körperschaften sind generell 40 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 20 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer. Für Körperschaften, die Lebens- oder Krankenversicherungsunternehmen sind und bei denen die Anteile den Kapitalanlagen zuzurechnen sind, oder die Kreditinstitute sind und bei denen die Anteile dem Handelsbuch zuzurechnen sind oder von denen mit dem Ziel der kurzfristigen Erzielung eines Eigenhandelserfolgs erworben wurden, sind 15 Prozent der Ausschüttungen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 7,5 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer.

Die Ausschüttungen unterliegen i.d.R. dem Steuerabzug von 25 Prozent (zuzüglich Solidaritätszuschlag). Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, wird beim Steuerabzug die Teilfreistellung von 30 Prozent berücksichtigt. Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen Mischfonds, wird beim Steuerabzug die Teilfreistellung von 15 Prozent berücksichtigt.

Vorabpauschalen
Die Vorabpauschale ist der Betrag, um den die Ausschüttungen des Fonds innerhalb eines Kalenderjahrs den Basisertrag für dieses Kalenderjahr unterschreiten. Der Basisertrag wird durch Multiplikation des Rücknahmepreises des Anteils zu Beginn eines Kalenderjahrs mit 70 Prozent des Basiszinses, der aus der langfristig erzielbaren Rendite öffentlicher Anleihen abgeleitet wird, ermittelt. Der Basisertrag ist auf den Mehrbetrag begrenzt, der sich zwischen dem ersten und dem letzten im Kalenderjahr festgesetzten Rücknahmepreis zuzüglich der Ausschüttungen innerhalb des Kalenderjahrs ergibt. Im Jahr des Erwerbs der Anteile vermindert sich die Vorabpauschale um ein Zwölftel für jeden vollen Monat, der dem Monat des Erwerbs vorangeht. Die Vorabpauschale gilt am ersten Werktag des folgenden Kalenderjahres als zugeflossen.

Vorabpauschalen sind grundsätzlich einkommen- bzw. körperschaftsteuer- und gewerbesteuerpflichtig. Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, sind 60 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei für Zwecke der Einkommensteuer und 30 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer, wenn die Anteile von natürlichen Personen im Betriebsvermögen gehalten werden. Für steuerpflichtige Körperschaften sind generell 80 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 40 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer. Für Körperschaften, die Lebens- oder Krankenversicherungsunternehmen sind und bei denen die Anteile den Kapitalanlagen zuzurechnen sind, oder die Kreditinstitute sind und bei denen die Anteile dem Handelsbuch zuzurechnen sind oder von denen mit dem Ziel der kurzfristigen Erzielung eines Eigenhandelserfolgs erworben wurden, sind 30 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 15 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer.

Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen Mischfonds, sind 30 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei für Zwecke der Einkommensteuer und 15 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer, wenn die Anteile von natürlichen Personen im Betriebsvermögen gehalten werden. Für steuerpflichtige Körperschaften sind generell 40 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 20 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer. Für Körperschaften, die Lebens- oder Krankenversicherungsunternehmen sind und bei denen die Anteile den Kapitalanlagen zuzurechnen sind, oder die Kreditinstitute sind und bei denen die Anteile dem Handelsbuch zuzurechnen sind oder von denen mit dem Ziel der kurzfristigen Erzielung eines Eigenhandelserfolgs erworben wurden, sind 15 Prozent der Vorabpauschalen steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 7,5 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer.

Die Vorabpauschalen unterliegen i.d.R. dem Steuerabzug von 25 Prozent (zuzüglich Solidaritätszuschlag). Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, wird beim Steuerabzug die Teilfreistellung von 30 Prozent berücksichtigt. Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen

Mischfonds, wird beim Steuerabzug die Teilfreistellung von 15 Prozent berücksichtigt.

Veräußerungsgewinne auf Anlegerebene
Gewinne aus der Veräußerung der Anteile unterliegen grundsätzlich der Einkommen- bzw. Körperschaftsteuer und der Gewerbesteuer. Bei der Ermittlung des Veräußerungsgewinns ist der Gewinn um die während der Besitzzeit angesetzten Vorabpauschalen zu mindern.

Erfüllt der Fonds jedoch die steuerlichen Voraussetzungen für einen Aktienfonds, sind 60 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei für Zwecke der Einkommensteuer und 30 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer, wenn die Anteile von natürlichen Personen im Betriebsvermögen gehalten werden. Für steuerpflichtige Körperschaften sind generell 80 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 40 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer. Für Körperschaften, die Lebens- oder Krankenversicherungsunternehmen sind und bei denen die Anteile den Kapitalanlagen zuzurechnen sind, oder die Kreditinstitute sind und bei denen die Anteile dem Handelsbuch zuzurechnen sind oder von denen mit dem Ziel der kurzfristigen Erzielung eines Eigenhandelserfolgs erworben wurden, sind 30 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 15 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer.

Erfüllt der Fonds die steuerlichen Voraussetzungen für einen Mischfonds, sind 30 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei für Zwecke der Einkommensteuer und 15 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer, wenn die Anteile von natürlichen Personen im Betriebsvermögen gehalten werden. Für steuerpflichtige Körperschaften sind generell 40 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 20 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer. Für Körperschaften, die Lebens- oder Krankenversicherungsunternehmen sind und bei denen die Anteile den Kapitalanlagen zuzurechnen sind, oder die Kreditinstitute sind und bei denen die Anteile dem Handelsbuch zuzurechnen sind oder von denen mit dem Ziel der kurzfristigen Erzielung eines Eigenhandelserfolgs erworben wurden, sind 15 Prozent der Veräußerungsgewinne steuerfrei für Zwecke der Körperschaftsteuer und 7,5 Prozent für Zwecke der Gewerbesteuer.

Die Gewinne aus der Veräußerung der Anteile unterliegen i.d.R. keinem Steuerabzug.

Negative steuerliche Erträge
Eine direkte Zurechnung der negativen steuerlichen Erträge auf den Anleger ist nicht möglich.

Abwicklungsbesteuerung
Während der Abwicklung des Fonds gelten Ausschüttungen nur insoweit als Ertrag, wie in ihnen der Wertzuwachs eines Kalenderjahres enthalten ist.

Steuerausländer

Verwahrt ein Steuerausländer die Fondsanteile im Depot bei einer inländischen depotführenden Stelle, wird vom Steuerabzug auf Ausschüttungen, Vorabpauschalen und Gewinne aus der Veräußerung der Anteile Abstand genommen, sofern er seine steuerliche Ausländereigenschaft nachweist. Sofern die Ausländereigenschaft der depotführenden Stelle nicht bekannt bzw. nicht rechtzeitig nachgewiesen wird, ist der ausländische Anleger gezwungen, die Erstattung des Steuerabzugs entsprechend der Abgabenordnung (§ 37 Abs. 2 AO) zu beantragen. Zuständig ist das für die depotführende Stelle zuständige Finanzamt.

Solidaritätszuschlag

Auf den auf Ausschüttungen, Vorabpauschalen und Gewinnen aus der Veräußerung von Anteilen abzuführenden Steuerabzug ist ein Solidaritätszuschlag in Höhe von 5,5 Prozent zu erheben. Der Solidaritätszuschlag ist bei der Einkommensteuer und Körperschaftsteuer anrechenbar.

Kirchensteuer

Soweit die Einkommensteuer bereits von einer inländischen depotführenden Stelle (Abzugsverpflichteter) durch den Steuerabzug erhoben wird, wird die darauf entfallende Kirchensteuer nach dem Kirchensteuersatz der Religionsgemeinschaft, der der Kirchensteuerpflichtige angehört, regelmäßig als Zuschlag zum Steuerabzug erhoben. Die Abzugsfähigkeit der Kirchensteuer als Sonderausgabe wird bereits beim Steuerabzug mindernd berücksichtigt.

Ausländische Quellensteuer

Auf die ausländischen Erträge des Fonds wird teilweise in den Herkunftsländern Quellensteuer einbehalten. Diese Quellensteuer kann bei den Anlegern nicht steuermindernd berücksichtigt werden.

Folgen der Verschmelzung von Sondervermögen

In den Fällen der Verschmelzung eines inländischen Sondervermögens auf ein anderes inländisches Sondervermögen kommt es weder auf der Ebene der Anleger noch auf der Ebene der beteiligten Sondervermögen zu einer Aufdeckung von stillen Reserven, d.h. dieser Vorgang ist steuerneutral. Das Gleiche gilt für die Übertragung aller Vermögensgegenstände eines inländischen Sondervermögens auf eine inländische Investmentaktiengesellschaft mit veränderlichem Kapital oder ein Teilgesellschaftsvermögen einer inländischen Investmentaktiengesellschaft mit veränderlichem Kapital. Erhalten die Anleger des

übertragenden Sondervermögens eine im Verschmelzungsplan vorgesehene Barzahlung (§ 190 Abs. 2 Nr. 2 KAGB), ist diese wie eine Ausschüttung zu behandeln.

Automatischer Informationsaustausch in Steuersachen

Die Bedeutung des automatischen Austauschs von Informationen zur Bekämpfung von grenzüberschreitendem Steuerbetrug und grenzüberschreitender Steuerhinterziehung hat auf internationaler Ebene in den letzten Jahren stark zugenommen. Die OECD hat daher im Auftrag der G20 in 2014 einen globalen Standard für den automatischen Informationsaustausch über Finanzkonten in Steuersachen veröffentlicht (Common Reporting Standard, im Folgenden „CRS"). Der CRS wurde von mehr als 90 Staaten (teilnehmende Staaten) im Wege eines multilateralen Abkommens vereinbart. Außerdem wurde er Ende 2014 mit der Richtlinie 2014/107/EU des Rates vom 9. Dezember 2014 in die Richtlinie 2011/16/EU bezüglich der Verpflichtung zum automatischen Austausch von Informationen im Bereich der Besteuerung integriert. Die teilnehmenden Staaten (alle Mitgliedstaaten der EU sowie etliche Drittstaaten) wenden den CRS grundsätzlich ab 2016 mit Meldepflichten ab 2017 an. Lediglich einzelnen Staaten (z.B. Österreich und der Schweiz) wird es gestattet, den CRS ein Jahr später anzuwenden. Deutschland hat den CRS mit dem Finanzkonten-Informationsaustauschgesetz vom 21. Dezember 2015 in deutsches Recht umgesetzt und wendet diesen ab 2016 an.

Mit dem CRS werden meldende Finanzinstitute (im Wesentlichen Kreditinstitute) dazu verpflichtet, bestimmte Informationen über ihre Kunden einzuholen. Handelt es sich bei den Kunden (natürliche Personen oder Rechtsträger) um in anderen teilnehmenden Staaten ansässige meldepflichtige Personen (dazu zählen nicht z.B. börsennotierte Kapitalgesellschaften oder Finanzinstitute), werden deren Konten und Depots als meldepflichtige Konten eingestuft. Die meldenden Finanzinstitute werden dann für jedes meldepflichtige Konto bestimmte Informationen an ihre Heimatsteuerbehörde übermitteln. Diese übermittelt die Informationen dann an die Heimatsteuerbehörde des Kunden.

Bei den zu übermittelnden Informationen handelt es sich im Wesentlichen um die persönlichen Daten des meldepflichtigen Kunden (Name; Anschrift; Steueridentifikationsnummer; Geburtsdatum und Geburtsort (bei natürlichen Personen); Ansässigkeitsstaat) sowie um Informationen zu den Konten und Depots (z.B. Kontonummer; Kontosaldo oder Kontowert; Gesamtbruttobetrag der Erträge wie Zinsen, Dividenden oder Ausschüttungen von Investmentfonds; Gesamtbruttoerlöse aus der Veräußerung oder Rückgabe von Finanzvermögen (einschließlich Fondsanteilen)).

Konkret betroffen sind folglich meldepflichtige Anleger, die ein Konto und/oder Depot bei einem Kreditinstitut unterhalten, das in einem teilnehmenden Staat ansässig ist. Daher werden deutsche Kreditinstitute Informationen über Anleger, die in anderen teilnehmenden Staaten ansässig sind, an das Bundeszentralamt für Steuern melden, das die Informationen an die jeweiligen Steuerbehörden der Ansässigkeitsstaaten der Anleger weiterleitet. Entsprechend werden Kreditinstitute in anderen teilnehmenden Staaten Informationen über Anleger, die in Deutschland ansässig sind, an ihre jeweilige Heimatsteuerbehörde melden, die die Informationen an das Bundeszentralamt für Steuern weiterleitet. Zuletzt ist es denkbar, dass in anderen teilnehmenden Staaten ansässige Kreditinstitute Informationen über Anleger, die in wiederum anderen teilnehmenden Staaten ansässig sind, an ihre jeweilige Heimatsteuerbehörde melden, die die Informationen an die jeweiligen Steuerbehörden der Ansässigkeitsstaaten der Anleger weiterleitet.

Rechtliche Hinweise

Diese steuerlichen Hinweise sollen einen Überblick über die steuerlichen Folgen der Fondsanlage vermitteln. Sie können nicht alle steuerlichen Aspekte behandeln, die sich aus der individuellen Situation des Anlegers ergeben können. Interessierten Anlegern empfehlen wir, sich durch einen Angehörigen der steuerberatenden Berufe über die steuerlichen Folgen des Fondsinvestments beraten zu lassen.

Die steuerlichen Ausführungen basieren auf der derzeit bekannten Rechtslage. Es kann keine Gewähr dafür übernommen werden, dass sich die steuerrechtliche Beurteilung durch Gesetzgebung, Rechtsprechung oder Erlasse der Finanzverwaltung nicht ändert. Solche Änderungen können auch rückwirkend eingeführt werden und die oben beschriebenen steuerrechtlichen Folgen nachteilig beeinflussen.

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 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 2020

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

Alleingesellschafterin
DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

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

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

Mitglieder
Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der
Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squaire
Am Flughafen
60549 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 2022

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

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39
www.deka-etf.de

Finanzgruppe

Stand 01.22