

Jahresbericht
zum 31. Januar 2024.

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

The logo for Deka Investments, featuring the word "Deka" in a large, white, sans-serif font with a small square icon to its left, and the word "Investments" in a smaller, white, sans-serif font below it. The background is a red, wavy, fabric-like texture.

.Deka
Investments

Lizenzvermerk

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

Bericht der Geschäftsführung.

31. Januar 2024

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Januar 2024.

Vor dem Hintergrund hoher Lebenshaltungskosten, einer schwachen Auslandsnachfrage und einer strafferen Geldpolitik verlor die europäische Wirtschaftsentwicklung im Berichtszeitraum spürbar an Schwung. In Deutschland hat sich die Konjunkturdynamik merklich abgekühlt, was sich in einer Schrumpfung des Bruttoinlandsprodukts in 2023 niederschlug. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin die Wirtschaftslage in den USA. Wiederholt sorgten geopolitische Belastungsfaktoren (Ukraine-Krieg, Nahost-Konflikt, Angriffe auf Schiffe im Roten Meer) für Verunsicherung an den Finanzmärkten. Im Verlauf zeigte die Inflation jedoch Anzeichen einer Normalisierung, was in den letzten Monaten zu einer freundlicheren Marktstimmung führte.

In der Geldpolitik stand im Berichtsjahr die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zunächst zu weiteren restriktiven Maßnahmen veranlasste. Während die Fed ab Mitte Juli das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent beibehielt, erhöhte die EZB noch im September den Hauptrefinanzierungssatz auf 4,50 Prozent. In diesem Umfeld zogen an den Rentenmärkten die Renditen bis in das dritte Quartal hinein signifikant an. Mit ersten Anzeichen für ein Ende des Zinserhöhungs-Zyklus entfernten sich jedoch die Verzinsungen ab November wieder merklich von ihren zuvor erreichten mehrjährigen Höchstständen. Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende Januar bei 2,2 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten bei 3,9 Prozent.

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

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 31. Januar 2024	12
Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2024	13
Anhang	19
Nachhaltiges Investitionsziel	21
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	38
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 beigelegt sind, erfolgen.

Jahresbericht 01.02.2023 bis 31.01.2024

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Tätigkeitsbericht.

Der Deka MSCI Japan 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 Japan Climate Change ESG Select (Preisindex) nachzubilden.

Der MSCI Japan Climate Change ESG Select umfasst Aktien von großen und mittelgroßen japanischen Unternehmen. Dieser Index berücksichtigt hierbei ökologische (Environment – „E“), soziale (Social – „S“) und die verantwortungsvolle Unternehmens- bzw. Staatsführung (Governance – „G“) betreffende Kriterien (sog. ESG-Kriterien) mit besonderem Schwerpunkt. Bei dem Fonds handelt es sich daher um ein Finanzprodukt im Sinne des Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung).

Details zu den ökologischen und/oder sozialen Merkmalen gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 finden Sie im Anhang dieses Jahresberichts.

Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrundeliegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt. Grundlage hierfür ist, dass die Entscheidungen über den Erwerb oder die Veräußerung von Vermögensgegenständen sowie über deren Gewichtung im Sondervermögen von dem zugrundeliegenden Index abhängig sind (passives Management).

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren im Wesentlichen aus Transaktionen mit Aktien aufgrund von Indexanpassungen und Rücknahme von Anteilscheinen.

Adressenausfallrisiken

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

Währungsrisiken

Die Fondswährung lautet auf Euro und die Indexkonstituenten im Berichtszeitraum lauteten auf folgende Fremdwährung: Japanische Yen. Somit bestand für den Anleger aus der Eurozone ein hohes Währungsrisiko in Fremdwährungen, wobei wegen des Ziels der Indexnachbildung keine aktive Steuerung der Währungsrisiken durch das Fondsmanagement erfolgte.

Wichtige Kennzahlen

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
	13,27%	2,95%	4,37%
ISIN	DE000ETFL318		
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.			

Sonstige Marktpreisrisiken

Das Investmentvermögen unterlag im Berichtszeitraum dem Marktpreisrisiko der im Investmentvermögen gehaltenen Wertpapiere. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Marktpreisrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des MSCI Japan Climate Change ESG Select (Preisindex). Die geringen Abweichungen in dem Marktpreisexposition 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 15,43 Prozent.

Operationelle Risiken

Das Management von operationellen Risiken für das Investmentvermögen erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Deka Investment GmbH ist methodisch und prozessual in das in der Deka-Gruppe implementierte System zum Management und Controlling operationeller Risiken eingebunden. In diesem Rahmen werden regelmäßig die operationellen Risiken der für das Investmentvermögen relevanten Prozesse identifiziert, bewertet und überwacht. Instrumente hierfür sind u.a. das dezentrale Self Assessment, Szenarioanalysen sowie eine konzernweite Schadensfalldatenbank. Außerdem werden wesentliche Auslagerungen, insbesondere die konzernexterne Auslagerung der Fondsbuchhaltung an die BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland, im Rahmen eines Auslagerungscontrollings überwacht. Im Berichtszeitraum entstand dem Investmentvermögen kein Schaden aus operationellen Risiken.

Liquiditätsrisiken

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

Deka MSCI Japan 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	JP3102000001	Aisin Corp. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3311400000	Cyberagent Inc. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3385890003	GMO Payment Gateway Inc. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3766550002	Hakuhodo DY Holdings Inc. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3143000002	Ito En Ltd. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3143900003	Itochu Techno-Solutions Corp. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3206000006	Kakaku.com Inc. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3277800003	Keio Corp. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3301100008	Kobayashi Pharmaceut. Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3270000007	Kurita Water Industries Ltd. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3626800001	LIXIL Corp. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3435750009	M3 Inc. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3695200000	NGK Insulators Ltd. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3689050007	Nihon M&A Center Holdings Inc. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3717600005	Nippon Shinyaku Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3547670004	Persol Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3592200004	Toshiba Corp. Registered Shares o.N.
Löschung	JP3274280001	Welcia Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3778630008	BANDAI NAMCO Holdings Inc. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3835250006	BayCurrent Consulting Inc. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3131090007	IIDA Group Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3705200008	Japan Airlines Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3223800008	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3046270009	KDX Realty Investment Corp. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3284600008	Koito Mfg Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3869010003	MatsukiyoCocokara & Co. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3381000003	Nippon Steel Corp. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3672400003	Nissan Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3814800003	Subaru Corp. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3397200001	Suzuki Motor Corp. Registered Shares o.N.
Neuaufnahme	JP3429300001	Zensho Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
JP3435000009	Sony Group Corp. Registered Shares o.N.	4,88
JP3788600009	Hitachi Ltd. Registered Shares o.N.	4,62
JP3236200006	Keyence Corp. Registered Shares o.N.	3,44
JP3571400005	Tokyo Electron Ltd. Registered Shares o.N.	2,78
JP3902900004	Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Registered Shares o.N.	2,63
JP3566800003	Central Japan Railway Co. Registered Shares o.N.	2,23
JP3475350009	Daiichi Sankyo Co. Ltd. Registered Shares o.N.	2,22
JP3783600004	East Japan Railway Co. Registered Shares o.N.	2,14
JP3802300008	Fast Retailing Co. Ltd. Registered Shares o.N.	1,89
JP3463000004	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	1,87
JP3837800006	Hoya Corp. Registered Shares o.N.	1,74
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	1,63
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group Registered Shares o.N.	1,62
JP3200450009	ORIX Corp. Registered Shares o.N.	1,49
JP3970300004	Recruit Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	1,38
JP3914400001	Murata Manufacturing Co. Ltd. Registered Shares o.N.	1,34
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd. Registered Shares o.N.	1,34
JP3481800005	Daikin Industries Ltd. Registered Shares o.N.	1,33
JP3162600005	SMC Corp. Registered Shares o.N.	1,21
JP3122400009	Advantest Corp. Registered Shares o.N.	1,19
JP3496400007	KDDI Corp. Registered Shares o.N.	1,18
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Registered Shares o.N.	1,17
JP3436100006	SoftBank Group Corp. Registered Shares o.N.	1,08
JP3885780001	Mizuho Financial Group Inc. Registered Shares o.N.	1,08
JP3659000008	West Japan Railway Co. Registered Shares o.N.	1,04
JP3802400006	Fanuc Corp. Registered Shares o.N.	1,03
JP3519400000	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,98
JP3548600000	Disco Corp. Registered Shares o.N.	0,96
JP3198900007	Oriental Land Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,93
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,93
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Registered Shares o.N.	0,90
JP3197800000	Omron Corp. Registered Shares o.N.	0,88
JP3242800005	Canon Inc. Registered Shares o.N.	0,86
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Registered Shares o.N.	0,85
JP3304200003	Komatsu Ltd. Registered Shares o.N.	0,85
JP3932000007	Yaskawa Electric Corp. Registered Shares o.N.	0,84
JP3814000000	Fujifilm Holdings Corp. Registered Shares o.N.	0,75
JP3164720009	Renesas Electronics Corp. Registered Shares o.N.	0,74
JP3546800008	Terumo Corp. Registered Shares o.N.	0,73
JP3278600006	Keisei Electric Railway Co.Ltd Registered Shares o.N.	0,68
JP3260800002	Kintetsu Group Holdings Co.Ltd Registered Shares o.N.	0,67
JP3866800000	Panasonic Holdings Corp. Registered Shares o.N.	0,66
JP3538800008	TDK Corp. Registered Shares o.N.	0,65
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,63
JP3633400001	Toyota Motor Corp. Registered Shares o.N.	0,61
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,61

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
JP3820000002	Fuji Electric Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,59
JP3249600002	Kyocera Corp. Registered Shares o.N.	0,59
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Registered Shares o.N.	0,59
JP3201200007	Olympus Corp. Registered Shares o.N.	0,58
JP3205800000	Kao Corp. Registered Shares o.N.	0,57
JP3830800003	Bridgestone Corp. Registered Shares o.N.	0,57
JP3196000008	Odakyu Electric Railway Co.Ltd Registered Shares o.N.	0,54
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc. Registered Shares o.N.	0,54
JP3188220002	Otsuka Holdings Company Ltd. Registered Shares o.N.	0,54
JP3388200002	Aeon Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,51
JP3476480003	Dai-Ichi Life Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,51
JP3778630008	BANDAI NAMCO Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,50
JP3347200002	Shionogi & Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,50
JP3951600000	Unicharm Corp. Registered Shares o.N.	0,50
JP3734800000	Nidec Corp. Registered Shares o.N.	0,49
JP3752900005	Japan Post Holdings Co.Ltd Registered Shares o.N.	0,48
JP3160400002	Eisai Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,48
JP3266400005	Kubota Corp. Registered Shares o.N.	0,48
JP3937200008	Azbil Corp. Registered Shares o.N.	0,45
JP3944130008	USS Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,44
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Registered Shares o.N.	0,44
JP3351600006	Shiseido Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,44
JP3890310000	MS&AD Insurance Grp Hldgs Inc. Registered Shares o.N.	0,44
JP3955000009	Yokogawa Electric Corp. Registered Shares o.N.	0,43
JP3358000002	Shimano Inc. Registered Shares o.N.	0,42
JP3756100008	Nitori Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,41
JP3116000005	Asahi Group Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	0,41
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,40
JP3733000008	NEC Corp. Registered Shares o.N.	0,39
JP3762600009	Nomura Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,38
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,38
JP3684000007	Nitto Denko Corp. Registered Shares o.N.	0,37
JP3946750001	Japan Post Bank Co.Ltd Registered Shares o.N.	0,37
JP3421800008	Secom Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,36
JP3351100007	Systemex Corp. Registered Shares o.N.	0,36
JP3409000001	Sumitomo Realty & Dev. Co.Ltd. Registered Shares o.N.	0,36
JP3104890003	TIS Inc. Registered Shares o.N.	0,33
JP3258000003	Kirin Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,33
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Hldg.Inc Registered Shares o.N.	0,33
JP3639650005	Pan Pacific Intl Hldgs Corp. Registered Shares o.N.	0,33
JP3358800005	Shimizu Corp. Registered Shares o.N.	0,31
JP3762800005	Nomura Research Institute Ltd. Registered Shares o.N.	0,29
JP3500610005	Resona Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,29
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,28
JP3774200004	Hankyu Hanshin Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,28
JP3284600008	Koito Mfg Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,28

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
JP3183200009	Japan Exchange Group Inc. Registered Shares o.N.	0,27
JP3967200001	Rakuten Group Inc. Registered Shares o.N.	0,27
JP3240400006	Kikkoman Corp. Registered Shares o.N.	0,26
JP3173400007	Obic Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,26
JP3210200006	Kajima Corp. Registered Shares o.N.	0,25
JP3869010003	MatsukiyoCocokara & Co. Registered Shares o.N.	0,25
JP3574200006	Tokyu Corp. Registered Shares o.N.	0,24
JP3027670003	Nippon Building Fund Inc. Registered Shares o.N.	0,24
JP3906000009	Minebea Mitsumi Inc. Registered Shares o.N.	0,24
JP3486800000	Daito Trust Constr. Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,23
JP3502200003	Daiwa Securities Group Inc. Registered Shares o.N.	0,23
JP3771800004	Hamamatsu Photonics K.K. Registered Shares o.N.	0,23
JP3551500006	Denso Corp. Registered Shares o.N.	0,23
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,22
JP3165700000	NTT Data Group Corp. Registered Shares o.N.	0,22
JP3357200009	Shimadzu Corp. Registered Shares o.N.	0,21
JP3402600005	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,21
JP3629000005	Toppan Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,21
JP3539220008	T & D Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,20
JP3597800006	Tobu Railway Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,20
JP3190000004	Obayashi Corp. Registered Shares o.N.	0,20
JP3443600006	Taisei Corp. Registered Shares o.N.	0,20
JP3933800009	LY Corp. Registered Shares o.N.	0,20
JP3027680002	Japan Real Estate Inv. Corp. Registered Shares o.N.	0,20
JP3497400006	Daifuku Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,19
JP3675600005	Nissin Foods Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,19
JP3862400003	Makita Corp. Registered Shares o.N.	0,19
JP3039710003	Japan Metropolitan Fund Invest Registered Shares o.N.	0,18
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,18
JP3048110005	Nomura Real Estate Mast.Fd Inc Registered Shares o.N.	0,18
JP3046270009	KDX Realty Investment Corp. Registered Shares o.N.	0,18
JP3982800009	Rohm Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,18
JP3637300009	Trend Micro Inc. Registered Shares o.N.	0,18
JP3902400005	Mitsubishi Electric Corp. Registered Shares o.N.	0,17
JP3047510007	GLP J-REIT Registered Shares o.N.	0,17
JP3148800000	Ibiden Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,17
JP3256000005	Kyowa Kirin Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,17
JP3419400001	Sekisui Chemical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,17
JP3360800001	Hulic Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,17
JP3162770006	SG Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,17
JP3110650003	Asahi Intecc Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,16
JP3047550003	Nippon Prologis REIT Inc. Registered Shares o.N.	0,16
JP3885400006	Misumi Group Inc. Registered Shares o.N.	0,16
JP3046390005	Daiwa House REIT Investm.Corp. Registered Shares o.N.	0,15
JP3218900003	Capcom Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,15
JP3291200008	Kobe Bussan Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,15

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
JP3670800006	Nissan Chemical Corp. Registered Shares o.N.	0,15
JP3436120004	SBI Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,15
JP3940000007	Yamato Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,15
JP3300200007	Konami Group Corp. Registered Shares o.N.	0,14
JP3499800005	Mitsubishi HC Capital Inc. Registered Shares o.N.	0,14
JP3973400009	Ricoh Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,14
JP3799000009	Hirose Electric Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,14
JP3336560002	Suntory Beverage & Food Ltd. Registered Shares o.N.	0,14
JP3414750004	Seiko Epson Corp. Registered Shares o.N.	0,13
JP3758190007	Nexon Co. Ltd Registered Shares o.N.	0,13
JP3551520004	Dentsu Group Inc. Registered Shares o.N.	0,13
JP3918000005	Meiji Holdings Co.Ltd. Registered Shares o.N.	0,13
JP3399310006	Zozo Inc. Registered Shares o.N.	0,12
JP3305990008	Concordia Financial Group Ltd. Registered Shares o.N.	0,12
JP3845770001	Hoshizaki Corp. Registered Shares o.N.	0,12
JP3931600005	Yakult Honsha Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,12
JP3830000000	Brother Industries Ltd. Registered Shares o.N.	0,12
JP3322930003	Sumco Corp. Registered Shares o.N.	0,12
JP3762900003	Nomura Real Estate Hldgs Inc. Registered Shares o.N.	0,12
JP3188200004	Otsuka Corp. Registered Shares o.N.	0,12
JP3635000007	Toyota Tsusho Corp. Registered Shares o.N.	0,11
JP3596200000	Toto Ltd. Registered Shares o.N.	0,11
JP3385980002	JSR Corp. Registered Shares o.N.	0,11
JP3362700001	Mitsui O.S.K. Lines Ltd. Registered Shares o.N.	0,11
JP3351500008	Shizuoka Financial Group Inc. Registered Shares o.N.	0,10
JP3429300001	Zensho Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,10
JP3922950005	MonotaRO Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,10
JP3381000003	Nippon Steel Corp. Registered Shares o.N.	0,10
JP3511800009	Chiba Bank Ltd., The Registered Shares o.N.	0,10
JP3634600005	Toyota Industries Corp. Registered Shares o.N.	0,09
JP3942600002	Yamaha Corp. Registered Shares o.N.	0,09
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Registered Shares o.N.	0,09
JP3233250004	Japan Post Insurance Co.Ltd Registered Shares o.N.	0,09
JP3750500005	McDonald s Hldg Co.(Jap.) Ltd. Registered Shares o.N.	0,09
JP3598600009	Toho Co. Ltd. (9602) Registered Shares o.N.	0,09
JP3283650004	KOSE Corp. Registered Shares o.N.	0,09
JP3783420007	Hikari Tsushin Inc. Registered Shares o.N.	0,08
JP3173540000	Open House Group Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,08
JP3407400005	Sumitomo Electric Ind. Ltd. Registered Shares o.N.	0,08
JP3164630000	Square Enix Hldgs Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,08
JP3131090007	IIDA Group Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,07
JP3400400002	SCSK Corp. Registered Shares o.N.	0,07
JP3689500001	Oracle Corp. Japan Registered Shares o.N.	0,07
JP3429800000	ANA Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,07
JP3835250006	BayCurrent Consulting Inc. Registered Shares o.N.	0,07
JP3111200006	Asahi Kasei Corp. Registered Shares o.N.	0,07

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,06
JP3705200008	Japan Airlines Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,06
JP3359600008	Sharp Corp. Registered Shares o.N.	0,06
JP3688370000	Nippon Express Holdings Inc. Registered Shares o.N.	0,05
JP3397200001	Suzuki Motor Corp. Registered Shares o.N.	0,05
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Group Corp Registered Shares o.N.	0,04
JP3112000009	AGC Inc. Registered Shares o.N.	0,04
JP3621000003	Toray Industries Inc. Registered Shares o.N.	0,04
JP3223800008	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. Registered Shares o.N.	0,03
JP3283460008	Koei Tecmo Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,03
JP3814800003	Subaru Corp. Registered Shares o.N.	0,03
JP3888300005	Mitsui Chemicals Inc. Registered Shares o.N.	0,03
JP3672400003	Nissan Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,02
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,02
JP3711600001	Nippon Sanso Holdings Corp. Registered Shares o.N.	0,02
JP3137200006	Isuzu Motors Ltd. Registered Shares o.N.	0,02
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	0,02
JP3174410005	Oji Holdings Corp. Registered Shares o.N.	0,02
JP3868400007	Mazda Motor Corp. Registered Shares o.N.	0,02
JP3595200001	Tosoh Corp. Registered Shares o.N.	0,02

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Januar 2024.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		116.775.574,82	100,02
1. Aktien		116.235.339,25	99,56
- Banken	7.711.479,91		6,61
- Bau und Baustoffe	4.425.412,47		3,79
- Bergbau	355.198,87		0,30
- Büroausstattung	3.651.438,83		3,13
- Chemische Industrie	3.045.731,27		2,61
- Einzelhandel	12.996.329,57		11,13
- Elektrik / Elektronik	14.863.296,11		12,73
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	19.642.050,77		16,82
- Papier und andere Basisprodukte	21.135,06		0,02
- Pharmaindustrie / Biotech	14.012.370,05		12,00
- Real Estate	4.535.255,11		3,88
- Software	1.100.567,68		0,94
- Sonstige Dienstleistungen	3.155.729,92		2,70
- Sonstige Finanzdienstleistungen	3.092.532,43		2,65
- Sonstige industrielle Werte	307.417,18		0,26
- Telekommunikation	4.782.850,96		4,10
- Transportation	10.177.624,63		8,72
- Unterhaltungsindustrie	1.333.273,92		1,14
- Verbrauchsgüter	3.230.192,10		2,77
- Versicherungen	3.795.452,41		3,25
2. Forderungen		108.808,82	0,09
3. Bankguthaben		431.426,75	0,37
II. Verbindlichkeiten		-23.944,45	-0,02
III. Fondsvermögen		116.751.630,37	100,00

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

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteil bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Ausland									
JP3122400009	Advantest Corp.	STK	37.800	37.800	31.800	3.700	JPY 5.823,000	1.386.231,24	1,19
JP3388200002	Aeon Co. Ltd.	STK	26.800	26.800	1.300	8.200	JPY 3.533,000	596.314,71	0,51
JP3112000009	AGC Inc.	STK	1.300	1.300	400	5.600	JPY 5.566,000	45.570,48	0,04
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc.	STK	16.300	16.300	4.100	4.000	JPY 6.087,000	624.867,59	0,54
JP3429800000	ANA Holdings Inc.	STK	4.100	4.100	200	1.300	JPY 3.270,000	84.436,20	0,07
JP3116000005	Asahi Group Holdings Ltd.	STK	13.700	13.700	1.200	3.600	JPY 5.510,000	475.411,03	0,41
JP3110650003	Asahi Intecc Co. Ltd.	STK	10.500	10.500	2.000	2.400	JPY 2.831,500	187.241,86	0,16
JP3112000006	Asahi Kasei Corp.	STK	11.800	11.800	500	47.600	JPY 1.122,500	83.419,09	0,07
JP3942400007	Astellas Pharma Inc.	STK	90.800	90.800	16.500	21.600	JPY 1.725,000	986.443,10	0,84
JP3937200008	Azbil Corp.	STK	17.300	17.300	3.200	3.900	JPY 4.812,000	524.286,67	0,45
JP3778630008	BANDAI NAMCO Holdings Inc.	STK	28.800	28.800	28.800	0	JPY 3.215,000	583.136,94	0,50
JP3835250006	BayCurrent Consulting Inc.	STK	3.800	3.800	4.800	1.000	JPY 3.466,000	82.948,64	0,07
JP3830800003	Bridgestone Corp.	STK	16.200	16.200	800	4.900	JPY 6.444,000	657.457,43	0,56
JP3830000000	Brother Industries Ltd.	STK	9.100	9.100	500	3.000	JPY 2.484,000	142.360,69	0,12
JP3242800005	Canon Inc.	STK	38.900	38.900	1.800	11.700	JPY 4.080,000	999.555,37	0,86
JP3218900003	Capcom Co. Ltd.	STK	5.000	5.000	300	2.200	JPY 5.645,000	177.758,77	0,15
JP3568000003	Central Japan Railway Co.	STK	111.600	111.600	98.400	10.100	JPY 3.693,000	2.595.616,90	2,22
JP3511800009	Chiba Bank Ltd., The	STK	16.200	16.200	900	7.000	JPY 1.100,000	112.228,92	0,10
JP3519400000	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	STK	33.700	33.700	6.300	7.700	JPY 5.347,000	1.134.846,64	0,97
JP3305990008	Concordia Financial Group Ltd.	STK	32.300	32.300	1.300	14.700	JPY 707,700	143.962,31	0,12
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co. Ltd.	STK	7.900	7.900	300	3.200	JPY 4.292,000	213.542,29	0,18
JP3497400006	Daifuku Co. Ltd.	STK	12.200	12.200	10.000	2.900	JPY 2.938,500	225.778,52	0,19
JP3476480003	Dai-ichi Life Holdings Inc.	STK	28.700	28.700	1.100	13.600	JPY 3.261,000	589.426,68	0,50
JP3475350009	Daiichi Sankyo Co. Ltd.	STK	92.400	92.400	21.500	20.300	JPY 4.423,000	2.573.866,41	2,20
JP3481800005	Daikin Industries Ltd.	STK	10.300	10.300	800	2.600	JPY 23.885,000	1.549.385,76	1,33
JP3486800000	Daito Trust Constr. Co. Ltd.	STK	2.600	2.600	100	700	JPY 16.825,000	275.502,48	0,24
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd.	STK	24.400	24.400	1.100	7.700	JPY 4.584,000	704.419,75	0,60
JP3046390005	Daiwa House REIT Investm. Corp.	STK	109	109	24	23	JPY 260.700,000	178.963,56	0,15
JP3502200003	Daiwa Securities Group Inc.	STK	40.400	40.400	2.300	17.600	JPY 1.064,000	270.719,84	0,23
JP3551500006	Denso Corp.	STK	17.900	17.900	27.400	16.700	JPY 2.341,000	263.907,38	0,23
JP3551520004	Dentsu Group Inc.	STK	6.000	6.000	300	3.200	JPY 3.932,000	148.580,51	0,13
JP3548600000	Disco Corp.	STK	4.400	4.400	3.700	700	JPY 40.380,000	1.189.963,92	0,96
JP3783600004	East Japan Railway Co.	STK	46.800	46.800	8.700	10.700	JPY 8.441,000	2.487.922,48	2,13
JP3160400002	Eisai Co. Ltd.	STK	12.600	12.600	2.300	2.900	JPY 6.998,000	555.317,77	0,48
JP3802400006	Fanuc Corp.	STK	46.000	46.000	43.900	7.500	JPY 4.117,000	1.192.712,55	1,02
JP3802300008	Fast Retailing Co. Ltd.	STK	8.800	8.800	7.200	1.500	JPY 39.740,000	2.202.457,95	1,89
JP3820000002	Fuji Electric Co. Ltd.	STK	14.600	14.600	800	5.100	JPY 7.459,000	685.852,23	0,59
JP3814000000	Fujifilm Holdings Corp.	STK	14.600	14.600	800	3.900	JPY 9.410,000	865.245,94	0,74
JP3818000006	Fujitsu Ltd.	STK	5.200	5.200	200	3.300	JPY 20.840,000	682.492,92	0,58
JP3047510007	GLP J-REIT	STK	241	241	63	51	JPY 131.700,000	199.894,07	0,17
JP3771800004	Hamamatsu Photonics K.K.	STK	7.200	7.200	1.400	1.500	JPY 5.874,000	266.356,64	0,23
JP3774200004	Hankyu Hanshin Holdings Inc.	STK	11.400	11.400	2.000	2.500	JPY 4.529,000	325.165,35	0,28
JP3783420007	Hikari Tsushin Inc.	STK	600	600	0	500	JPY 25.860,000	97.718,52	0,08
JP3799000009	Hirose Electric Co. Ltd.	STK	1.500	1.500	400	400	JPY 17.260,000	163.053,13	0,14
JP3787000003	Hitachi Constr. Mach. Co. Ltd.	STK	1.000	1.000	100	4.300	JPY 4.234,000	26.665,39	0,02
JP3788600009	Hitachi Ltd.	STK	73.000	73.000	45.900	13.600	JPY 11.675,000	5.367.559,17	4,60
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd.	STK	44.200	44.200	31.700	16.500	JPY 1.675,500	466.405,64	0,40
JP3845770001	Hoshizaki Corp.	STK	4.200	4.200	100	1.200	JPY 5.394,000	142.678,10	0,12
JP3837800006	Hoya Corp.	STK	17.000	17.000	3.000	4.000	JPY 18.945,000	2.028.339,38	1,74
JP3360800001	Hulic Co. Ltd.	STK	19.000	19.000	3.500	4.300	JPY 1.638,000	196.003,84	0,17
JP3148800000	Ibiden Co. Ltd.	STK	4.200	4.200	200	1.300	JPY 7.544,000	199.548,31	0,17
JP3131090007	IIDA Group Holdings Co. Ltd.	STK	6.100	6.100	7.000	900	JPY 2.243,000	86.170,02	0,07
JP3137200006	Isuzu Motors Ltd.	STK	1.800	1.800	100	7.300	JPY 2.032,500	23.040,94	0,02
JP3705200008	Japan Airlines Co. Ltd.	STK	3.700	3.700	4.200	500	JPY 2.843,500	66.260,09	0,06
JP3183200009	Japan Exchange Group Inc.	STK	15.200	15.200	900	6.600	JPY 3.284,000	314.371,98	0,27
JP3039710003	Japan Metropolitan Fund Invest	STK	340	340	59	78	JPY 100.200,000	214.557,51	0,18
JP3946750001	Japan Post Bank Co.Ltd	STK	44.100	44.100	41.800	15.000	JPY 1.535,500	426.467,07	0,37
JP3752900005	Japan Post Holdings Co.Ltd	STK	63.100	63.100	2.700	39.000	JPY 1.416,000	562.716,57	0,48
JP3233250004	Japan Post Insurance Co.Ltd	STK	5.800	5.800	300	2.900	JPY 2.774,000	101.328,48	0,09
JP3027680002	Japan Real Estate Inv. Corp.	STK	64	64	13	13	JPY 566.000,000	228.135,83	0,20
JP3385980002	JSR Corp.	STK	4.900	4.900	1.800	3.200	JPY 4.035,000	124.519,31	0,11
JP3210200006	Kajima Corp.	STK	17.400	17.400	800	5.200	JPY 2.644,000	289.739,56	0,25
JP3205800000	Kao Corp.	STK	18.000	18.000	800	5.800	JPY 5.863,000	664.644,61	0,57
JP3223800008	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	STK	900	900	3.700	2.800	JPY 7.201,000	40.816,19	0,03
JP3496400007	KDDI Corp.	STK	44.500	44.500	1.700	23.600	JPY 4.897,000	1.372.420,53	1,18
JP3046270009	KDX Realty Investment Corp.	STK	206	206	206	0	JPY 160.200,000	207.838,89	0,18
JP3278600006	Keisei Electric Railway Co.Ltd	STK	18.700	18.700	4.500	4.300	JPY 6.698,000	788.830,77	0,68
JP3236200006	Keyence Corp.	STK	9.500	9.500	1.900	2.300	JPY 66.580,000	3.983.496,93	3,41
JP3240400006	Kikkoman Corp.	STK	5.200	5.200	200	2.100	JPY 9.141,000	299.360,26	0,26
JP3260800002	Kintetsu Group Holdings Co.Ltd	STK	27.000	27.000	7.000	6.300	JPY 4.560,000	775.399,82	0,66
JP3185800003	Kirin Holdings Co. Ltd.	STK	28.700	28.700	1.400	10.700	JPY 2.123,000	383.732,85	0,33
JP3291200008	Kobe Bussan Co. Ltd.	STK	7.400	7.400	1.300	1.600	JPY 3.770,000	175.699,35	0,15
JP3283460008	Koei Tecmo Holdings Co. Ltd.	STK	3.400	3.400	200	1.400	JPY 1.844,000	39.485,43	0,03
JP3284600008	Koito Mfg. Co. Ltd.	STK	22.600	22.600	27.200	4.600	JPY 2.277,000	324.092,19	0,28
JP3304200003	Komatsu Ltd.	STK	36.800	36.800	2.000	10.800	JPY 4.245,000	983.835,76	0,84
JP3300200007	Konami Holdings Corp.	STK	2.900	2.900	400	1.200	JPY 9.126,000	166.676,95	0,14
JP3283650004	KOSE Corp.	STK	1.600	1.600	300	400	JPY 9.699,000	97.733,63	0,08
JP3266400005	Kubota Corp.	STK	39.100	39.100	1.500	12.200	JPY 2.252,500	554.675,07	0,48

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
JP3249600002	Kyocera Corp.	STK		49.600	37.700	4.000	JPY 2.182,500	681.762,36	0,58
JP3256000005	Kyowa Kirin Co. Ltd.	STK		13.600	2.500	3.000	JPY 2.333,500	199.868,25	0,17
JP3862400003	Makita Corp.	STK		8.700	500	2.600	JPY 4.007,000	219.551,13	0,19
JP3869010003	MatsukiyoCocokara & Co.	STK		16.900	18.200	1.300	JPY 2.692,500	286.575,80	0,25
JP3868400007	Mazda Motor Corp.	STK		1.800	100	7.000	JPY 1.821,500	20.648,99	0,02
JP3750500005	McDonald s Hldg Co.(Jap.) Ltd.	STK		2.500	100	1.000	JPY 6.560,000	103.285,88	0,09
JP3918000005	Meiji Holdings Co.Ltd.	STK		6.600	4.200	1.500	JPY 3.571,000	148.433,14	0,13
JP3906000009	Minebea Mitsumi Inc.	STK		14.200	700	4.200	JPY 3.090,000	276.340,10	0,24
JP3885400006	Misumi Group Inc.	STK		11.300	500	3.400	JPY 2.570,000	182.897,87	0,16
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Hldgs Corp	STK		8.700	400	35.600	JPY 894,900	49.033,27	0,04
JP3902400005	Mitsubishi Electric Corp.	STK		14.400	800	34.600	JPY 2.203,000	199.790,15	0,17
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co. Ltd.	STK		56.000	10.200	15.000	JPY 2.062,500	727.409,68	0,62
JP3499800005	Mitsubishi HC Capital Inc.	STK		24.600	9.600	12.400	JPY 1.051,000	162.830,18	0,14
JP3902900004	Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc.	STK		348.300	13.600	167.600	JPY 1.395,000	3.060.023,58	2,62
JP3888300005	Mitsui Chemicals Inc.	STK		1.200	0	5.100	JPY 4.374,000	33.056,52	0,03
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co. Ltd.	STK		45.900	7.800	10.600	JPY 3.728,000	1.077.669,72	0,92
JP3362700001	Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	STK		3.700	100	1.100	JPY 5.310,000	123.735,22	0,11
JP3885780001	Mizuho Financial Group Inc.	STK		73.600	4.300	32.100	JPY 2.702,000	1.252.449,58	1,07
JP3922950005	MonotaRO Co. Ltd.	STK		12.800	2.600	3.000	JPY 1.400,500	112.899,02	0,10
JP3890310000	MS&AD Insurance Grp Hldgs Inc.	STK		13.100	500	6.100	JPY 6.148,000	507.226,86	0,43
JP3914400001	Murata Manufacturing Co. Ltd.	STK		82.300	63.200	9.400	JPY 3.015,000	1.562.731,05	1,34
JP3733000008	NEC Corp.	STK		7.400	300	3.100	JPY 9.700,000	452.064,65	0,39
JP3758190007	Nexon Co. Ltd	STK		10.200	400	9.500	JPY 2.365,000	151.924,71	0,13
JP3734800000	Nidec Corp.	STK		16.400	700	6.300	JPY 5.542,000	572.410,33	0,49
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd.	STK		29.700	1.200	14.900	JPY 8.310,000	1.554.370,57	1,33
JP3027670003	Nippon Building Fund Inc.	STK		74	14	16	JPY 597.000,000	278.229,48	0,24
JP3688370000	Nippon Express Holdings Inc.	STK		1.000	100	500	JPY 8.801,000	55.427,99	0,05
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co. Ltd.	STK		35.400	5.300	9.100	JPY 1.168,500	260.512,80	0,22
JP3047550003	Nippon Prologis REIT Inc.	STK		112	25	24	JPY 262.600,000	185.229,36	0,16
JP3711600001	Nippon Sanso Holdings Corp.	STK		1.100	100	4.600	JPY 3.770,000	26.117,47	0,02
JP3381000003	Nippon Steel Corp.	STK		5.000	5.500	500	JPY 3.570,000	112.417,86	0,10
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp.	STK		893.700	1.031.400	186.700	JPY 1.866,300	1.048.580,32	0,90
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line)	STK		3.300	200	13.300	JPY 5.098,000	105.952,42	0,09
JP3670800006	Nissan Chemical Corp.	STK		4.700	200	1.600	JPY 5.922,000	175.292,51	0,15
JP3672400003	Nissan Motor Co. Ltd.	STK		7.600	32.600	25.000	JPY 588,400	28.163,29	0,02
JP3675600005	Nissin Foods Holdings Co. Ltd.	STK		7.500	5.300	700	JPY 4.779,000	225.733,17	0,19
JP3756100008	Nitori Holdings Co. Ltd.	STK		4.000	800	900	JPY 19.265,000	485.317,66	0,42
JP3684000007	Nitto Denko Corp.	STK		5.600	400	1.700	JPY 12.310,000	434.153,36	0,37
JP3762600009	Nomura Holdings Inc.	STK		91.200	5.200	35.600	JPY 769,200	441.805,59	0,38
JP3762900003	Nomura Real Estate Hldgs Inc.	STK		5.400	900	1.600	JPY 4.062,000	138.143,60	0,12
JP3048110005	Nomura Real Estate Mast.Fd Inc	STK		209	36	47	JPY 161.400,000	212.445,19	0,18
JP3762800005	Nomura Research Institute Ltd.	STK		11.800	2.600	4.900	JPY 4.533,000	336.871,92	0,29
JP3165700000	NTT Data Corp.	STK		19.100	1.100	8.400	JPY 2.140,500	257.481,30	0,22
JP3190000004	Obayashi Corp.	STK		26.900	1.300	8.200	JPY 1.369,500	232.012,51	0,20
JP3173400007	Obic Co. Ltd.	STK		2.100	200	1.000	JPY 22.735,000	300.684,71	0,26
JP3196000008	Odakyu Electric Railway Co.Ltd	STK		44.400	10.100	9.700	JPY 2.260,500	632.098,23	0,54
JP3174410005	Oji Holdings Corp.	STK		5.800	1.200	23.200	JPY 578,600	21.135,06	0,02
JP3201200007	Olympus Corp.	STK		49.100	12.900	26.200	JPY 2.200,000	680.301,24	0,58
JP3197800000	Omron Corp.	STK		24.300	4.500	7.400	JPY 6.710,000	1.026.894,63	0,88
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd.	STK		19.500	4.800	4.200	JPY 2.672,000	328.146,79	0,28
JP3173540000	Open House Group Co. Ltd.	STK		3.200	200	1.000	JPY 4.646,000	93.632,43	0,08
JP3689500001	Oracle Corp. Japan	STK		1.200	100	500	JPY 11.670,000	88.196,06	0,08
JP3198900007	Oriental Land Co. Ltd.	STK		31.300	34.400	11.000	JPY 5.502,000	1.084.581,06	0,93
JP3200450009	ORIX Corp.	STK		95.800	3.700	39.600	JPY 2.868,500	1.730.682,71	1,48
JP3188200004	Otsuka Corp.	STK		3.500	100	1.300	JPY 6.234,000	137.414,30	0,12
JP3188220002	Otsuka Holdings Company Ltd.	STK		17.100	1.900	5.000	JPY 5.824,000	627.212,30	0,54
JP3639650005	Pan Pacific Intl Hldgs Corp.	STK		18.800	3.600	4.200	JPY 3.207,000	379.711,63	0,33
JP3866800000	Panasonic Corp.	STK		85.900	4.000	25.700	JPY 1.408,500	761.986,20	0,65
JP3967200001	Rakuten Group Inc.	STK		75.600	41.600	11.900	JPY 650,500	309.717,82	0,27
JP3970300004	Recruit Holdings Co. Ltd.	STK		43.000	2.400	18.600	JPY 5.927,000	1.605.094,01	1,37
JP3164720009	Renesas Electronics Corp.	STK		55.300	12.300	12.500	JPY 2.472,000	860.935,64	0,74
JP3500610005	Resona Holdings Inc.	STK		64.800	3.000	28.900	JPY 819,900	334.605,43	0,29
JP3973400009	Ricoh Co. Ltd.	STK		21.800	1.000	7.700	JPY 1.168,000	160.360,14	0,14
JP3982800009	Rohm Co. Ltd.	STK		12.800	11.000	2.400	JPY 2.579,500	207.942,18	0,18
JP3436120004	SBI Holdings Inc.	STK		7.500	400	3.200	JPY 3.644,000	172.122,13	0,15
JP3400400002	SCSK Corp.	STK		4.700	300	2.100	JPY 2.906,000	86.018,24	0,07
JP3421800008	Secom Co. Ltd.	STK		6.200	300	2.700	JPY 10.720,000	418.584,91	0,36
JP3414750004	Seiko Epson Corp.	STK		11.400	500	2.900	JPY 2.166,500	155.546,64	0,13
JP3419400001	Sekisui Chemical Co. Ltd.	STK		14.800	1.300	4.400	JPY 2.117,000	197.323,89	0,17
JP3420600003	Sekisui House Ltd.	STK		24.100	1.100	8.100	JPY 3.347,000	508.007,17	0,44
JP3162770006	SG Holdings Co. Ltd.	STK		16.000	4.400	3.400	JPY 1.914,500	192.917,86	0,17
JP3359600008	Sharp Corp.	STK		10.200	1.600	2.700	JPY 997,000	64.046,06	0,05
JP3357200009	Shimadzu Corp.	STK		9.500	400	2.900	JPY 4.109,000	245.842,43	0,21
JP3358000002	Shimano Inc.	STK		3.700	800	700	JPY 21.355,000	497.620,65	0,43
JP3358800005	Shimizu Corp.	STK		57.700	2.300	21.700	JPY 989,500	359.574,35	0,31
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	STK		51.300	50.400	12.100	JPY 5.875,000	1.898.114,15	1,63
JP3347200002	Shionogi & Co. Ltd.	STK		12.900	2.300	3.100	JPY 7.110,000	577.638,86	0,49
JP3351600006	Shiseido Co. Ltd.	STK		19.500	3.600	4.400	JPY 4.130,000	507.202,93	0,43
JP3351500008	Shizuoka Financial Group Inc.	STK		14.300	900	5.400	JPY 1.354,500	121.986,60	0,10
JP3162600005	SMC Corp.	STK		2.700	600	700	JPY 82.910,000	1.409.833,32	1,21
JP3436100006	SoftBank Group Corp.	STK		31.000	1.200	20.200	JPY 6.460,000	1.261.221,32	1,08

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
JP3165000005	Sompo Holdings Inc.	STK		9,000	400	4,500	JPY 7,691,000	435.935,68	0,37
JP3435000009	Sony Group Corp.	STK		61,300	11,300	13,800	JPY 14,695,000	5.673.187,74	4,86
JP3164630000	Square Enix Hldgs Co. Ltd.	STK		2,400	100	1,100	JPY 5,783,000	87.410,08	0,07
JP3814800003	Subaru Corp.	STK		2,000	2,200	200	JPY 2,991,000	37.674,15	0,03
JP3322930003	Sumco Corp.	STK		9,900	500	3,000	JPY 2,256,000	140.660,25	0,12
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co. Ltd.	STK		10,000	500	43,200	JPY 349,400	22.004,93	0,02
JP3407400005	Sumitomo Electric Ind. Ltd.	STK		7,500	300	30,800	JPY 1,976,000	93.335,16	0,08
JP3402600005	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd.	STK		9,400	500	2,700	JPY 4,101,000	242.781,01	0,21
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group	STK		38,700	2,200	18,300	JPY 7,700,000	1.876.716,97	1,61
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Hldg.Inc	STK		20,000	10,400	4,600	JPY 3,041,000	383.039,45	0,33
JP3409000001	Sumitomo Realty & Dev. Co.Ltd.	STK		14,100	2,600	4,200	JPY 4,676,000	415.231,90	0,36
JP3336560002	Suntory Beverage & Food Ltd.	STK		5,200	200	1,500	JPY 4,832,000	158.244,04	0,14
JP3397200001	Suzuki Motor Corp.	STK		1,300	1,400	100	JPY 6,688,000	54.756,63	0,05
JP3351100007	Sysmex Corp.	STK		8,300	1,600	1,900	JPY 8,008,000	418.600,02	0,36
JP3539220008	T & D Holdings Inc.	STK		15,300	600	7,600	JPY 2,465,000	237.522,88	0,20
JP3443600006	Taisei Corp.	STK		6,800	300	2,600	JPY 5,385,000	230.617,21	0,20
JP3463000004	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	STK		79,200	18,300	17,400	JPY 4,362,000	2.175.744,70	1,86
JP3538800008	TDK Corp.	STK		16,200	900	4,800	JPY 7,442,000	759.279,67	0,65
JP3546800008	Terumo Corp.	STK		26,900	6,400	12,400	JPY 5,031,000	852.321,98	0,73
JP3104890003	TIS Inc.	STK		18,700	700	8,400	JPY 3,304,000	389.115,68	0,33
JP3597800006	Tobu Railway Co. Ltd.	STK		9,600	1,800	2,100	JPY 3,919,000	236.942,84	0,20
JP3598600009	Toho Co. Ltd. (9602)	STK		3,300	200	1,500	JPY 4,817,000	100.112,35	0,09
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc.	STK		55,000	2,200	24,300	JPY 3,930,000	1.361.295,26	1,17
JP3571400005	Tokyo Electron Ltd.	STK		18,400	15,300	4,300	JPY 27,865,000	3.229.043,99	2,77
JP3574200006	Tokyu Corp.	STK		25,800	3,300	50,700	JPY 1,732,500	281.507,55	0,24
JP3629000005	Toppan Printing Co. Ltd.	STK		9,300	400	3,800	JPY 4,089,000	239.495,39	0,21
JP3621000003	Toray Industries Inc.	STK		9,600	400	39,100	JPY 740,500	44.770,65	0,04
JP3595200001	Tosoh Corp.	STK		1,600	0	6,500	JPY 1,911,000	19.256,52	0,02
JP3596200000	Toto Ltd.	STK		5,100	200	2,000	JPY 4,015,000	128.959,34	0,11
JP3634600005	Toyota Industries Corp.	STK		1,400	100	5,500	JPY 12,585,000	110.963,04	0,10
JP3633400001	Toyota Motor Corp.	STK		37,600	1,700	148,200	JPY 3,000,000	710.405,30	0,61
JP3635000007	Toyota Tsusho Corp.	STK		2,100	100	8,700	JPY 9,786,000	129.426,02	0,11
JP3637300009	Trend Micro Inc.	STK		3,800	100	1,600	JPY 8,504,000	203.518,52	0,17
JP3951600000	Unicharm Corp.	STK		18,100	3,100	4,100	JPY 5,088,000	579.993,02	0,50
JP3944130008	USC Co. Ltd.	STK		29,000	5,100	6,500	JPY 2,800,500	511.482,37	0,44
JP3659000008	West Japan Railway Co.	STK		31,300	5,600	7,400	JPY 6,150,000	1.212.317,97	1,04
JP3931600005	Yakult Honsha Co. Ltd.	STK		7,000	3,800	1,200	JPY 3,230,000	142.395,96	0,12
JP3942600002	Yamaha Corp.	STK		5,200	200	2,000	JPY 3,266,000	106.958,82	0,09
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd.	STK		8,400	5,700	11,400	JPY 1,407,000	74.433,85	0,06
JP3940000007	Yamato Holdings Co. Ltd.	STK		10,700	500	4,200	JPY 2,556,500	172.276,75	0,15
JP3932000007	Yaskawa Electric Corp.	STK		27,500	1,400	8,300	JPY 5,627,000	974.555,78	0,83
JP3955000009	Yokogawa Electric Corp.	STK		27,000	1,200	8,100	JPY 2,924,000	497.208,13	0,43
JP3933800009	Z Holdings Corp.	STK		79,500	4,500	34,500	JPY 462,000	231.316,28	0,20
JP3429300001	Zensho Holdings Co. Ltd.	STK		2,600	2,800	200	JPY 7,247,000	118.666,65	0,10
JP3399310006	Zozo Inc.	STK		7,100	2,100	1,500	JPY 3,253,000	145.458,63	0,12
Summe Wertpapiervermögen							EUR	116.235.339,25	99,56
							EUR	116.235.339,25	99,56
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	431.426,75	0,37
EUR-Guthaben bei:									
DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR		430.878,50			% 100,000	430.878,50	0,37
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY		87.052,70			% 100,000	548,25	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	108.808,82	0,09
Dividendenansprüche		EUR		108.411,42				108.411,42	0,09
Sonstige Forderungen		EUR		397,40				397,40	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-23.944,45	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR		-23.944,45				-23.944,45	-0,02
Fondsvermögen							EUR	116.751.630,37	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	8,96	
Umlaufende Anteile							STK	13.030.054,00	

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.01.2024

Devisenkurse (in Mengennotiz)

31.01.2024

Japanische Yen

(JPY)

158,78260 = 1 Euro (EUR)

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
 - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Ausland					
JP3102000001	Aisin Corp.	STK	100	7.200	
JP3311400000	Cyberagent Inc.	STK	800	18.100	
JP3385890003	GMO Payment Gateway Inc.	STK	0	1.700	
JP3766550002	Hakuhodo DY Holdings Inc.	STK	200	9.800	
JP3143000002	Ito En Ltd.	STK	0	2.500	
JP3143900003	Itochu Techno-Solutions Corp.	STK	0	4.000	
JP3206000006	Kakaku.com Inc.	STK	0	5.400	
JP3277800003	Keio Corp.	STK	900	6.400	
JP3301100008	Kobayashi Pharmaceut. Co. Ltd.	STK	400	3.100	
JP3270000007	Kurita Water Industries Ltd.	STK	100	5.200	
JP3626800001	LIXIL Corp.	STK	500	15.300	
JP3435750009	M3 Inc.	STK	0	18.100	
JP3695200000	NGK Insulators Ltd.	STK	400	11.800	
JP3689050007	Nihon M&A Center Inc.	STK	0	12.600	
JP3717600005	Nippon Shinyaku Co. Ltd.	STK	200	2.700	
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc.	STK	0	6.900	
JP3547670004	Persol Holdings Co. Ltd.	STK	55.200	62.600	
JP3592200004	Toshiba Corp.	STK	100	15.700	
JP3274280001	Welcia Holdings Co. Ltd.	STK	100	4.900	

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

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

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		2.209.939,63	0,170
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		18.216,87	0,001
3. Abzug ausländischer Quellensteuer		-338.370,67	-0,026
4. Sonstige Erträge		103,67	0,000
davon: Sonstiges	103,67		0,000
Summe der Erträge		1.889.889,50	0,145
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-953,08	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-274.875,24	-0,021
3. Sonstige Aufwendungen		-69,29	0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-32,37		0,000
davon: Sonstiges	-36,92		0,000
Summe der Aufwendungen		-275.897,61	-0,021
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.613.991,89	0,124
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		5.435.586,84	0,417
2. Realisierte Verluste		-7.949.577,14	-0,610
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-2.513.990,30	-0,193
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-899.998,41	-0,069
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		17.511.961,31	1,344
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-2.486.709,45	-0,191
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		15.025.251,86	1,153
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		14.125.253,45	1,084
Entwicklung des Sondervermögens		2023 / 2024	
	EUR	EUR	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		127.709.226,27	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00	
2. Zwischenausschüttungen		-1.891.207,56	
3. Mittelzufluss (netto)		-23.071.363,80	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	4.191.028,50		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-27.262.392,30		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-120.277,99	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		14.125.253,45	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	17.511.961,31		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-2.486.709,45		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		116.751.630,37	
Verwendung der Erträge des Sondervermögens			
	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		13.015.222,58	0,999
1. Vortrag aus dem Vorjahr		13.915.220,99	1,068
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-899.998,41	-0,069
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		10.863.413,94	0,834
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		10.863.413,94	0,834
III. Gesamtausschüttung		2.151.808,64	0,165
1. Zwischenausschüttung		1.891.207,56	0,145
2. Endausschüttung		260.601,08	0,020

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

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre Geschäftsjahr

	Sondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2023/2024	116.751.630,37	8,96
2022/2023	127.709.226,27	8,04
2021/2022	138.689.650,29	8,61
2020/2021	321.304.067,35	1.103,90

Deka MSCI Japan 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	8,96
Umlaufende Anteile	STK	13.030.054,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,56

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.01.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.01.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

Gesamtkostenquote (in %)

0,25

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

Transaktionskosten

EUR

3.402,28

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Erfolgt die Abwicklung von Zeichnungen bzw. Rücknahmen von Anteilscheinen mit den sog. Market Makern nicht über die Bereitstellung bzw. Abnahme der betreffenden Wertpapiere, sondern über Bankguthaben, werden die Transaktionskosten, die dadurch entstehen, dass die Deka Investment die Wertpapiere über andere Broker beschafft bzw. veräußert, durch den Marker Maker ersetzt und dem Sondervermögen gutgeschrieben. Die oben genannten Transaktionskosten reduzieren sich deshalb um folgenden Betrag:

EUR

4.076,20

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,16
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,51

Der im Geschäftsjahr 2023/2024 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Erträgen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Erträgen sind Korrekturen Zinsen in Höhe von EUR 118,05 enthalten.

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -35,25 enthalten.

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

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

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

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

Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken:

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

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten:

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

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

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

Einsatz von Stimmrechtsberatern:

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern informieren der Mitwirkungsbericht sowie der Stewardship Code der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Dokumente stehen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.

Handhabung der Wertpapierleihe und Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten:

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

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka Investment GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme. Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung“ (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft.

Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeitenden und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlageerfolgsprämien, werden bei der Deka Investment GmbH nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 10 KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Deka Investment GmbH bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeitenden werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeitenden erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

Die variable Vergütung der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und von Mitarbeitenden, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitenden (zusammen als „risikorelevante Mitarbeitende“) unterliegt folgenden Regelungen:

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

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2023 fand im Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2023 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

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

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

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

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900CIKTQJ53E2NG85

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

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

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

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

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

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



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

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

Der Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF ist ein passiv gemanagter börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF), der den MSCI Japan Climate Change ESG Select (Preisindex) nachbildet. Der zugrundeliegende Index umfasst Aktien von großen und mittelgroßen japanischen Unternehmen und berücksichtigte im Berichtszeitraum ökologische (Environment – „E“), soziale (Social – „S“) und die verantwortungsvolle Unternehmens- bzw. Staatsführung (Governance – „G“) betreffende Kriterien (sog. ESG-Kriterien). Diese zielten darauf ab

- die gewichtete CO2-Intensität des Portfolios gegenüber der eines breiten Marktindex signifikant zu reduzieren. Dazu wurden Unternehmen, die dazu beitragen, dass CO2-Emissionen reduziert werden und über ein zukunftsfähiges Geschäftsmodell verfügen, hoch gewichtet. Gleichzeitig wurden Unternehmen, die bislang nicht zu einer Verringerung des CO2-Ausstoßes beitragen, stark untergewichtet. Diese Umgewichtung der Indextitel wurde anhand des sogenannten LCT Scores

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

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

- in Unternehmen zu investieren, die verantwortungsvolle Geschäftspraktiken anwenden und keine Umsätze bzw. nur einen geringen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschaften. Hierzu wurde das Anlageuniversum des zugrundeliegenden Index durch verbindliche Ausschlusskriterien eingegrenzt.

Nicht investiert wurde in Unternehmen,

- die Nuklearsprengköpfe und/oder ganze Atomraketen herstellten.
- die Komponenten herstellten, die für die ausschließliche Verwendung in Kernwaffen entwickelt oder erheblich verändert wurden.
- die Trägerplattformen herstellten oder montierten, die für den ausschließlichen Einsatz von Kernwaffen entwickelt oder erheblich modifiziert wurden.
- die Hilfsdienste im Zusammenhang mit Kernwaffen anboten.
- die Komponenten herstellten, die nicht für die ausschließliche Verwendung in Kernwaffen entwickelt oder wesentlich verändert wurden, aber in Kernwaffen verwendet werden konnten.
- die Trägerplattformen herstellten oder montierten, die für Kernwaffen verwendet werden konnten, aber nicht für die ausschließliche Nutzung von Kernwaffen entwickelt oder nicht wesentlich geändert wurden.
- die Komponenten für Trägersysteme herstellten, die ausschließlich für Nuklearwaffen verwendet wurden.
- die in irgendeiner Weise mit umstrittenen Waffen (Streumunition, Landminen, Waffen mit abgereichertem Uran, biologische/chemische Waffen, Blendlaser, nicht nachweisbare Splitter und Brandwaffen mit weißem Phosphor) in Verbindung standen.
- die 5 % oder mehr ihres Umsatzes mit Waffensystemen, Komponenten oder unterstützenden Systemen und Dienstleistungen erzielten.
- die als „Produzent“ von Tabakwaren eingestuft waren oder 5 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Produktion, dem Vertrieb, dem Einzelhandel, dem Angebot und der Lizenzierung von Tabakerzeugnissen erzielten.
- die 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus Kohleverstromung erzielten.
- die mehr als 0 % ihres Umsatzes aus der arktischen Erdöl oder Erdgasförderung bezogen oder ihren eigenen Angaben zur Folge Erdöl oder Erdgas in arktischen Gebieten förderten.
- die mehr als 0 % ihres Umsatzes mit unkonventionellem Erdöl und Erdgas erzielten, ihren eigenen Angaben zur Folge Erdöl oder Erdgas mit der Methode des hydraulischen Frackings oder Ölsand förderten.
- die mehr als 0 % ihres Umsatzes aus dem Abbau von Kohle und dem Verkauf an externe Parteien erzielten, ihren eigenen Angaben zur Folge Kohle förderten.
- die Atomkraftwerke betrieben oder besaßen oder mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Stromerzeugung aus Kernenergie erzielten.
- die Uranminen betrieben oder besaßen.

- mit einer CO₂Emissionsintensität (gemessen in Scope1 und 2 CO₂e/ Mio. USD Umsatz) von mehr als 1.500.
- mit einer Energieverbrauchsintensität (gemessen in GWh/ Mio. EUR Umsatz) von mehr als 300.
- die in den letzten drei Jahren mehr als eine schwere oder sehr schwere Kontroverse im Zusammenhang mit Menschenrechtsverletzungen hatten.
- die sich nicht an die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen hielten.
- die mit sehr schwerwiegenden Kontroversen in Bezug auf ESG-Themen konfrontiert waren. Dies wurde durch den Ausschluss von Unternehmen mit einem „MSCI ESG Controversy Score“ von 0 umgesetzt.
- die mit sehr schwerwiegenden oder schwerwiegenden Kontroversen in Bezug auf Umweltthemen konfrontiert waren. Dies wurde durch den Ausschluss von Unternehmen mit einem „MSCI ESG Environmental Controversy Score“ von 1 oder 0 umgesetzt.
- mit einem MSCI ESGRating von „CCC“ oder „B“, fehlendem LCT-Score oder fehlendem ESG-Score. Die Bewertung des MSCI ESG Ratings umfasst dabei eine siebenstufige Skala mit den Kategorien AAA, AA, A, BBB, BB, B und CCC, wobei CCC die niedrigste Bewertung und AAA die höchste Bewertung darstellt.

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

Mit Wirkung vom 01.06.2023 wurden dadurch keine Wertpapiere von Unternehmen mehr in den Index aufgenommen,

- die in irgendeiner Weise mit Nuklearwaffen in Verbindung stehen.
 - die mehr als 5% ihres Umsatzes mit der Lieferung wichtiger nuklearspezifischer Produkte oder Dienstleistungen für die Kernkraftindustrie erzielten.
 - die mehr als 5% ihres Umsatzes durch die Produktion von Handfeuerwaffen erzielten.
- Zudem wurde die Umsatzschwelle für Unternehmen, die Uran abbauen von 0% auf 5% erhöht.

Außerdem wurden am 01.12.2023 die Ausschlusskriterien im Index erweitert. Der Index sieht keine Investitionen in Wertpapiere von Unternehmen vor,

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

Darüber hinaus tätigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungs-Verordnung ((EU) 2019/2088). Das nachhaltige Anlageziel des Fonds ist es, mittels Abbildung einer EU Climate Transition Benchmark die gewichtete CO₂-Intensität des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant zu reduzieren.

Mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt tätigte, wurden keine Umweltziele gemäß Artikel 9 der EU Taxonomie (Verordnung (EU) 2020/852) verfolgt.

Inwieweit die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale des Finanzprodukts erfüllt wurden, wird anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Details zur Ausprägung der Nachhaltigkeitsindikatoren im Berichtszeitraum finden sich im folgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“.

Der MSCI Japan Climate Change ESG Select (Preisindex) wurde als Referenzwert definiert, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf das nachhaltige Investitionsziel ausgerichtet ist. Der Index erfüllt zudem die Anforderungen an EU Referenzwerte für den klimabedingten Wandel (EU Climate Transition Benchmarks, EU CTB). Hiermit wird dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung getragen. Durch die dynamischen Umgewichtungsfaktoren der im Index enthaltenen Unternehmen wird sichergestellt, dass eine Reduktion der CO₂-Intensität von mindestens 30% im Vergleich zu einem

breiten Marktindex erfolgt. Darüber hinaus wird sichergestellt, dass die gewichtete CO₂-Intensität des Portfolios jährlich um mindestens 7% im Vergleich zum Vorjahr sinkt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

1. Einhaltung der in der Anlagestrategie vereinbarten Ausschlusskriterien

Während des Berichtszeitraums investierte das Finanzprodukt im Rahmen der physischen Replikation ausschließlich in Wertpapiere von Unternehmen, die im zugrundeliegenden Index enthalten waren. Damit hielt das Finanzprodukt die im Rahmen des Indexregelwerks festgelegten Ausschlusskriterien während des Berichtszeitraums vollumfänglich und dauerhaft ein. Die Zusammensetzung des Index und damit die Überprüfung der Ausschlusskriterien wurde durch den Indexanbieter vierteljährlich angepasst. Durch die Einhaltung der Ausschlusskriterien wurde erreicht, dass das Sondervermögen im Berichtszeitraum nicht in Wertpapieren von Unternehmen angelegt wurde, die keine verantwortungsvollen Geschäftspraktiken anwendeten und damit gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstießen, in Umwelt- oder andere ESG-Kontroversen verwickelt waren und/ oder Umsätze bzw. einen gewissen Anteil ihrer Umsätze in kontroversen Geschäftsfeldern erwirtschafteten.

Eine ausführliche Auflistung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen aus dem zugrundeliegenden Index geführt haben, findet sich im vorherigen Abschnitt „Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?“ wieder.

2. CO₂-Intensität

Der Indikator „CO₂-Intensität“ betrug im Berichtszeitraum 365,77 tCO₂e je 1 Mio. Euro Unternehmenswert der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen.

Dies wurde erreicht durch eine Übergewichtung von Unternehmen, die dazu beitragen, dass CO₂-Emissionen reduziert werden und über ein zukunftsfähiges Geschäftsmodell verfügen, bei gleichzeitiger Untergewichtung von Unternehmen, die bislang nicht zu einer Verringerung des CO₂-Ausstoßes beitragen.

Der Indikator berechnet sich aus der Summe der CO₂-Emissionen der Unternehmen, in die das Finanzprodukt investiert, gemessen in tCO₂e. Diese wird mit 1 Mio. Euro Unternehmenswert der im Fonds enthaltenen Unternehmen, ins Verhältnis gesetzt. Der Indikator basiert auf Daten von MSCI ESG Research LLC und spiegelt die Datenlage an den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums wider.

In der unten dargestellten Tabelle wird unter „nicht nachhaltige Investitionen“ für die letzte Berichtsperiode der Wert von „2 Andere Investitionen“ und „1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ ausgewiesen. Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug für die letzte Berichtsperiode 7,15%. Die Abweichung resultiert aus der Offenlegung im letzten Berichtsjahr unter Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088.

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

Referenzperiode	01.02.2023-	01.02.2022-
	31.01.2024	31.01.2023
Anzahl Verletzungen der Ausschlusskriterien	0,00	0,00
	Verletzungen	Verletzungen
CO2-Emissionsintensität (je 1 Mio. € Unternehmenswert)	365,77 tCO2e	386,33 tCO2e
Anteil nachhaltige Investitionen	99,52%	14,80%
Anteil Investitionen mit Umweltziel	99,52%	7,65%
Anteil der taxonomiekonformen Investitionen	0,00%	0,00%
Anteil Investitionen mit anderen Umweltzielen	99,52%	7,65%
Anteil Investitionen mit sozialem Ziel	0,00%	0,00%
Anteil nicht nachhaltige Investitionen	0,48%	85,20%

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Damit die nachhaltigen Investitionen den nachhaltigen Anlagezielen trotz eines positiven Beitrags nicht gleichzeitig erheblich schaden, wurden die nachteiligen Auswirkungen der Unternehmen, in die der Fonds investierte, auf Nachhaltigkeitsfaktoren aus den Bereichen Umwelt und Soziales berücksichtigt. Hierzu wurden die von der EU entwickelten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1) herangezogen. Diese PAI-Indikatoren sollen dazu dienen, die negativen Effekte zu messen, die Unternehmen auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung haben.

Die Auswahl der Emittenten erfolgte unter Berücksichtigung von definierten Schwellenwerten für die einbezogenen PAI-Indikatoren. Dadurch wurden negative Effekte in Bezug auf die nachhaltigen Anlageziele begrenzt. Eine Auflistung der PAI-Indikatoren findet sich im darauffolgenden Abschnitt „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Darüber hinaus berücksichtigte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum grundsätzlich die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Informationen hierzu finden sich im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei den nachhaltigen Investitionen wurden für ausgewählte Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAI-Indikatoren) Schwellenwerte festgelegt. Investitionen des Finanzprodukts wurden nur als nachhaltig bewertet, wenn die nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren der Unternehmen bei diesen Indikatoren definierte Schwellenwerte nicht überschritten.

Folgende PAI-Indikatoren werden bei den nachhaltigen Investitionen in Unternehmen berücksichtigt:

- Treibhausgasemissionsintensität (PAI 3 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (PAI 5 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

1)

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

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

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

Verschlechterte sich die Bewertung für einen Emittenten im Laufe des Berichtszeitraums, sodass die definierten Schwellenwerte bzw. Ausprägungen bei mindestens einem der oben genannten Indikatoren nicht mehr eingehalten wurden, wurde die Investition nicht mehr als nachhaltig eingestuft und nicht mehr dem Anteil nachhaltiger Investitionen angerechnet.

Weitere PAI-Indikatoren wurden bei der allgemeinen PAI-Berücksichtigung einbezogen. Informationen hierzu finden sich im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte definieren Leitlinien für die Anwendung guter Unternehmensführung in Bezug auf die Bekämpfung von Bestechung und Korruption, den Umgang mit Beschäftigten, Umweltschutz sowie die Achtung der Menschenrechte.

Die nachhaltigen Investitionen in Unternehmen standen insofern im Einklang mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, als dass mit den nachhaltigen Investitionen nicht in Wertpapiere von Unternehmen investiert wurde, denen mehrfach Menschenrechtsverletzungen in den letzten drei Jahren oder schwere UN Global Compact Verstöße vorgeworfen wurden.

Der UN Global Compact umfasst 10 Prinzipien, die den Bereichen Menschenrechte, Arbeitnehmerrechte, Umwelt und Korruption zuzuordnen sind. Ist ein Unternehmen in eine oder mehrere ESG-Kontroversen verwickelt, bei denen glaubhafte Anschuldigungen bestehen, dass das Unternehmen oder dessen Geschäftsführung gegen diese Prinzipien verstoßen hat, so wird dies als „schwerer Verstoß“ gegen globale Normen wie die ILO („International Labour Organization“) Kernarbeitsnormen oder die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte gewertet. Dazu gehören z.B. Unternehmen, die Kinder- bzw. Zwangsarbeit anwenden.

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



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei dem Finanzprodukt wurden im Berichtszeitraum die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts oder PAI) berücksichtigt. PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-)Tätigkeiten von Unternehmen in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Im Rahmen der PAI-Berücksichtigung wurden im Berichtsjahr systematische Verfahrensweisen zur Messung und Bewertung, sowie Maßnahmen zum Umgang mit den PAI im Investitionsprozess angewendet.

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

Die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen, die von den im Index enthaltenen Unternehmen ausgehen können, wurden im Berichtszeitraum begrenzt, indem der Index gegenüber einem breiten Marktindex Unternehmen ausschloss, die definierte Mindeststandards in Bezug auf Umwelt und Soziales nicht einhielten und damit besonders hohe negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren aufwiesen. Eine ausführliche Beschreibung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen geführt haben, findet sich im Abschnitt „Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzproduktes erreicht?“.

Im Berichtszeitraum waren insbesondere keine Unternehmen mehr im Index enthalten, deren CO₂-Emissionsintensität (PAI 3, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) und Energieverbrauchsintensität (PAI 6, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) einen definierten Schwellenwert überschritt, die definierte Umsatzschwellen in kontroversen Geschäftsfeldern wie fossilen Brennstoffen (PAI 4, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) oder kontroversen Waffen (PAI 14, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) überschritten und die gegen soziale Mindeststandards verstießen, indem ihnen z.B. Verstöße gegen den UN Global Compact (PAI 10, Tabelle 1, (EU) 2022/1288) oder mehrfach Menschenrechtsverletzungen (PAI 14, Tabelle 3, (EU) 2022/1288) vorgeworfen wurden. Eine ausführliche Beschreibung der Kriterien und Schwellenwerte bzw. Ausprägungen, die zum Ausschluss der Unternehmen geführt haben, findet sich im Abschnitt „Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzproduktes erreicht?“.

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

- Treibhausgasemissionen (PAI 1 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- CO₂-Fußabdruck (PAI 2 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (PAI 4 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (PAI 5 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Emissionen in Wasser (PAI 8 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (PAI 9 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)

- Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (PAI 12 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 1)
- Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress (PAI 8 aus Verordnung (EU) 2022/1288, Anhang 1, Tabelle 2)

Darüber hinaus wurde im Rahmen der Mitwirkungspolitik der Verwaltungsgesellschaft Maßnahmen ergriffen, um auf eine Reduzierung der PAI der Unternehmen im Anlageuniversum hinzuwirken. Dazu nutzte die Verwaltungsgesellschaft zum einen ihr Stimmrecht auf Hauptversammlungen. Zum anderen trat die Verwaltungsgesellschaft mit Unternehmen, die bestimmte Schwellenwerte bei PAI-Indikatoren oder anderen ESG-Kennzahlen überschritten und/ oder in ESG-Kontroversen verwickelt waren, in Dialog. In den Gesprächen wurden die Unternehmen auf Missstände aufmerksam gemacht und auf Lösungswege hingewiesen. Die Schwerpunkte sowie die Ergebnisse der Engagementaktivitäten sind im Engagement-Bericht der Verwaltungsgesellschaft des Fonds zu finden. Der aktuelle Engagement-Bericht sowie die Abstimmungsergebnisse auf Hauptversammlungen sind unter folgendem Link abrufbar <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 01.02.2023 - 31.01.2024

In der Tabelle werden die fünfzehn Investitionen aufgeführt, auf die im Berichtszeitraum der größte Anteil aller getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel, mit Angabe der Sektoren und Länder, in die investiert wurde.

Die Angaben zu den Hauptinvestitionen beziehen sich auf den Durchschnitt der Anteile am Sondervermögen zu den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Abweichungen zu der Vermögensaufstellung im Hauptteil des Jahresberichts, die stichtagsbezogen zum Ende des Berichtszeitraums erfolgt, sind daher möglich.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Sony Group Corp. Reg.Shares (JP3435000009)	Gebrauchsgüter & Bekleidung	4,45%	Japan
Keyence Corp. Reg.Shares (JP3236200006)	Hardware & Ausrüstung	3,24%	Japan
Hitachi Ltd. Reg.Shares (JP3788600009)	Investitionsgüter	3,08%	Japan
Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Reg.Shares (JP3902900004)	Banken	2,58%	Japan
Tokyo Electron Ltd. Reg.Shares (JP3571400005)	Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	2,24%	Japan
Daiichi Sankyo Co. Ltd. Reg.Shares (JP3475350009)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	2,15%	Japan
Central Japan Railway Co. Reg.Shares (JP3566800003)	Transportwesen	2,15%	Japan
East Japan Railway Co. Reg.Shares (JP3783600004)	Transportwesen	2,06%	Japan
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares (JP3463000004)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,86%	Japan
Sumitomo Mitsui Financ. Group Reg.Shares (JP3890350006)	Banken	1,70%	Japan
Fast Retailing Co. Ltd. Reg.Shares (JP3802300008)	Vertrieb u. Einzelhandel für Nicht-Basiskonsumgüter	1,68%	Japan
ORIX Corp. Reg.Shares (JP3200450009)	Finanzdienstleistungen	1,61%	Japan
Hoya Corp. Reg.Shares (JP3837800006)	Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	1,49%	Japan
Daikin Industries Ltd. Reg.Shares (JP3481800005)	Investitionsgüter	1,49%	Japan
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares (JP3371200001)	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1,44%	Japan



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

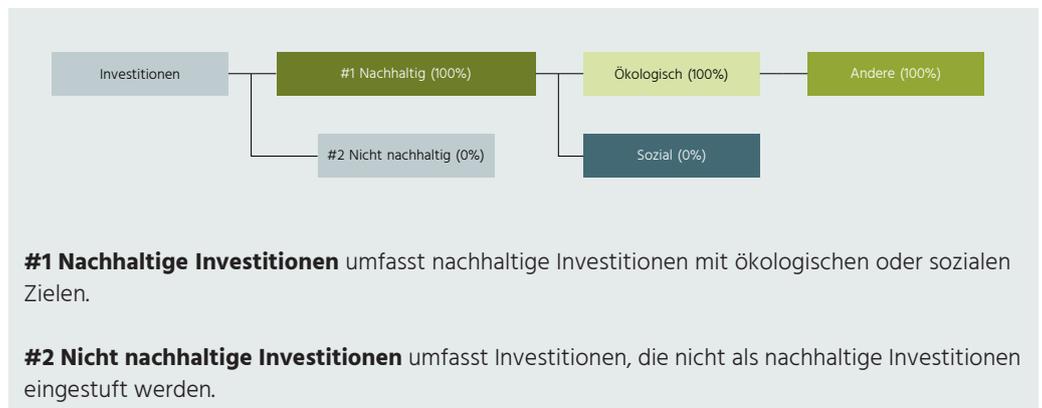
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

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

Eine Beschreibung der Investitionen, die nicht auf das nachhaltige Investitionsziel des Fonds ausgerichtet waren, findet sich im Abschnitt „Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“.

Die Angaben in der Grafik stellen den Durchschnitt der Vermögensallokation aus den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums dar und beziehen sich auf das Brutto-Fondsvermögen. Geringfügige Abweichungen in der prozentualen Gewichtung der Investitionen resultieren aus rundungsbedingten Differenzen.



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

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

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

Darüber hinaus wurden im Berichtszeitraum 0,73% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilssektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI ESG Research LLC zurückgegriffen. Der Anteil beinhaltet Unternehmen, die Umsätze im Bereich der fossilen Brennstoffe, einschließlich der Förderung, Verarbeitung, Lagerung und dem Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie thermischer und metallurgischer Kohle erwirtschaften.

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

Sektor	Anteil
Basiskonsumgüter	5,05%
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	1,89%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	2,27%
Vertrieb und Einzelhandel von Basiskonsumgütern	0,89%
Finanzwesen	12,91%
Banken	6,73%
Finanzdienstleistungen	2,78%
Versicherungen	3,40%
Gesundheitswesen	11,28%
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	3,47%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	7,81%
Immobilien	4,12%
Gebäudemanagement & Immobilienentwicklung	2,75%
Immobilienvermögensgesellschaften	1,37%
Industrie	24,62%
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	2,23%
Investitionsgüter	13,67%
Transportwesen	8,72%
Informationstechnologie	17,62%
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	4,75%
Hardware & Ausrüstung	10,14%
Software & Dienste	2,73%
Kommunikationsdienste	6,11%
Medien & Unterhaltung	2,55%
Telekommunikationsdienste	3,56%
Nicht-Basiskonsumgüter	14,49%
Automobile & Komponenten	3,55%
Dienstleistungsunternehmen	1,15%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	6,72%
Vertrieb u. Einzelhandel für Nicht-Basiskonsumgüter	3,07%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	3,33%
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	3,33%
Sonstige	0,48%
Sonstige	0,48%



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht nachweisbar in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu keinem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug demnach 0% (gemessen an den drei Leistungsindikatoren OpEx, CapEx und Umsatz).

Das Finanzprodukt investierte im Berichtszeitraum nicht in Staatsanleihen. Der Anteil taxonomiekonformer Investitionen beträgt demnach mit und ohne Staatsanleihen 0%.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

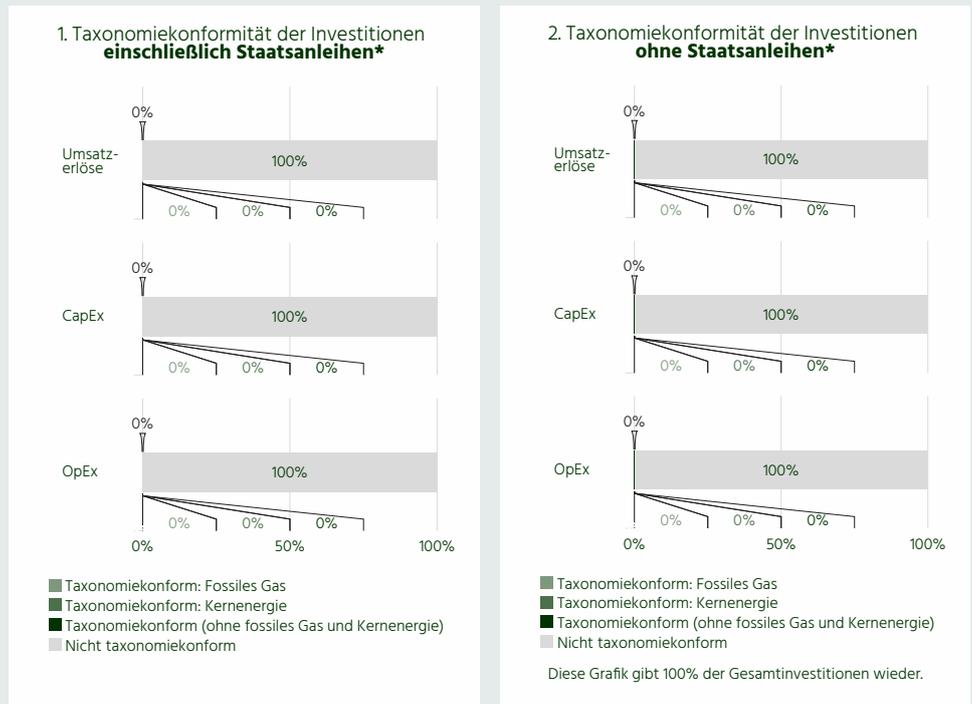
Nein

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

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

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Es war nicht Teil der Anlagestrategie des Finanzprodukts in Wirtschaftsaktivitäten zu investieren, die taxonomiekonform sind. Vielmehr wurde mit den nachhaltigen Investitionen mittels Abbildung einer EU Climate Transition Benchmark die gewichtete CO₂-Intensität des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant reduziert. Zudem musste der Index sicherstellen, dass die CO₂-Intensität jährlich um mindestens 7 % im Vergleich zum Vorjahr sinkt. So wird dafür Sorge getragen, dass die CO₂-Intensität einem Transitionspfad folgt, der mit den Zielen des Pariser Klimaabkommens übereinstimmt. Gezielt Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten zu tätigen, die als taxonomiekonform gelten, sind nicht Teil der Anlagestrategie. Demnach investierte das Finanzprodukt in Wirtschaftstätigkeiten mit Umweltzielen, die nicht taxonomiekonform sind.

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

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



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

Unter „nicht nachhaltige Investitionen“ fielen alle Investitionen, die nicht nach den verbindlichen Elementen der ESG-Anlagestrategie ausgewählt wurden und damit nicht ausgerichtet auf das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts waren. Im Berichtszeitraum gehörten hierzu Investitionen in

- Bankguthaben sowie flüssige Mittel (z.B. Sichteinlagen oder Festgelder). Diese wurden aus Liquiditätszwecken gehalten.

Bei diesen Investitionen wurde ein ökologischer und sozialer Mindestschutz angewendet, in der Form, dass auch mit diesen Investitionen nicht in Hersteller geächteter und kontroverser Waffen investiert wurde. Zudem wurde im Rahmen dieser Investitionen nicht in Produkte investiert, die die Preisentwicklung von Grundnahrungsmitteln abbilden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Die Überwachung der Konformität der Investitionsentscheidungen mit dem nachhaltigen Investitionsziel erfolgte im Rahmen von standardisierten Prozessen, die auf Indexebene umgesetzt sind. Dabei findet die Überwachung und Neugewichtung der im Index enthaltenen Wertpapiere im Rahmen der vierteljährlichen Indexanpassungen (jeweils im Februar, Mai, August und November) statt. Aufgrund der Veröffentlichungspläne wurden die Unternehmen in der Regel zudem einmal jährlich von MSCI kontaktiert und das aktualisierte Unternehmensprofil wurde ihnen zugesendet. Die Low Carbon Transition Bewertung erfolgt ebenfalls auf jährlicher Basis. Die zugrundeliegenden Daten für die LCT Kategorien und Scores (d.h. Kohlenstoffemissionen, Einnahmen aus alternativen Energien, Einnahmen aus Energieeffizienz) wurden das ganze Jahr über aktualisiert. Wurden unterjährig signifikante Änderungen in den zugrundeliegenden Daten identifiziert erfolgte eine zusätzliche Bewertung.

Darüber hinaus erfolgte eine Nachhaltigkeitsanalyse durch die Deka Investment GmbH. Die Ergebnisse dieses Analyseprozesses werden auf jährlicher Basis herangezogen, um die ESG-Kriterien des Index zu überprüfen.

Im Rahmen der Mitwirkungspolitik nahm die Gesellschaft zudem ihre Rolle als aktiver Investor wahr, um Unternehmen mit kritischen Geschäftsaktivitäten zu einem nachhaltigeren und verantwortlicheren Wirtschaften zu bewegen. Hierzu trat die Gesellschaft in den Dialog mit ausgewählten Unternehmen zu Themen wie Umweltschutz, Klimawandel und Arbeitsbedingungen. Wurden ESG-Kontroversen bei Unternehmen identifiziert, wurden diese darauf angesprochen und zur Aufklärung bzw. Beseitigung des Missstandes aufgefordert. Die angesprochenen Themen wurden dokumentiert und die Entwicklung nachverfolgt. Zudem übte die Gesellschaft ihre Aktionärsrechte auf Hauptversammlungen aus und stimmte regelmäßig auf Hauptversammlungen ab. Details zu den Abstimmungsergebnissen und zu den Schwerpunkten sowie den Ergebnissen der Mitwirkungspolitik sind unter folgendem Link abrufbar: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

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

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Für dieses Produkt wurde der MSCI Japan Climate Change ESG Select (Preisindex) als Referenzwert bestimmt. Dieser erfüllt die Anforderungen an EU-Referenzwerte für den klimabedingten Wandel (EU Climate Transition Benchmarks, EU CTB). Hiermit wird dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung getragen.

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

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

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

01.02.2023 - 31.01.2024	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF
CO2-Emissionsintensität (in tCO2e je 1 Mio. € Unternehmenswert)	365,77

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

01.02.2023 - 31.01.2024	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF	Referenzindex
CO2-Emissionsintensität (in tCO2e je 1 Mio. € Unternehmenswert)	365,77	367,24

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

01.02.2023 - 31.01.2024	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF	Breiter Marktindex
CO2-Emissionsintensität (in tCO2e je 1 Mio. € Unternehmenswert)	365,77	740,82

Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds, auf den an dieser Stelle Bezug genommen wird, wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Index-Marke stellt keine Empfehlung zur Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

Lizenzdisclaimer: Obwohl die Informationsanbieter der Deka Investment GmbH, insbesondere die MSCI ESG Research LLC und ihre verbundenen Unternehmen (die "ESG-Parteien"), Informationen (die "Informationen") aus Quellen beziehen, die sie für zuverlässig halten, übernimmt keine der ESG-Parteien eine Garantie oder Gewährleistung für die Originalität, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin

enthaltenen Daten und lehnt ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien ab, einschließlich derjenigen der Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck. Die Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet werden, dürfen in keiner Form vervielfältigt oder weiterverbreitet werden und dürfen nicht als Grundlage oder Bestandteil von Finanzinstrumenten oder Produkten oder Indizes verwendet werden. Darüber hinaus kann keine der Informationen an und für sich verwendet werden, um zu bestimmen, welche Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen sind oder wann sie zu kaufen oder zu verkaufen sind. Keine der ESG-Parteien haftet für Fehler oder Auslassungen in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten oder für direkte, indirekte oder besondere Schäden, Strafen, Folgeschäden oder andere Schäden (einschließlich entgangener Gewinne), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurde.

Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF

Frankfurt am Main, den 26. April 2024
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

**An die Deka Investment GmbH,
Frankfurt am Main**

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Januar 2024, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2024, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Januar 2024 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf den Inhalt der im Abschnitt „Sonstige Informationen“ genannten Bestandteile des Jahresberichts.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Deka Investment GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die allgemeinen Angaben zum Management und zur Verwaltung des Sondervermögens, den Abschnitt „Nachhaltiges Investitionsziel“ des Jahresberichts sowie die übrigen Darstellungen und Ausführungen zum Sondervermögen mit Ausnahme der in § 101 KAGB aufgeführten und geprüften Bestandteile des Jahresberichts sowie unseres Vermerks.

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

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

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht des Sondervermögens Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Deka Investment GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzu beziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Deka Investment GmbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Deka Investment GmbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Deka Investment GmbH nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 30. April 2024

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Andreas Koch
Wirtschaftsprüfer

Mathias Bunge
Wirtschaftsprüfer

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

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

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 Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Januar 2024

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



Deka Investment GmbH

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

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

