

Jahresbericht  
zum 28. Februar 2026.

**Deka MSCI EUR Corporates  
Climate Change ESG CTB UCITS  
ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

**.Deka**  
Investments

**Lizenzvermerk**

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

# Bericht der Geschäftsführung.

28. Februar 2026

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2025 bis zum 28. Februar 2026.

Rückläufige Notenbankzinsen in den USA und der Eurozone sowie sinkende Inflationsraten unterstützten während der Berichtsperiode die Finanzmärkte und gaben den Börsen spürbaren Auftrieb. Die europäische Wirtschaft zeigte im Jahr 2025, trotz schwieriger globaler Rahmenbedingungen wie Handelsspannungen mit den USA und einer schwachen Konjunktur in Deutschland, ein moderates Wachstum. Auch die US-Wirtschaft verkräftete die Folgen des Handelskonflikts und der erratischen Zollpolitik relativ gut, wobei die „America first“-Politik unter US-Präsident Donald Trump zeitweise sowohl die Marktstimmung als auch die globalen Konjunkturaussichten belastete. Geopolitische Faktoren blieben ohne nachhaltigen Einfluss auf das Börsengeschehen.

Auf den nachlassenden Inflationsdruck reagierten die führenden Notenbanken mit einer Lockerung der Geldpolitik. Die Europäische Zentralbank (EZB) senkte den Hauptrefinanzierungssatz bis Juni auf 2,15 Prozent, die US-Notenbank (Fed) reduzierte die Bandbreite der Fed Funds Rate zwischen September und Dezember auf 3,50 bis 3,75 Prozent. An den Rentenmärkten verzeichneten 10-jährige US-Treasuries, beeinflusst durch die unberechenbare US-Handels- und Zollpolitik, bis April 2025 zunächst deutliche Kursgewinne, bevor sich aufgrund von expansiven Signalen von Seiten der Fed einerseits sowie fiskalpolitischen Unsicherheiten andererseits, eine volatile Seitwärtsbewegung einstellte. Zum Stichtag rentierten 10-jährige US-Staatsanleihen mit 3,9 Prozent. In der Eurozone stieg die Rendite vergleichbarer Staatsanleihen im Jahresverlauf an und lag Ende Februar bei 2,6 Prozent.

Unterstützt von der wachstumsfreundlichen Geldpolitik der Zentralbanken und der Euphorie rund um das Thema Künstliche Intelligenz erreichten zahlreiche Aktienindizes neue Allzeithochs. Der Goldpreis profitierte von der gestiegenen Unsicherheit und überschritt im Januar sogar kurzzeitig die Marke von 5.500 US-Dollar pro Feinunze. Am Devisenmarkt legte der Euro in der ersten Berichtshälfte deutlich zu, zeigte danach eine Stabilisierung und kostete Ende Februar 1,18 US-Dollar. Der Rohölpreis gab infolge wachsender Konjunktursorgen bis Ende 2025 zunächst merklich nach. Angesichts der zunehmenden Gefahr einer militärischen Eskalation im Nahen Osten bewegten sich die Notierungen in den letzten Wochen des Berichtszeitraums jedoch wieder signifikant nach oben.

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](http://www.deka-etf.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 28. Februar 2026	16
Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2026	17
Anhang	24
Nachhaltiges Investitionsziel	26
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	43
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	45

**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 01.03.2025 bis 28.02.2026

## Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

### Tätigkeitsbericht.

Der Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB 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 EUR Corporates IG Climate Change ESG Select CTB Index nachzubilden. Der MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select CTB Index umfasst in Euro lautende Unternehmensanleihen von großen und mittelgroßen Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Europa haben. 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.

Mit Wirkung zum 10. Dezember 2025 wurde der Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF zu Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF umbenannt. Grund der Anpassung ist die Änderung des Namens des dem Fonds zugrundeliegenden Indexes. Die Änderung des Indexnamens ist aufgrund der Aktualisierung der Benchmark-Verordnung (Verordnung (EU) 2016/1011) erforderlich. Die Änderung erfolgt aus Transparenzgründen und hat keine Auswirkungen auf die Zusammensetzung des Indexes.

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 Anleihen, die aufgrund von Indexveränderungen und der Rücknahme von Anteilscheinen durchgeführt wurden.

#### Wichtige Kennzahlen

##### Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	seit Auflegung p.a.
	2,6%	4,6%	-0,6%

ISIN DE000ETF1599

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

#### Adressenausfallrisiken

Für das Investmentvermögen bestanden Ausfallrisiken der Emittenten der im Fonds enthaltenen Schuldverschreibungen. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Emittentenrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des Index. Die geringen Abweichungen in dem Emittentenrisikoexposition zwischen Investmentvermögen und Index im Berichtszeitraum waren u.a. durch den Kassenbestand zu erklären. Im Berichtszeitraum entstand dem Investmentvermögen kein Verlust durch einen Adressenausfall.

#### Währungsrisiken

Da die Fondswährung auf Euro lautet und das Investmentvermögen im Berichtszeitraum gemäß den Indexvorgaben ausschließlich in Euro-Wertpapiere investiert war, bestand für den Anleger aus der Eurozone kein Währungsrisiko.

#### Sonstige Marktpreisrisiken

Das Investmentvermögen unterlag im Berichtszeitraum dem Marktpreisrisiko der im Investmentvermögen gehaltenen Schuldverschreibungen. Deren Kursentwicklung wird u.a. durch das Marktzinsniveau sowie die Markteinschätzung zur Emittentenbonität beeinflusst. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Marktpreisrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select CTB (Preisindex). Die geringen Abweichungen in dem Marktpreisexposition zwischen Investmentvermögen und Index im Berichtszeitraum waren u.a. durch den Kassenbestand zu erklären. Die modifizierte Duration des Investmentvermögens betrug zum Stichtag 4,58 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 (u.a. Mindestemissionsvolumen) stellt sowie die Investition in Wertpapiere gemäß § 193 KAGB, wird das Liquiditätsrisiko grundsätzlich als gering eingestuft.

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

**Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:**

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS2462466611	1.500000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28) 20280327
Löschung	XS2449928543	1.500000 % Vestas Wind Systems Finance BV EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290614
Löschung	XS2444263102	1.560000 % Experian Europe DAC EO-Med.-Term Nts 2022(31/31) 20310515
Löschung	XS2449929517	2.000000 % Vestas Wind Systems Finance BV EO-Med.-Term Notes 2022(22/34) 20340614
Löschung	XS2485152362	2.100000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270524
Löschung	FR001400BB83	2.125000 % Bpifrance SACA EO-Medium-Term Notes 2022(27) 20271128
Löschung	XS2473687106	2.250000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2022(22/32) 20320516
Löschung	XS2478685931	2.250000 % UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2022(22/29) 20290522
Löschung	XS3045515262	2.375000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2025(28) 20280406
Löschung	FR0014008JQ4	2.500000 % Mercialis EO-Bonds 2022(22/29) 20290227
Löschung	DE000DW6C1R6	2.650000 % DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. MTN-IHS A.1981 v.23(28) 20280216
Löschung	FR001400SCU5	2.750000 % Bpifrance SACA EO-Medium-Term Notes 2024(29) 20290524
Löschung	XS2496028502	2.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20270829
Löschung	FR001400D5T9	2.750000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2022(28) 20280411
Löschung	XS2481287634	2.750000 % Investor AB EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20320609
Löschung	XS2482872251	2.875000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2030/2030) 20300523
Löschung	FR001400F281	3.000000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(30) 20300110
Löschung	XS2528582377	3.000000 % Compass Group Fin. Netherl. BV EO-Medium-Term Nts 2022(22/30) 20300307
Löschung	XS2530756191	3.000000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2022(22/26) 20260922
Löschung	FR001400CMY0	3.125000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2022(27) 20270913
Löschung	FR001400FXU8	3.125000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Covered Bonds 2023(33) 20330222
Löschung	FR001400DXH0	3.125000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2022(27) 20270517
Löschung	BE0002876572	3.125000 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) EO-Bonds 2022(29/29) 20290905
Löschung	FR001400F703	3.125000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29) 20291012
Löschung	XS2625968693	3.250000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(26) 20261121
Löschung	XS2639007587	3.250000 % Cais. Ctr. du Crd. Imm. France EO-Medium-Term Notes 2023(28) 20280625
Löschung	FR001400DT99	3.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/27) 20271108
Löschung	FR001400JIT3	3.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/28) 20280611
Löschung	XS2527319979	3.279000 % Eurogrid GmbH MTN v.2022(2022/2031) 20310904
Löschung	FR001400RH06	3.375000 % Bpifrance SACA EO-Medium-Term Notes 2024(34) 20340524
Löschung	FR001400IUM5	3.375000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Covered Bonds 2023 (32) 20320627
Löschung	FR001400CQ85	3.375000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Nts 2022(27) 20270918
Löschung	XS2852993810	3.375000 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN-IHS S.A-167 v.24(27) 20270701
Löschung	FR001400F711	3.375000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/34) 20340412
Löschung	FR001400LPZ1	3.500000 % Bpifrance SACA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20270926
Löschung	FR001400DTA3	3.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) 20321108
Löschung	FR001400IJU1	3.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330611
Löschung	XS2489775580	3.500000 % SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/29) 20290113
Löschung	XS2593105393	3.625000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/27) 20270302
Löschung	XS2573807778	3.625000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2023(23/33) 20330109
Löschung	FR001400IIT5	3.625000 % Edenred SE EO-Notes 2023(23/26) 20261212
Löschung	BE6340849569	3.625000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330117
Löschung	XS2537251170	3.750000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/30) 20301011
Löschung	FR001400EAY1	3.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2022(33) 20330131

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

**Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:**

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS2616008541	3.750000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/26) 20261102
Löschung	XS2579319513	3.750000 % SpareBank 1 Sor-Norge ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20271122
Löschung	XS2637963146	3.875000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(26) 20261220
Löschung	DE000A351ZR8	3.875000 % Deutsche Börse AG Anleihe v.23(23/26) 20260927
Löschung	XS2530444624	3.875000 % Fresenius Medical Care AG MTN v.2022(2027/2027) 20270919
Löschung	XS2619751576	3.875000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Notes 2023(28) 20280508
Löschung	XS2575971994	4.000000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280115
Löschung	FR001400E797	4.000000 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(32) 20321128
Löschung	XS2572996606	4.000000 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Pref. MTN 2023(30) 20300109
Löschung	XS2577054716	4.000000 % Länsförsäkringar Bank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 23(27) 20270117
Löschung	XS2547609433	4.000000 % Talanx AG MTN v.2022(2029/2029) 20291024
Löschung	FR001400HQM5	4.079000 % Carrefour Banque EO-Med.-T. Nts 2023(23/27) 20270504
Löschung	FR001400D0F9	4.125000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28) 20281011
Löschung	XS2699159278	4.125000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290403
Löschung	XS2679903950	4.125000 % LSEG Netherlands B.V. EO-Medium-Term Notes 23(23/26) 20260928
Löschung	FR001400KLT5	4.125000 % Worldline S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280911
Löschung	XS2536941656	4.250000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(30) 20300220
Löschung	XS2607381436	4.250000 % Securitas Treasury Ireland DAC EO-Medium-Term Nts 2023(23/27) 20270403
Löschung	XS2629064267	4.250000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290831
Löschung	XS2557084733	4.500000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34) 20341120
Löschung	FR001400DNG3	4.625000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/32) 20320606
Löschung	XS2778370051	4.625000 % METRO AG EO-MTN v.2024(2029/2029) 20290306
Löschung	DE000A30VQA4	4.750000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/27) 20270522
Löschung	FR001400DQ92	5.000000 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20321102
Löschung	FR001400U2E7	5.250000 % Worldline S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20291126
Löschung	XS2589907653	5.500000 % UBS AG EO-Medium-Term Notes 2023(26) 20260819
Löschung	FR0014010A08	5.500000 % Worldline S.A. EO-Medium-Term Nts 2025(25/30) 20300609
Neuaufnahme	XS2485152362	2.100000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270524
Neuaufnahme	XS3045515262	2.375000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2025(28) 20280406
Neuaufnahme	XS3002552993	2.375000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2025(25/28) 20280526
Neuaufnahme	XS3066564900	2.500000 % Achmea Bank N.V. EO-Preferred MTN 2025(28) 20280505
Neuaufnahme	FR0014012SB9	2.500000 % Capgemini SE EO-Notes 2025(25/28) 20280924
Neuaufnahme	FR001400N5A7	2.750000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(29) 20290111
Neuaufnahme	FR001400SF15	2.750000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(30) 20300905
Neuaufnahme	FR0014015FU9	2.750000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2026(31) 20310115
Neuaufnahme	XS2931916972	2.750000 % NatWest Markets PLC EO-Med.-Term Nts 2024(27) 20271103
Neuaufnahme	ES0413860885	2.826000 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2024(33) 20330918
Neuaufnahme	XS3070067072	2.875000 % Elisa Oyj EO-Medium-Term Nts 2025(25/30) 20300513
Neuaufnahme	FR001400RYN6	2.875000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20290304
Neuaufnahme	XS3060656884	2.875000 % Fiserv Funding Unlimited Co. EO-Notes 2025(25/28) 20280614
Neuaufnahme	XS2760109053	2.875000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H371 v.2024(34) 20340205
Neuaufnahme	XS3002553298	2.875000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2025(25/30) 20300826
Neuaufnahme	XS3000592363	2.875000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2025(32) 20320216
Neuaufnahme	FR001400F281	3.000000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(30) 20300110

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

**Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:**

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	FR001400N5C3	3.000000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(34) 20340111
Neuaufnahme	XS3267907965	3.000000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(26/31) 20310118
Neuaufnahme	XS3014215324	3.000000 % Nationwide Building Society EO-Med.-Term Nts 2025(30) 20300302
Neuaufnahme	XS2744299335	3.000000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2024(24/34) 20340116
Neuaufnahme	XS3188782000	3.000000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2025(25/31) 20311005
Neuaufnahme	XS3128477521	3.000000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2025(25/31) 20310721
Neuaufnahme	XS3101433244	3.000000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2025(25/30) 20300924
Neuaufnahme	FR001400WVN2	3.004000 % Arkéa Public Sector SCF EO-M.T.Obl.Fonc.Pu.S. 2025(32) 20320126
Neuaufnahme	FR001400CMY0	3.125000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2022(27) 20270913
Neuaufnahme	XS2994509706	3.125000 % British Telecommunications PLC EO-Medium-Term Nts 2025(25/32) 20320210
Neuaufnahme	FR001400TWD7	3.125000 % Bureau Veritas SA EO-Notes 2024(24/31) 20311114
Neuaufnahme	FR001400FXU8	3.125000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Covered Bonds 2023(33) 20330222
Neuaufnahme	FR0014012S97	3.125000 % Capgemini SE EO-Notes 2025(25/31) 20310924
Neuaufnahme	FR001400DXH0	3.125000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2022(27) 20270517
Neuaufnahme	FR001400QHS2	3.125000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc.24(30) 20300605
Neuaufnahme	XS2932831923	3.125000 % DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/28) 20281105
Neuaufnahme	ES0224244113	3.125000 % Mapfre S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(31/32) 20320119
Neuaufnahme	XS3150924267	3.125000 % Nationwide Building Society EO-Preferred MTN 2025(32) 20320817
Neuaufnahme	XS3002553538	3.125000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2025(25/33) 20330526
Neuaufnahme	XS3003427872	3.125000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2025(25/32) 20320216
Neuaufnahme	FR001400T9Q9	3.250000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 24(31) 20311016
Neuaufnahme	XS2932834604	3.250000 % DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/30) 20301105
Neuaufnahme	XS2969695084	3.250000 % Ferrovial SE EO-Notes 2025(25/30) 20300115
Neuaufnahme	XS2784700671	3.250000 % Fingrid Oyj EO-Medium-Term Notes 24(24/34) 20340319
Neuaufnahme	XS2778864210	3.250000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2024(24/29) 20290317
Neuaufnahme	XS3032020136	3.346000 % Santander UK PLC EO-Med.-T. Notes 2025(30) 20300324
Neuaufnahme	XS2834471463	3.375000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2024(24/34) 20340530
Neuaufnahme	FR001400RH06	3.375000 % Bpifrance SACA EO-Medium-Term Notes 2024(34) 20340524
Neuaufnahme	XS3227880021	3.375000 % BT Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2025(25/32) 20321116
Neuaufnahme	FR0014013058	3.375000 % Bureau Veritas SA EO-Notes 2025(25/33) 20330930
Neuaufnahme	FR001400IUM5	3.375000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Covered Bonds 2023 (32) 20320627
Neuaufnahme	FR001400GI73	3.375000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2023(31) 20310915
Neuaufnahme	FR001400CQ85	3.375000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Nts 2022(27) 20270918
Neuaufnahme	XS3003295519	3.375000 % Kon. KPN N.V. EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350216
Neuaufnahme	XS2588099981	3.375000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2023(28) 20280216
Neuaufnahme	XS3019296840	3.375000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2025(25/32) 20320319
Neuaufnahme	FR001400LPZ1	3.500000 % Bpifrance SACA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20270926
Neuaufnahme	FR0014012S89	3.500000 % Capgemini SE EO-Notes 2025(25/34) 20340924
Neuaufnahme	XS3002420902	3.500000 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350227
Neuaufnahme	XS3019300469	3.500000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2025(25/32) 20320521
Neuaufnahme	XS2747766090	3.500000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2024(24/30) 20300715
Neuaufnahme	XS2978779176	3.500000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2025(25/31) 20310720
Neuaufnahme	BE6368381404	3.500000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20351007
Neuaufnahme	XS3060660050	3.500000 % Fiserv Funding Unlimited Co. EO-Notes 2025(25/32) 20320614

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

**Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:**

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	XS2748847204	3.500000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2024(24/31) 20310116
Neuaufnahme	XS2826616596	3.625000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20290123
Neuaufnahme	ES0224244121	3.625000 % Mapfre S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(35/36) 20360119
Neuaufnahme	BE6356733327	3.625000 % Shurgard Luxembourg S.à r.l. EO-Bonds 2024(24/34) 20341021
Neuaufnahme	XS2607193435	3.625000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290420
Neuaufnahme	XS2610209129	3.750000 % Acciona Energia Fin. Fil. SA EO-Med.-Term Notes 2023(23/30) 20300424
Neuaufnahme	FR001400EAY1	3.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2022(33) 20330131
Neuaufnahme	BE6349118800	3.750000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36) 20360115
Neuaufnahme	XS3044299769	3.750000 % Ellevio AB EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350513
Neuaufnahme	XS2579319513	3.750000 % SpareBank 1 Sor-Norge ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20271122
Neuaufnahme	XS2771661357	3.750000 % United Utilities Water Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2024(34/34) 20340522
Neuaufnahme	XS2637963146	3.875000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(26) 20261220
Neuaufnahme	FR001400IBM5	3.875000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2023(23/31) 20310716
Neuaufnahme	XS3267911645	3.875000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(26/36) 20360118
Neuaufnahme	XS3102229922	3.875000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2025(25/34) 20340615
Neuaufnahme	XS2976337753	3.875000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2025(25/35) 20350314
Neuaufnahme	PTEDPUOM0008	3.875000 % EDP S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280625
Neuaufnahme	XS2638080452	3.875000 % Kon. KPN N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310702
Neuaufnahme	XS2742660660	3.875000 % Motability Operations Grp PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/34) 20340123
Neuaufnahme	XS3077018714	3.875000 % Nexi S.p.A. EO-Medium-Term Notes 25(25/31) 20310520
Neuaufnahme	XS2991273462	3.875000 % Severn Trent Utilities Finance EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350803
Neuaufnahme	XS2619751576	3.875000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Notes 2023(28) 20280508
Neuaufnahme	XS2575971994	4.000000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280115
Neuaufnahme	FR001400E797	4.000000 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(32) 20321128
Neuaufnahme	XS2572996606	4.000000 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Pref. MTN 2023(30) 20300109
Neuaufnahme	XS2838537566	4.000000 % Motability Operations Grp PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/30) 20300116
Neuaufnahme	FR001400GGZ0	4.125000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2023(29) 20290312
Neuaufnahme	FR001400IG08	4.125000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2023(33) 20330613
Neuaufnahme	XS2699159278	4.125000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290403
Neuaufnahme	XS2777383840	4.125000 % Ellevio AB EO-Med.-Term Nts 2024(24/34) 20340306
Neuaufnahme	XS2853679053	4.125000 % ERG S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2024(24/30) 20300702
Neuaufnahme	XS2717300391	4.125000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 23(28) 20281112
Neuaufnahme	XS2536941656	4.250000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(30) 20300220
Neuaufnahme	XS2675225531	4.250000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330105
Neuaufnahme	BE6362152199	4.250000 % VGP N.V. EO-Notes 2025(25/31) 20310128
Neuaufnahme	XS2613658710	4.375000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20281019
Neuaufnahme	FR001400HMF8	4.375000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2023(30) 20300501
Neuaufnahme	XS2699159351	4.375000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2023(23/32) 20320403
Neuaufnahme	XS2557084733	4.500000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34) 20341120
Neuaufnahme	FR001400LZO4	4.500000 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20331112
Neuaufnahme	FR001400LWN3	4.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2023(31) 20311109
Neuaufnahme	XS2705604234	4.875000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Pref. MTN 2023(31) 20311017
Neuaufnahme	FR001400DQ92	5.000000 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20321102
Neuaufnahme	XS2698998593	5.125000 % Acciona Energia Fin. Fil. SA EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310422

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

Im Berichtszeitraum wurden folgende Indexveränderungen vom Indexanbieter bekannt gegeben, welche im Fonds direkt nachvollzogen wurden:

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	XS2673808726	5.125000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(31) 20310828
Neuaufnahme	FR0014010A08	5.500000 % Worldline S.A. EO-Medium-Term Nts 2025(25/30) 20300609

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
DE000A351ZT4	3.875000 % Deutsche Börse AG Anleihe v.23(23/33) 20330927	1,13
XS2582814039	3.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310512	1,06
XS2839008948	3.875000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2024(24/34) 20340119	1,06
XS2984223102	3.724000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2025(25/34) 20340122	1,04
DE000A3LXSR7	4.375000 % JAB Holdings B.V. EO-Notes 2024(24/34) 20340424	1,02
DE000A351ZS6	3.750000 % Deutsche Börse AG Anleihe v.23(23/29) 20290927	1,01
FR001400MLN4	4.125000 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2023(23/30) 20301210	1,01
XS2758114321	3.250000 % Compass Group PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/31) 20310205	0,99
XS2747596315	3.547000 % Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 24(24/34) 20340114	0,99
XS2593105476	3.750000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/32) 20320302	0,98
XS2825485183	3.250000 % MSD Netherlands Capital B.V. EO-Notes 2024(24/32) Reg.S 20320529	0,98
XS2679904685	4.231000 % LSEG Netherlands B.V. EO-Medium-Term Notes 23(23/30) 20300928	0,96
FR001400M2F4	5.250000 % Téléperformance SE EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20281121	0,96
XS2592516210	3.750000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2023(23/31) 20310402	0,94
XS2820460751	3.375000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2024(24/34) 20340520	0,92
XS2820455678	3.250000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2024(24/31) 20310120	0,89
XS2820454606	3.125000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2024(24/29) 20290120	0,88
XS2777367645	4.125000 % LKQ Dutch Bond B.V. EO-Notes 2024(24/31) 20310312	0,88
XS2764405432	3.750000 % EXOR N.V. EO-Notes 2024(24/33) 20330213	0,86
BE6349118800	3.750000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36) 20360115	0,86
XS2681384041	3.875000 % Reckitt Benckiser Treas. Serv. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330913	0,84
XS2676883114	4.750000 % Eurofins Scientific S.E. EO-Bonds 2023(23/30) 20300905	0,83
XS2852136063	3.625000 % DSM B.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/34) 20340701	0,82
BE6352705782	3.875000 % Elia Group EO-Bonds 2024(24/31) 20310610	0,81
FR001400SID8	3.625000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/32) 20321016	0,81
FR001400KHZ0	3.625000 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/27) 20270904	0,80
FR001400NDQ2	3.875000 % Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2024(24/33) 20330922	0,80
DE000A3LZUB2	3.250000 % Allianz Finance II B.V. EO-Medium-Term Nts 2024(29/29) 20291203	0,80
XS2694995163	3.625000 % ASR Nederland N.V. EO-Bonds 2023(23/28) 20281211	0,80
FR001400LUK3	4.375000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20311113	0,79
FR0014012S97	3.125000 % Capgemini SE EO-Notes 2025(25/31) 20310924	0,74
FR0014012S89	3.500000 % Capgemini SE EO-Notes 2025(25/34) 20340924	0,73
XS2615183501	3.722000 % Eurogrid GmbH MTN v.2023(2023/2030) 20300426	0,72
XS2898290916	3.875000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2024(24/33) 20330912	0,72
XS2756342122	3.915000 % Eurogrid GmbH MTN v.2024(2033/2034) 20340131	0,72
XS3102229922	3.875000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2025(25/34) 20340615	0,72
XS2976337753	3.875000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2025(25/35) 20350314	0,71
XS2919679816	3.075000 % Eurogrid GmbH MTN v.2024(2024/2027) 20271017	0,71
XS2616008970	3.750000 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/30) 20300502	0,71
FR001400LZO4	4.500000 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20331112	0,71
XS2704918478	4.875000 % H&M Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20311024	0,71
XS2690050682	5.000000 % BUPA Finance PLC EO-Notes 2023(23/30) 20301011	0,71
XS2698998593	5.125000 % Acciona Energia Fin. Fil. SA EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310422	0,70
XS2756341314	3.598000 % Eurogrid GmbH MTN v.2024(2028/2029) 20290131	0,70
FR0014015FU9	2.750000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2026(31) 20310115	0,70
XS2705604234	4.875000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Pref. MTN 2023(31) 20311017	0,70

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR001400N5A7	2.750000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(29) 20290111	0,70
XS2680945479	4.375000 % Ferrovial SE EO-Medium-Term Nts 2023(23/30) 20300912	0,70
FR001400SF15	2.750000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(30) 20300905	0,70
XS2887901325	3.000000 % BMW Internat. Investment B.V. EO-Medium-Term Notes 2024(27) 20270826	0,69
XS2834471463	3.375000 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 2024(24/34) 20340530	0,69
XS2853679053	4.125000 % ERG S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2024(24/30) 20300702	0,69
XS2777383840	4.125000 % Ellevio AB EO-Med.-Term Nts 2024(24/34) 20340306	0,69
XS2725957042	4.125000 % Vestas Wind Systems A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310614	0,69
XS2715302001	4.125000 % Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2023(23/33) 20331127	0,69
FR001400IBM5	3.875000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2023(23/31) 20310716	0,69
XS2848960683	4.250000 % El Corte Inglés S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(31/31) 20310625	0,69
XS2834462983	4.250000 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2024(24/34) 20340610	0,68
BE0002938190	4.000000 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) EO-Bonds 2023(23/33) 20330514	0,68
DE000A383QV2	4.250000 % TAG Immobilien AG MTN v.2024(2030/2030) 20300303	0,68
XS2594025814	4.875000 % Arcadis N.V. EO-Notes 2023(23/28) 20280227	0,67
XS3032020136	3.346000 % Santander UK PLC EO-Med.-T. Notes 2025(30) 20300324	0,67
XS2623868994	3.750000 % Tele2 AB EO-Medium-Term Nts 2023(29/29) 20291121	0,67
XS2838391170	4.250000 % ITV PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/32) 20320618	0,67
XS2610209129	3.750000 % Acciona Energia Fin. Fil. SA EO-Med.-Term Notes 2023(23/30) 20300424	0,67
XS2969695084	3.250000 % Ferrovial SE EO-Notes 2025(25/30) 20300115	0,67
XS3044299769	3.750000 % Ellevio AB EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350513	0,67
XS2760218003	3.250000 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN-IHS S.A-164 v.24(29) 20290207	0,67
XS2909825379	3.500000 % Criteria Caixa S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20291001	0,67
XS2843262887	3.625000 % Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20290623	0,67
XS2788614498	3.500000 % Amadeus IT Group S.A. EO-Med.-T. Nts 2024(24/29) 20290320	0,67
XS2587306403	3.820000 % Sage Group PLC, The EO-Medium Term Nts 2023(23/28) 20280214	0,67
XS2780025271	3.375000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2024(24/31) 20310310	0,66
XS2838500218	3.375000 % Redeia Corporacion S.A. EO-Bonds 2024(24/32) 20320708	0,66
XS2782937937	3.610000 % Randstad N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20290311	0,66
XS2596537972	3.500000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2023(23/28) 20280403	0,66
XS3060660050	3.500000 % Fiserv Funding Unlimited Co. EO-Notes 2025(25/32) 20320614	0,66
XS3060656884	2.875000 % Fiserv Funding Unlimited Co. EO-Notes 2025(25/28) 20280614	0,66
XS2747590896	3.212000 % Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 24(24/29) 20290114	0,66
XS3077018714	3.875000 % Nexi S.p.A. EO-Medium-Term Notes 25(25/31) 20310520	0,66
ES0224244113	3.125000 % Mapfre S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(31/32) 20320119	0,66
XS2958382645	2.750000 % Achmea Bank N.V. EO-Pref. Med.-T. Nts 2024(27) 20271209	0,66
XS3188782000	3.000000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2025(25/31) 20311005	0,66
ES0224244121	3.625000 % Mapfre S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(35/36) 20360119	0,66
XS3150924267	3.125000 % Nationwide Building Society EO-Preferred MTN 2025(32) 20320817	0,66
BE6368381404	3.500000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20351007	0,66
XS3066564900	2.500000 % Achmea Bank N.V. EO-Preferred MTN 2025(28) 20280505	0,65
XS2895051212	3.250000 % Compass Group PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/33) 20330915	0,65
XS3014215324	3.000000 % Nationwide Building Society EO-Med.-Term Nts 2025(30) 20300302	0,65
XS2744299335	3.000000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2024(24/34) 20340116	0,65
FR001400U678	3.375000 % FDJ United EO-Notes 2024(24/33) 20331120	0,65
FR0014012SB9	2.500000 % Capgemini SE EO-Notes 2025(25/28) 20280924	0,64

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR001400N5C3	3.000000 % Caisse Refinancement IHabitat EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(34) 20340111	0,64
FR0014013058	3.375000 % Bureau Veritas SA EO-Notes 2025(25/33) 20330930	0,64
XS2778864210	3.250000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2024(24/29) 20290317	0,63
XS3101433244	3.000000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2025(25/30) 20300924	0,63
XS3019296840	3.375000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2025(25/32) 20320319	0,62
XS3002552993	2.375000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2025(25/28) 20280526	0,62
XS2991273462	3.875000 % Severn Trent Utilities Finance EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350803	0,61
XS2675225531	4.250000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/33) 20330105	0,60
FR001400TWD7	3.125000 % Bureau Veritas SA EO-Notes 2024(24/31) 20311114	0,60
XS2994509706	3.125000 % British Telecommunications PLC EO-Medium-Term Nts 2025(25/32) 20320210	0,60
FR001400GI73	3.375000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2023(31) 20310915	0,59
XS3227880021	3.375000 % BT Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2025(25/32) 20321116	0,59
XS2588099981	3.375000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2023(28) 20280216	0,59
XS3267911645	3.875000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(26/36) 20360118	0,58
XS2826616596	3.625000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20290123	0,58
XS2932834604	3.250000 % DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/30) 20301105	0,58
XS3267907965	3.000000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2026(26/31) 20310118	0,58
XS3019300469	3.500000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2025(25/32) 20320521	0,57
FR001400GGZ0	4.125000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2023(29) 20290312	0,57
XS3003295519	3.375000 % Kon. KPN N.V. EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350216	0,56
FR001400QHS2	3.125000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc.24(30) 20300605	0,56
FR001400LWN3	4.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2023(31) 20311109	0,55
XS2638080452	3.875000 % Kon. KPN N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310702	0,54
FR001400RYN6	2.875000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29) 20290304	0,54
XS2932831923	3.125000 % DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/28) 20281105	0,54
XS2923391861	3.500000 % Kingspan Securities (Ireland) EO-Med.-Term Notes 2024(24/31) 20311030	0,54
FR001400IG08	4.125000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2023(33) 20330613	0,54
FR001400T9Q9	3.250000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 24(31) 20311016	0,54
FR001400HMF8	4.375000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2023(30) 20300501	0,53
XS2771661357	3.750000 % United Utilities Water Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2024(34/34) 20340522	0,53
XS3070067072	2.875000 % Elisa Oyj EO-Medium-Term Nts 2025(25/30) 20300513	0,53
XS2931916972	2.750000 % NatWest Markets PLC EO-Med.-Term Nts 2024(27) 20271103	0,53
XS2673808726	5.125000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(31) 20310828	0,53
XS3000592363	2.875000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2025(32) 20320216	0,53
ES0413860885	2.826000 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2024(33) 20330918	0,52
XS2613658710	4.375000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20281019	0,52
FR001400WVN2	3.004000 % Arkéa Public Sector SCF EO-M.T.Obl.Fonc.Pu.S. 2025(32) 20320126	0,51
BE6362152199	4.250000 % VGP N.V. EO-Notes 2025(25/31) 20310128	0,49
XS2626289222	4.875000 % 3i Group PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/29) 20290613	0,49
XS2784700671	3.250000 % Fingrid Oyj EO-Medium-Term Notes 24(24/34) 20340319	0,48
XS2748847204	3.500000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2024(24/31) 20310116	0,48
XS3128477521	3.000000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2025(25/31) 20310721	0,47
XS2607193435	3.625000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290420	0,46
XS3003427872	3.125000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2025(25/32) 20320216	0,46
BE6356733327	3.625000 % Shurgard Luxembourg S.à r.l. EO-Bonds 2024(24/34) 20341021	0,46
XS2717300391	4.125000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 23(28) 20281112	0,46

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS3002420902	3.500000 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2025(25/35) 20350227	0,44
XS2760109053	2.875000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H371 v.2024(34) 20340205	0,44
FR001400SCY7	3.000000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2024(24/30) 20300902	0,43
XS2838537566	4.000000 % Motability Operations Grp PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/30) 20300116	0,42
XS2742660660	3.875000 % Motability Operations Grp PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/34) 20340123	0,42
FR001400N277	3.000000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2024(24/31) 20310109	0,42
XS2978779176	3.500000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2025(25/31) 20310720	0,41
XS2747766090	3.500000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2024(24/30) 20300715	0,41
XS2699159351	4.375000 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 2023(23/32) 20320403	0,41
PTEDPUOM0008	3.875000 % EDP S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280625	0,41
XS3002553298	2.875000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2025(25/30) 20300826	0,36
XS3002553538	3.125000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2025(25/33) 20330526	0,34

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 28. Februar 2026.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>255.846.773,17</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		249.732.509,57	97,62
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	41.199.604,29		16,11
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	68.349.957,14		26,72
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	70.255.697,15		27,46
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	69.927.250,99		27,34
2. Forderungen		4.432.286,38	1,73
3. Bankguthaben		1.681.977,22	0,66
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-37.912,63</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>255.808.860,54</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2026.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2026	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
XS2760218003	3,2500 % DekaBank Dt.Girozentrale - Medium Term IHS 2024/2029		EUR	1.600	300	500	% 102,034	1.632.544,00	0,64
DE000A351ZS6	3,7500 % Deutsche Börse AG - Anleihe 2023/2029		EUR	2.500	300	500	% 103,631	2.590.775,00	1,01
DE000A351ZT4	3,8750 % Deutsche Börse AG - Anleihe 2023/2033		EUR	2.700	200	600	% 104,236	2.814.372,00	1,10
XS2919679816	3,0750 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2024/2027		EUR	1.800	300	600	% 100,916	1.816.488,00	0,71
XS2756341314	3,5980 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2024/2029		EUR	1.700	300	600	% 102,563	1.743.571,00	0,68
XS2615183501	3,7220 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	1.800	400	700	% 103,016	1.854.288,00	0,72
XS2756342122	3,9150 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2024/2034		EUR	1.800	200	500	% 103,024	1.854.432,00	0,72
XS2760109053	2,8750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2034		EUR	1.100	1.200	100	% 100,808	1.108.888,00	0,43
DE000A383QV2	4,2500 % TAG Immobilien AG - Medium Term Notes 2024/2030		EUR	1.600	300	500	% 103,817	1.661.072,00	0,65
							EUR	17.076.430,00	6,68
Ausland									
BE6352705782	3,8750 % Elia Group - Bonds 2024/2031		EUR	2.000	300	500	% 102,914	2.058.280,00	0,80
XS2626289222	4,8750 % 3i Group PLC - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	1.157	417	1.098	% 105,600	1.221.792,00	0,48
XS2613658710	4,3750 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	1.200	1.200	0	% 104,226	1.250.712,00	0,49
XS2610209129	3,7500 % Acciona Energia Fin. Fil. SA - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	1.700	1.800	100	% 101,681	1.728.577,00	0,68
XS2698998593	5,1250 % Acciona Energia Fin. Fil. SA - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	1.700	1.800	100	% 106,957	1.818.269,00	0,71
XS3066564900	2,5000 % Achmea Bank N.V. - Medium Term Notes 2025/2028		EUR	1.600	1.600	0	% 99,894	1.598.304,00	0,62
XS2958382645	2,7500 % Achmea Bank N.V. - Medium Term Notes 2024/2027		EUR	1.700	400	500	% 100,463	1.707.871,00	0,67
XS2780025271	3,3750 % Ahold Delhaize N.V.. Konkinkl. - Senior Notes 2024/2031		EUR	1.632	417	623	% 101,945	1.663.742,40	0,65
XS2596537972	3,5000 % Ahold Delhaize N.V.. Konkinkl. - Senior Notes 2023/2028		EUR	1.616	100	300	% 101,709	1.643.611,95	0,64
DE000A3LZUB2	3,2500 % Allianz Finance II B.V. - Medium Term Notes 2024/2029		EUR	2.000	300	500	% 102,523	2.050.460,00	0,80
XS2788614498	3,5000 % Amadeus IT Group S.A. - Medium Term Notes 2024/2029		EUR	1.600	300	500	% 101,979	1.631.664,00	0,64
XS2594025814	4,8750 % Arcadis N.V. - Senior Notes 2023/2028		EUR	1.632	417	623	% 103,262	1.685.235,84	0,66
FR001400WVN2	3,0040 % Arkéa Public Sector SCF - Öff. MT Pfandbriefe 2025/2032		EUR	1.300	1.300	0	% 101,210	1.315.730,00	0,51
XS2694995163	3,6250 % ASR Nederland N.V. - Bonds 2023/2028		EUR	1.959	300	487	% 101,963	1.997.455,17	0,78
XS2747590896	3,2120 % Assicurazioni Generali S.p.A. - Medium Term Notes 2024/2024		EUR	1.632	417	623	% 101,597	1.658.063,04	0,65
XS2747596315	3,5470 % Assicurazioni Generali S.p.A. - Medium Term Notes 2024/2024		EUR	2.448	308	635	% 101,302	2.479.872,96	0,97
XS2593105476	3,7500 % AstraZeneca PLC - Medium Term Notes 2023/2032		EUR	2.348	305	739	% 104,162	2.445.723,76	0,96
XS2834471463	3,3750 % AXA S.A. - Medium Term Notes 2024/2034		EUR	1.725	1.725	0	% 100,275	1.729.743,75	0,68
XS2705604234	4,8750 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	1.600	1.800	200	% 108,177	1.730.832,00	0,68
XS2887901325	3,0000 % BMW Internat. Investment B.V. - Medium Term Notes 2024/2027		EUR	1.726	278	1.317	% 100,779	1.739.445,54	0,68
FR001400IBM5	3,8750 % Bouygues S.A. - Bonds 2023/2031		EUR	1.600	1.600	0	% 104,175	1.666.800,00	0,65
FR001400T9Q9	3,2500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2024/2031		EUR	1.300	1.400	100	% 100,474	1.306.162,00	0,51
FR001400GGZ0	4,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	1.400	1.500	100	% 103,959	1.455.426,00	0,57
FR001400IG08	4,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	1.300	1.400	100	% 104,877	1.363.401,00	0,53
FR001400HMF8	4,3750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	1.300	1.400	100	% 104,894	1.363.622,00	0,53
FR001400LWN3	4,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	1.300	1.400	100	% 107,150	1.392.950,00	0,54
XS2994509706	3,1250 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2025/2032		EUR	1.538	1.538	0	% 99,349	1.527.987,62	0,60
XS2582814039	3,7500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	2.552	211	619	% 103,194	2.633.510,88	1,03
XS2839008948	3,8750 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2024/2034		EUR	2.574	400	889	% 102,306	2.633.356,44	1,03

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2026	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2675225531	4,2500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2023/2033	EUR		1.460	1.460	0	% 105,028	1.533.408,80	0,60
XS3227880021	3,3750 % BT Finance PLC - Medium Term Notes 2025/2032	EUR		1.482	1.482	0	% 100,045	1.482.666,90	0,58
XS2690050682	5,0000 % BUPA Finance PLC - Guaranteed Notes 2023/2030	EUR		1.632	417	623	% 108,032	1.763.082,24	0,69
FR001400TWD7	3,1250 % Bureau Veritas SA - Senior Notes 2024/2031	EUR		1.500	1.500	0	% 100,336	1.505.040,00	0,59
FR0014013058	3,3750 % Bureau Veritas SA - Senior Notes 2025/2033	EUR		1.600	1.600	0	% 100,026	1.600.416,00	0,63
FR001400N5A7	2,7500 % Caisse Refinancement l'Habitat - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2029	EUR		1.700	1.900	200	% 101,112	1.718.904,00	0,67
FR001400SF15	2,7500 % Caisse Refinancement l'Habitat - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2030	EUR		1.700	1.800	100	% 100,786	1.713.362,00	0,67
FR0014015FU9	2,7500 % Caisse Refinancement l'Habitat - Öff. MT Pfandbriefe 2026/2031	EUR		1.700	1.700	0	% 100,750	1.712.750,00	0,67
FR001400N5C3	3,0000 % Caisse Refinancement l'Habitat - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2034	EUR		1.600	1.600	0	% 100,078	1.601.248,00	0,63
FR0014012SB9	2,5000 % Capgemini SE - Senior Notes 2025/2028	EUR		1.600	1.600	0	% 99,672	1.594.752,00	0,62
FR0014012S97	3,1250 % Capgemini SE - Senior Notes 2025/2031	EUR		1.900	1.900	0	% 98,991	1.880.829,00	0,74
FR0014012S89	3,5000 % Capgemini SE - Senior Notes 2025/2034	EUR		1.900	1.900	0	% 97,678	1.855.882,00	0,73
XS3002420902	3,5000 % CARLSB.BREW. 25/35 MTN - Medium Term Notes 2025/2035	EUR		1.050	1.050	0	% 99,436	1.044.078,00	0,41
FR001400SID8	3,6250 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2024/2032	EUR		2.000	200	900	% 101,266	2.025.320,00	0,79
FR001400LUK3	4,3750 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR		1.900	300	1.100	% 105,734	2.008.946,00	0,79
XS3267907965	3,0000 % Cellnex Finance Company S.A. - Medium Term Notes 2026/2031	EUR		1.400	1.400	0	% 99,369	1.391.166,00	0,54
XS3019300469	3,5000 % Cellnex Finance Company S.A. - Medium Term Notes 2025/2032	EUR		1.400	1.400	0	% 100,667	1.409.338,00	0,55
XS2826616596	3,6250 % Cellnex Finance Company S.A. - Medium Term Notes 2024/2029	EUR		1.400	1.400	0	% 102,273	1.431.822,00	0,56
XS3267911645	3,8750 % Cellnex Finance Company S.A. - Medium Term Notes 2026/2036	EUR		1.500	1.500	0	% 99,561	1.493.415,00	0,58
FR001400QHS2	3,1250 % Cie de Financement Foncier - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2030	EUR		1.400	1.400	0	% 102,189	1.430.646,00	0,56
FR001400GI73	3,3750 % Cie de Financement Foncier - Öff. MT Pfandbriefe 2023/2031	EUR		1.400	1.400	0	% 103,116	1.443.624,00	0,56
XS2758114321	3,2500 % Compass Group PLC - Medium Term Notes 2024/2031	EUR		2.448	308	635	% 101,365	2.481.415,20	0,97
XS2895051212	3,2500 % Compass Group PLC - Medium Term Notes 2024/2033	EUR		1.632	300	531	% 99,815	1.628.980,80	0,64
XS2909825379	3,5000 % Criteria Caixa S.A.U. - Medium Term Notes 2024/2029	EUR		1.600	300	500	% 102,102	1.633.632,00	0,64
XS2843262887	3,6250 % Dell Bank International DAC - Medium Term Notes 2024/2029	EUR		1.632	417	623	% 102,096	1.666.206,72	0,65
XS2898290916	3,8750 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2024/2033	EUR		1.792	610	1.858	% 100,935	1.808.755,20	0,71
XS3102229922	3,8750 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2025/2034	EUR		1.800	2.267	467	% 100,080	1.801.440,00	0,70
XS2976337753	3,8750 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2025/2035	EUR		1.788	2.253	465	% 99,655	1.781.831,40	0,70
XS2852136063	3,6250 % DSM B.V. - Medium Term Notes 2024/2034	EUR		2.070	211	1.101	% 101,284	2.096.578,80	0,82
XS2932831923	3,1250 % DSV Finance B.V. - Medium Term Notes 2024/2028	EUR		1.392	1.392	0	% 101,255	1.409.469,60	0,55
XS2932834604	3,2500 % DSV Finance B.V. - Medium Term Notes 2024/2030	EUR		1.472	1.472	0	% 101,175	1.489.296,00	0,58
PTEDPUOM0008	3,8750 % EDP - Energias de Portugal SA - Medium Term Notes 2023/2028	EUR		1.000	1.100	100	% 102,721	1.027.210,00	0,40
XS2747766090	3,5000 % EDP Servicios Financ.Espana SA - Medium Term Notes 2024/2030	EUR		972	972	0	% 102,401	995.337,72	0,39
XS2978779176	3,5000 % EDP Servicios Financ.Espana SA - Medium Term Notes 2025/2031	EUR		976	976	0	% 102,053	996.037,28	0,39
XS2699159351	4,3750 % EDP Servicios Financ.Espana SA - Medium Term Notes 2023/2032	EUR		933	933	0	% 106,403	992.739,99	0,39
XS2848960683	4,2500 % El Corte Inglés S.A. - Medium Term Notes 2024/2031	EUR		1.600	300	500	% 104,997	1.679.952,00	0,66
BE6368381404	3,5000 % Elia Transm. Belgium N.V. - Medium Term Notes 2025/2035	EUR		1.700	1.700	0	% 99,622	1.693.574,00	0,66
BE6349118800	3,7500 % Elia Transm. Belgium N.V. - Medium Term Notes 2024/2036	EUR		2.100	2.100	0	% 101,459	2.130.639,00	0,83
XS3070067072	2,8750 % Elisa Oyj - Medium Term Notes 2025/2030	EUR		1.327	1.327	0	% 100,019	1.327.252,13	0,52
XS3044299769	3,7500 % Ellevio AB - Medium Term Notes 2025/2035	EUR		1.681	1.681	0	% 101,114	1.699.726,34	0,66

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2026	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2777383840	4,1250 % Ellevio AB - Medium Term Notes 2024/2034	EUR	1.681	1.681	1.681	0	104,421	1.755.317,01	0,69
XS2853679053	4,1250 % ERG S.p.A. - Medium Term Notes 2024/2030	EUR	1.681	1.681	1.681	0	104,533	1.757.199,73	0,69
FR001400RYN6	2,8750 % EssilorLuxottica S.A. - Medium Term Notes 2024/2029	EUR	1.400	1.400	1.600	200	100,762	1.410.668,00	0,55
XS2676883114	4,7500 % Eurofins Scientific S.E. - Bonds 2023/2030	EUR	1.959	1.959	300	487	106,278	2.081.986,02	0,81
XS2764405432	3,7500 % EXOR N.V. - Senior Notes 2024/2033	EUR	2.122	2.122	300	602	101,397	2.151.644,34	0,84
XS2680945479	4,3750 % Ferrovial SE - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	1.632	1.632	417	623	106,167	1.732.645,44	0,68
XS2969695084	3,2500 % Ferrovial SE - Senior Notes 2025/2030	EUR	1.700	1.700	1.700	0	101,574	1.726.758,00	0,68
XS2784700671	3,2500 % Fingrid Oyj - Medium Term Notes 2024/2034	EUR	1.242	1.242	1.242	0	100,230	1.244.856,60	0,49
XS3060656884	2,8750 % Fiserv Funding Unlimited Co. - Guaranteed Registered Notes 2025/2028	EUR	1.662	1.662	1.662	0	99,976	1.661.601,12	0,65
XS3060660050	3,5000 % Fiserv Funding Unlimited Co. - Guaranteed Registered Notes 2025/2032	EUR	1.687	1.687	1.687	0	98,544	1.662.437,28	0,65
XS2715302001	4,1250 % Givaudan Finance Europe B.V. - Guaranteed Notes 2023/2033	EUR	1.632	1.632	417	623	105,287	1.718.283,84	0,67
BE0002938190	4,0000 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) - Registered Bonds 2023/2033	EUR	1.600	1.600	300	500	104,354	1.669.664,00	0,65
XS2704918478	4,8750 % H&M Finance B.V. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	1.632	1.632	417	623	108,294	1.767.358,08	0,69
XS2673808726	5,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	1.204	1.204	1.304	100	110,127	1.325.929,08	0,52
XS2838391170	4,2500 % ITV PLC - Medium Term Notes 2024/2032	EUR	1.632	1.632	417	623	102,825	1.678.104,00	0,66
DE000A3LXSR7	4,3750 % JAB Holdings B.V. - EO-Notes 2024/2034	EUR	2.400	2.400	200	500	103,983	2.495.592,00	0,98
FR001400KHZ0	3,6250 % Kering S.A. - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	2.000	2.000	200	900	101,450	2.029.000,00	0,79
XS2923391861	3,5000 % Kingspan Securities (Ireland) - Medium Term Notes 2024/2031	EUR	1.333	1.333	300	1.691	101,289	1.350.182,37	0,53
FR001400NDQ2	3,8750 % Klépierre S.A. - Medium Term IHS 2024/2033	EUR	2.000	2.000	300	500	102,815	2.056.300,00	0,80
XS3003295519	3,3750 % Kon. KPN N.V. - Medium Term Notes 2025/2035	EUR	1.400	1.400	1.400	0	98,014	1.372.196,00	0,54
XS2638080452	3,8750 % Kon. KPN N.V. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	1.300	1.300	1.300	0	104,015	1.352.195,00	0,53
FR001400U678	3,3750 % LA FRANCAISE DES JEUX - Senior Notes 2024/2033	EUR	1.600	1.600	300	500	99,425	1.590.800,00	0,62
XS2777367645	4,1250 % LKQ Dutch Bond B.V. - Guaranteed Notes 2024/2031	EUR	2.176	2.176	308	907	101,504	2.208.727,04	0,86
XS2679904685	4,2310 % LSEG Netherlands B.V. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	2.285	2.285	300	618	105,080	2.401.078,00	0,94
ES0224244113	3,1250 % Mapfre S.A. - Medium Term Notes 2026/2032	EUR	1.700	1.700	1.700	0	100,515	1.708.755,00	0,67
ES0224244121	3,6250 % Mapfre S.A. - Medium Term Notes 2026/2036	EUR	1.700	1.700	1.700	0	100,064	1.701.088,00	0,66
XS2834462983	4,2500 % Mölnlycke Holding AB - Medium Term Notes 2024/2034	EUR	1.632	1.632	300	531	104,316	1.702.437,12	0,67
XS2742660660	3,8750 % Motability Operations Grp PLC - Medium Term Notes 2024/2034	EUR	988	988	988	0	101,578	1.003.590,64	0,39
XS2838537566	4,0000 % Motability Operations Grp PLC - Medium Term Notes 2024/2030	EUR	972	972	972	0	103,701	1.007.973,72	0,39
XS2825485183	3,2500 % MSD Netherlands Capital B.V. - Guaranteed Registered Notes 2024/2032	EUR	2.418	2.418	300	883	101,399	2.451.827,82	0,96
XS3014215324	3,0000 % Nationwide Building Society - Medium Term Notes 2025/2030	EUR	1.640	1.640	1.640	0	100,655	1.650.742,00	0,65
XS3150924267	3,1250 % Nationwide Building Society - Medium Term Notes 2025/2032	EUR	1.660	1.660	1.660	0	99,777	1.656.298,20	0,65
XS2931916972	2,7500 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2024/2027	EUR	1.354	1.354	1.354	0	100,542	1.361.338,68	0,53
XS3077018714	3,8750 % Nexi S.p.A. - Medium Term Notes 2025/2031	EUR	1.660	1.660	1.660	0	100,050	1.660.830,00	0,65
XS3002552993	2,3750 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Medium Term Notes 2025/2028	EUR	1.585	1.585	1.585	0	99,746	1.580.974,10	0,62
XS3002553298	2,8750 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Medium Term Notes 2025/2030	EUR	896	896	896	0	100,332	898.974,72	0,35
XS2820454606	3,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Medium Term Notes 2024/2029	EUR	2.183	2.183	467	1.403	101,485	2.215.417,55	0,87
XS3002553538	3,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Medium Term Notes 2025/2033	EUR	862	862	862	0	99,681	859.250,22	0,34
XS2820455678	3,2500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Medium Term Notes 2024/2031	EUR	2.185	2.185	500	1.423	101,598	2.219.916,30	0,87
XS2820460751	3,3750 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. - Medium Term Notes 2024/2034	EUR	2.290	2.290	469	1.369	100,119	2.292.725,10	0,90

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2026	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2782937937	3,6100 % Randstad N.V. - Medium Term Notes 2024/2029		EUR	1.632	417	623	% 101,886	1.662.779,52	0,65
XS2681384041	3,8750 % Reckitt Benckiser Treas. Serv. - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	2.017	308	1.066	% 103,740	2.092.435,80	0,82
XS2744299335	3,0000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. - Medium Term Notes 2024/2034		EUR	1.700	1.900	200	% 98,369	1.672.273,00	0,65
XS3188782000	3,0000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. - Medium Term Notes 2025/2031		EUR	1.700	1.700	0	% 100,222	1.703.774,00	0,67
XS2838500218	3,3750 % Redeia Corporacion S.A. - Registered Bonds 2024/2032		EUR	1.700	400	500	% 100,853	1.714.501,00	0,67
XS2587306403	3,8200 % Sage Group PLC The - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	1.632	417	623	% 101,941	1.663.677,12	0,65
XS3032020136	33,000 % Santander UK PLC - Medium Term Notes 2025/2030		EUR	1.666	1.666	0	% 101,831	1.696.504,46	0,66
FR001400SCY7	3,0000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2024/2030		EUR	1.100	300	600	% 100,799	1.108.789,00	0,43
FR001400N277	3,0000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2024/2031		EUR	1.000	200	500	% 100,769	1.007.690,00	0,39
XS2991273462	3,8750 % Severn Trent Utilities Finance - Medium Term Notes 2025/2035		EUR	1.543	1.543	0	% 101,275	1.562.673,25	0,61
BE6356733327	3,6250 % Shurgard Luxembourg S.à r.l. - Guaranteed Bonds 2024/2034		EUR	1.200	1.300	100	% 98,874	1.186.488,00	0,46
XS2616008970	3,7500 % Sika Capital B.V. - Guaranteed Registered Notes 2023/2030		EUR	1.720	405	1.467	% 103,308	1.776.897,60	0,69
FR001400LZ04	4,5000 % Suez S.A. - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	1.700	1.700	0	% 105,653	1.796.101,00	0,70
XS3000592363	2,8750 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2025/2032		EUR	1.312	1.312	0	% 100,327	1.316.290,24	0,51
XS2588099981	3,3750 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	1.404	1.404	0	% 101,760	1.428.710,40	0,56
XS2717300391	4,1250 % Swedbank AB - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	1.149	1.249	100	% 104,182	1.197.051,18	0,47
XS2623868994	0,0000 % Tele2 AB - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	1.632	417	623	% 102,893	1.679.213,76	0,66
XS2984223102	3,7240 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium Term Notes 2025/2034		EUR	2.600	200	800	% 100,059	2.601.534,00	1,02
FR001400M2F4	5,2500 % Téléperformance SE - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	2.300	300	600	% 104,625	2.406.375,00	0,94
XS3128477521	3,0000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2025/2031		EUR	1.218	1.218	0	% 99,951	1.217.403,18	0,48
XS3003427872	3,1250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2025/2032		EUR	1.202	1.202	0	% 100,338	1.206.062,76	0,47
XS2748847204	3,5000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2024/2031		EUR	1.212	1.212	0	% 102,423	1.241.366,76	0,49
XS2607193435	3,6250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	1.181	1.181	0	% 102,678	1.212.627,18	0,47
FR001400MLN4	4,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	2.400	200	500	% 104,920	2.518.080,00	0,98
XS2771661357	3,7500 % United Utilities Water Fin.PLC - Medium Term Notes 2024/2034		EUR	1.317	1.432	115	% 101,216	1.333.014,72	0,52
XS2725957042	4,1250 % Vestas Wind Systems A/S - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	1.632	317	523	% 104,281	1.701.865,92	0,67
BE6362152199	4,2500 % VGP N.V. - Senior Notes 2025/2031		EUR	1.200	1.400	200	% 102,965	1.235.580,00	0,48
XS3101433244	3,0000 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2025/2030		EUR	1.579	1.579	0	% 99,648	1.573.441,92	0,62
XS2778864210	3,2500 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2024/2029		EUR	1.565	1.565	0	% 101,420	1.587.223,00	0,62
XS3019296840	3,3750 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2025/2032		EUR	1.549	1.549	0	% 100,379	1.554.870,71	0,61
XS2592516210	3,7500 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2023/2031		EUR	2.285	300	618	% 102,790	2.348.751,50	0,92
Summe Wertpapiervermögen							EUR	232.656.079,57	90,95
							EUR	249.732.509,57	97,62
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	1.681.977,22	0,66
EUR-Guthaben bei:									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	1.681.977,22			% 100,000	1.681.977,22	0,66
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	4.432.286,38	1,73
Zinsansprüche			EUR	4.432.286,38				4.432.286,38	1,73
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-37.912,63	-0,01
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	1.047,23				1.047,23	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-38.959,86				-38.959,86	-0,02
Fondsvermögen							EUR	255.808.860,54	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert							EUR	88,85	

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2026	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Umlaufende Anteile						STK	2.879.259,00	

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

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 27.02.2026

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
<b>Inland</b>					
XS2852993810	0,0000 % DekaBank Dt.Girozentrale - Medium Term IHS 2024/2027	EUR	300	2.100	
DE000A351ZR8	3,8750 % Deutsche Börse AG - Anleihe 2023/2026	EUR	300	3.400	
XS2527319979	3,2790 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2022/2031	EUR	100	2.200	
XS2530444624	3,8750 % Fresenius Medical Care KGaA - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	186	2.929	
XS2482872251	2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	136	2.148	
XS2778370051	4,6250 % METRO AG - Medium Term Notes 2024/2029	EUR	123	1.952	
XS2547609433	4,0000 % Talanx AG - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	300	2.100	
DE000A30VQA4	4,7500 % Vonovia SE - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	100	2.800	
<b>Ausland</b>					
XS3045515262	2,3750 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2025/2028	EUR	900	900	
XS2637963146	3,8750 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	700	700	
XS2575971994	4,0000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	1.100	1.100	
XS2536941656	4,2500 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	1.200	1.200	
XS2557084733	4,5000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2022/2034	EUR	1.300	1.300	
XS2462466611	1,5000 % Akzo Nobel N.V. - Anleihe 2022/2028	EUR	100	2.246	
XS2473687106	2,2500 % ASML Holding N.V. - Registered Notes 2022/2032	EUR	217	2.055	
XS2593105393	3,6250 % AstraZeneca PLC - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	205	2.987	
XS2573807778	3,6250 % AXA S.A. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	305	3.087	
XS2537251170	3,7500 % AXA S.A. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	100	3.057	
ES0413860885	2,8260 % Banco de Sabadell S.A. - Cédulas Hip. 2024/2033	EUR	900	900	
XS2625968693	3,2500 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	165	2.840	
FR001400DNG3	4,6250 % Bouygues S.A. - Bonds 2022/2032	EUR	300	3.200	
FR001400E797	4,0000 % BPCE S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	1.300	1.300	
FR001400BB83	2,1250 % Bpifrance SACA - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	200	3.800	
FR001400SCU5	2,7500 % Bpifrance SACA - Medium Term Notes 2024/2029	EUR	100	3.500	
FR001400RH06	3,3750 % Bpifrance SACA - Medium Term Notes 2024/2034	EUR	1.200	1.200	
FR001400LPZ1	3,5000 % Bpifrance SACA - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	1.000	1.000	
FR001400CMY0	3,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	1.100	1.100	
FR001400EAY1	3,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2022/2033	EUR	1.500	1.500	
XS2496028502	2,7500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	200	2.803	
XS2639007587	3,2500 % Cais. Ctr. du Crd. Imm. France - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	100	2.400	
FR001400D5T9	2,7500 % Caisse Refinancement l'Habitat - Öff. MT Pfandbriefe 2022/2028	EUR	200	3.600	
FR001400F281	3,0000 % Caisse Refinancement l'Habitat - Öff. MT Pfandbriefe 2023/2030	EUR	1.800	1.800	
FR001400FXU8	3,1250 % Caisse Refinancement l'Habitat - Hyp. Pfandbriefe 2023/2033	EUR	2.100	5.300	
FR001400IUM5	3,3750 % Caisse Refinancement l'Habitat - Hyp. Pfandbriefe 2023/2032	EUR	800	800	
FR001400HQM5	4,0790 % Carrefour Banque - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	300	2.100	
FR001400D0F9	4,1250 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2022/2028	EUR	200	3.200	
FR001400DXH0	3,1250 % Cie de Financement Foncier - Öff. MT Pfandbriefe 2022/2027	EUR	1.400	1.400	
XS2528582377	3,0000 % Compass Group Fin. Netherl. BV - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	217	2.055	
XS2572996606	4,0000 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	1.200	1.200	
FR001400CQ85	3,3750 % Crédit Mutuel Arkéa - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	1.200	1.200	
FR001400IIT5	3,6250 % Edenred SE - Senior Notes 2023/2026	EUR	200	2.000	
XS2699159278	4,1250 % EDP Servicios Financ. Espana SA - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	900	900	
BE6340849569	3,6250 % Elia Transm. Belgium N.V. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	400	2.200	
XS2444263102	1,5600 % Experian Europe DAC - Medium Term Notes 2022/2031	EUR	217	2.055	
BE0002876572	3,1250 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) - Registered Bonds 2022/2029	EUR	300	2.100	
XS2481287634	2,7500 % Investor AB - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	200	2.346	
XS2577054716	4,0000 % Länsförsäkringar Bank AB - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	217	2.055	
XS2679903950	4,1250 % LSEG Netherlands B.V. - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	100	2.703	
FR0014008JQ4	2,5000 % Mercialis - Bonds 2022/2029	EUR	100	1.900	
FR001400F703	3,1250 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	0	1.300	
FR001400DT99	3,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2022/2027	EUR	100	1.400	
FR001400IJT3	3,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	400	1.700	
FR001400F711	3,3750 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2034	EUR	0	1.300	
FR001400DTA3	3,5000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	0	1.300	
FR001400IJU1	3,5000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	400	1.700	

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
XS2607381436	4,2500 % Securitas Treasury Ireland DAC - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	200	2.436	
XS2489775580	3,5000 % SES S.A. - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	205	2.987	
XS2616008541	3,7500 % Sika Capital B.V. - Guaranteed Registered Notes 2023/2026	EUR	300	3.366	
XS2619751576	3,8750 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	699	699	
XS2579319513	3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	1.060	1.060	
XS2629064267	4,2500 % Stora Enso Oyj - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	217	2.055	
FR001400DQ92	5,0000 % Suez S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	1.600	1.600	
XS2485152362	2,1000 % Swedbank AB - Anleihe 2022/2027	EUR	746	746	
XS2589907653	5,5000 % UBS AG - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	105	2.887	
XS2478685931	2,2500 % UPM Kymmene Corp. - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	217	2.055	
XS2449928543	1,5000 % Vestas Wind Systems Finance BV - Anleihe 2022/2029	EUR	217	2.055	
XS2449929517	2,0000 % Vestas Wind Systems Finance BV - Medium Term Notes 2022/2034	EUR	217	2.055	
XS2530756191	3,0000 % Wolters Kluwer N.V. - Senior Notes 2022/2026	EUR	217	2.055	
FR001400KLT5	4,1250 % Worldline S.A. - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	200	2.400	
FR001400U2E7	5,2500 % Worldline S.A. - Medium Term Notes 2024/2029	EUR	300	2.100	
FR0014010A08	5,5000 % Worldline S.A. - Medium Term Notes 2025/2030	EUR	1.500	1.500	

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

## Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich für den Zeitraum vom 01.03.2025 bis zum 28.02.2026

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		953.685,90	0,331
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		7.963.296,77	2,766
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		31.524,52	0,011
4. Sonstige Erträge		0,03	0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>8.948.507,22</b>	<b>3,108</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-454.346,63	-0,158
2. Sonstige Aufwendungen		-94,17	0,000
davon: Sonstiges	-94,17		0,000
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-454.440,80</b>	<b>-0,158</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>8.494.066,42</b>	<b>2,950</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		2.438.775,55	0,847
2. Realisierte Verluste		-1.270.047,37	-0,441
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>1.168.728,18</b>	<b>0,406</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>9.662.794,60</b>	<b>3,356</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-2.666.687,88	-0,926
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-449.277,75	-0,156
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-3.115.965,63</b>	<b>-1,082</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>6.546.828,97</b>	<b>2,274</b>
<b>Entwicklung des Sondervermögens</b>		<b>2025 / 2026</b>	
	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>269.862.500,45</b>	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.727.672,81	
2. Zwischenausschüttungen		-7.072.274,91	
3. Mittelzufluss (netto)		-11.828.811,41	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	43.048.271,30		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-54.877.082,71		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		28.290,25	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		6.546.828,97	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-2.666.687,88		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-449.277,75		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>255.808.860,54</b>	

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>13.409.368,68</b>	<b>4,657</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		3.746.574,08	1,301
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		9.662.794,60	3,356
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>4.580.745,78</b>	<b>1,591</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		4.580.745,78	1,591
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>8.828.622,90</b>	<b>3,066</b>
1. Zwischenausschüttung		7.072.274,91	2,456
2. Endausschüttung		1.756.347,99	0,610

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

## Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre Geschäftsjahr

	Sondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2025/2026	255.808.860,54	88,85
2024/2025	269.862.500,45	89,66
2023/2024	348.943.014,64	87,42
2022/2023	328.341.175,35	84,24

# Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

## Anhang.

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	88,85
Umlaufende Anteile	STK	2.879.259,00

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

87,20

### 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 28.02.2026 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 28.02.2026 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 %)

0,18

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

### Transaktionskosten

EUR

0,00

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 Market Maker ersetzt und dem Sondervermögen gutgeschrieben. Die oben genannten Transaktionskosten reduzieren sich deshalb um folgenden Betrag:**

EUR

0,00

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)	0,21
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,20

Der im Geschäftsjahr 2025/2026 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 Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen ist Korrektur Anteilscheingeschäften in Höhe von EUR -30,10, Zinskorrektur von XS2839008948 in Höhe von EUR -86,57 und Belastungen bezüglich Dauerhaftem Datenträger in Höhe von EUR -56,94 enthalten.

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

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

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

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

### Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken:

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

### Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten:

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

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

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

### Einsatz von Stimmrechtsberatern:

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

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

Auf inländischen Hauptversammlungen von börsennotierten Aktiengesellschaften übt die Kapitalverwaltungsgesellschaft das Stimmrecht entweder selbst oder über Stimmrechtsvertreter aus. 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 Mitarbeiter und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

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

### **Bemessung des Bonuspools**

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

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

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

### **Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern**

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

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

### **Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems**

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2025 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 2025 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

	<b>EUR</b>
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung</b>	<b>73,3 Mio.</b>
davon feste Vergütung	55,4 Mio.
davon variable Vergütung	17,9 Mio.
Zahl der Mitarbeiter der KVG	516,00
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**</b>	<b>8,9 Mio.</b>
Geschäftsführer	2,5 Mio.
weitere Risktaker	2,9 Mio.
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	0,4 Mio.
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risktaker	3,1 Mio.

\* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt; rundungsbedingte Abweichungen möglich

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

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

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

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

**Name des Produkts:**

Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

**Unternehmenskennung (LEI-Code):**

5299006NGBYLKA0NUU17

## Nachhaltiges Investitionsziel

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 99,33%

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 EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF ist ein passiv gemanagter börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF), der den MSCI EUR Corporates IG Climate Change ESG Select CTB (Preisindex) nachbildet. Der zugrundeliegende Index umfasst Aktien von großen und mittelgroßen Unternehmen aus Industriestaaten der Eurozone 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 gewichteten absoluten CO2-Emissionen des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindexe signifikant zu reduzieren. Dazu wurden Unternehmen anhand des „Low Carbon Transition Scores“ (nachfolgend „LCT-Score“) bei der Aufnahme in den Index selektiert. 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 CO<sub>2</sub>-Intensität eines Unternehmens. Die CO<sub>2</sub>-Intensität ist eine Kennzahl, die ausdrückt, wie hoch die CO<sub>2</sub>-Emissionen im Verhältnis zum Unternehmenswert (EVIC = enterprise value including cash) sind.

- 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.

Für das Sondervermögen durfte nicht in Wertpapiere von Unternehmen investiert, sowie Bankguthaben bei Kreditinstituten angelegt werden, die

- Einnahmen aus der Herstellung oder dem Vertrieb gemäß internationalen Konventionen (z.B. Chemiewaffenkonvention) geächteter Waffen und/oder Atomwaffen generierten oder die in anderer Weise mit umstrittenen Waffen oder Atomwaffen in Verbindung standen;
- am Anbau und der Produktion von Tabak beteiligt waren oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus dem Vertrieb von Tabakerzeugnissen oder damit in Verbindung stehender Lizenzierung erzielten;
- gegen die Grundsätze der Initiative „Global Compact“ der Vereinten Nationen (UNGC) oder gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen verstießen oder mit sehr schwerwiegenden Kontroversen in Bezug auf ESG-Themen konfrontiert waren (dies ist der Fall, wenn das Unternehmen durch MSCI Solutions LLC mit einem „MSCI ESG Controversy Score“ von 0 bewertet wurde);
- Einnahmen mit der Exploration, dem Abbau, der Förderung, dem Vertrieb oder der Veredelung von Kohle erzielen, ihren eigenen Angaben zufolge Kohle fördern oder 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus Kohleverstromung erzielen;
- 10 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Exploration, der Förderung, dem Vertrieb oder der Veredelung von Erdöl erzielen;
- 10 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Exploration, der Förderung, der Herstellung oder dem Vertrieb von gasförmigen Brennstoffen erzielen und/oder
- 50 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Stromerzeugung mit einer THG-Emissionsintensität von mehr als 100 g CO<sub>2</sub> e/kWh erzielen.

Mindestens 95 % des Wertes des Sondervermögens wurden nach einer ESG-Strategie verwaltet. Mit Ausnahme von Bankguthaben wurden, ausschließlich nachhaltige Investitionen i.S.d. Artikel 2 Nr. 17 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung) getätigt.

Das nachhaltige Investitionsziel des Fonds war es, die gewichtete CO<sub>2</sub>-Intensität des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant zu reduzieren. Der Index erfüllte zudem die Anforderungen an EU Referenzwerte für den klimabedingten Wandel (EU Climate Transition Benchmarks, EU CTB) der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1818. Hiermit wurde dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung getragen.

Im Rahmen der ESG-Strategie kamen Mindestausschlüsse zum Einsatz (sog. Negativ-Screening).

Es wurden Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die

- Einnahmen aus der unkonventionellen oder arktischen Erdöl- oder Erdgasförderung generierten oder ihren eigenen Angaben zufolge Erdöl oder Erdgas in arktischen Gebieten förderten und/oder
- Einnahmen aus dem Abbau, der Exploration und aus Dienstleistungen für Ölsand und Ölschiefer generierten oder ihren eigenen Angaben zufolge Erdöl oder Erdgas mit der Methode des hydraulischen Frackings oder Ölsand förderten.

Zudem umfasste der Index keine Wertpapiere von Unternehmen, die

- 5 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Produktion von Handfeuerwaffen oder damit in Verbindung stehenden Dienstleistungen,
- 5 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Produktion von Waffensystemen, Komponenten oder unterstützenden Systemen für Waffen oder damit in Verbindung stehenden Dienstleistungen,
- 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Förderung von Erdöl und Erdgas und/oder

- 5 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Lieferung wichtiger nuklearspezifischer Produkte oder Dienstleistungen für die Kernkraftindustrie, der Stromerzeugung aus Kernenergie oder aus dem Uranabbau generierten.

Weiterhin waren im Index keine Wertpapiere von Unternehmen enthalten, die

- mit sehr schwerwiegenden oder schwerwiegenden Kontroversen in Bezug auf Umweltthemen konfrontiert waren (dies ist der Fall, wenn das Unternehmen durch MSCI Solutions LLC mit einem "MSCI ESG Environmental Controversy Score" von 1 oder 0 bewertet wird),
- in den letzten drei Jahren mehr als eine schwere oder sehr schwere Kontroverse im Zusammenhang mit Menschenrechtsverletzungen hatten,
- ein ESG-Rating von "CCC" oder "B" von MSCI Solutions LLC, kein ESG-Rating oder keinen LCT-Score aufwiesen,
- eine CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität (gemessen in Scope 1 und 2 CO<sub>2</sub> e/Mio. USD-Umsatz) von 1.500 oder mehr hatten und/oder
- eine Energieverbrauchsintensität (gemessen in GWh/Mio. EUR Umsatz) von 300 oder mehr aufwiesen.

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 gewichteten absoluten CO<sub>2</sub>-Emissionen 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 das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erfüllt wurde, wird anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Details zur Ausprägung der Nachhaltigkeitsindikatoren im Berichtszeitraum finden sich im folgenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“.

### ● **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. CO<sub>2</sub>-Emissionen

Der Indikator „CO<sub>2</sub>-Emissionen“ betrug im Berichtszeitraum 7.934.739,84 tCO<sub>2</sub>e der im Finanzprodukt enthaltenen Unternehmen.

Die wurde erreicht durch die Selektion der Anleihen im Index anhand der LCT-Scores der Emittenten. Dadurch werden Anleihen derjenigen Unternehmen aufgenommen, die dazu beitragen, dass CO2-Emissionen reduziert werden und die über ein zukunftsfähiges Geschäftsmodell verfügen.

Der Indikator berechnet sich aus den nach Anteil der Unternehmen am Fondsvolumen gewichteten CO2-Emissionen der Unternehmen, gemessen in tCO2e. Der Indikator basiert auf Daten von MSCI Solutions LLC und spiegelt die Datenlage an den Quartalsstichtagen des Berichtszeitraums wider.

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

Referenzperiode	01.03.2025 - 28.02.2026	29.02.2024 - 28.02.2025	01.03.2023- 29.02.2024	01.03.2022- 28.02.2023
Anzahl Verletzungen der Ausschlusskriterien	0,00	0,00	0,00	0,00
	Verletzungen	Verletzungen	Verletzungen	Verletzungen
CO2-Emissionen	7.934.739,84 tCO2e	8.889.404,48 tCO2e	9.327.125,34 tCO2e	10.737.489,73 tCO2e
Anteil nachhaltige Investitionen	99,33%	99,56%	99,52%	31,50%
Anteil Investitionen mit Umweltziel	99,33%	99,56%	99,52%	24,75%
Anteil der taxonomiekonformen Investitionen	6,12%	0,00%	0,00%	0,00%
Anteil Investitionen mit anderen Umweltzielen	93,21%	99,56%	99,52%	24,75%
Anteil Investitionen mit sozialem Ziel	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Anteil nicht nachhaltige Investitionen	0,67%	0,44%	0,48%	68,50%

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)
- 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 CO<sub>2</sub>-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 Solutions 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 Solutions 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 Solutions 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 CO<sub>2</sub>-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)
- CO<sub>2</sub>-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: 01.03.2025 - 28.02.2026

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
Deutsche Boerse AG Anl. 23/33 (DE000A351ZT4)	Finanzdienstleistungen	1,14%	Deutschland
British Telecommunications PLC MTN 24/34 (XS2839008948)	Telekommunikationsdienste	1,09%	Vereinigtes Königreich
Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 25/34 (XS2984223102)	Telekommunikationsdienste	1,07%	Spanien
Novo Nordisk Finance [NL] B.V. MTN 24/34 (XS2820460751)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,06%	Niederlande
British Telecommunications PLC MTN 23/31 (XS2582814039)	Telekommunikationsdienste	1,06%	Vereinigtes Königreich
Novo Nordisk Finance [NL] B.V. MTN 24/31 (XS2820455678)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,03%	Niederlande
Novo Nordisk Finance [NL] B.V. MTN 24/29 (XS2820454606)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,03%	Niederlande
Deutsche Boerse AG Anl. 23/29 (DE000A351ZS6)	Finanzdienstleistungen	1,02%	Deutschland
Unibail-Rodamco-Westfield SE MTN 23/30 (FR001400MLN4)	Immobilienvermögensgesellschaften	1,02%	Frankreich
AstraZeneca PLC MTN 23/32 (XS2593105476)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,01%	Vereinigtes Königreich
JAB Holdings B.V. Notes 24/34 (DE000A3LXSR7)	Finanzdienstleistungen	1,00%	Niederlande
MSD Netherlands Capital B.V. Notes 24/32 Reg.S (XS2825485183)	Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	1,00%	Niederlande
Generali S.p.A. MTN 24/34 (XS2747596315)	Versicherungen	0,99%	Italien
Compass Group PLC MTN 24/31 (XS2758114321)	Dienstleistungsunternehmen	0,99%	Vereinigtes Königreich
Téléperformance SE MTN 23/28 (FR001400M2F4)	Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	0,97%	Frankreich



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

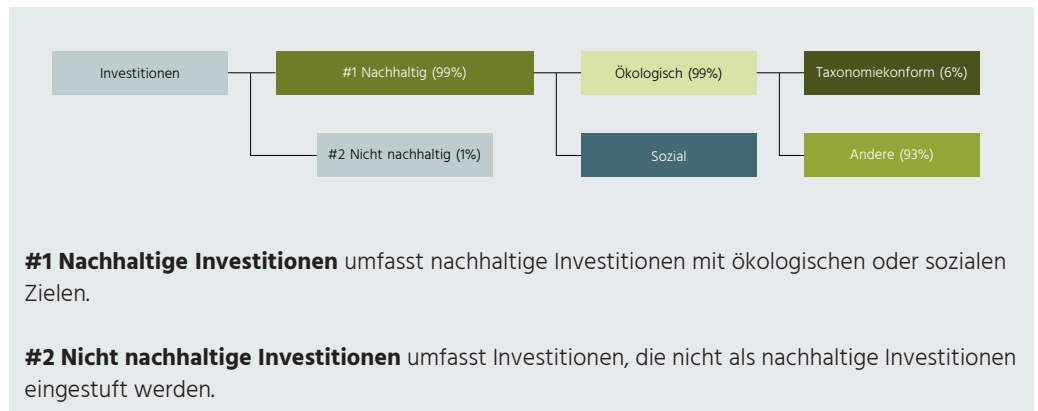
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels beitrugen (#1 Nachhaltig) betrug im Berichtszeitraum 99,33%. 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 Teilspektoren das Finanzprodukt während des Berichtszeitraums investierte, ist in der nachfolgenden Tabelle dargestellt.

Die Zuteilung der Investitionen zu den Sektoren und Teilspektoren 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 2,65% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Zur Berechnung des Anteils der Investitionen in Sektoren und Teilspektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Daten des externen Researchanbieters MSCI Solutions 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.

<b>Sektor</b>	<b>Anteil</b>
<b>Basiskonsumgüter</b>	<b>5,63%</b>
Haushaltsartikel & Pflegeprodukte	0,92%
Lebensmittel, Getränke & Tabak	0,37%
Vertrieb und Einzelhandel von Basiskonsumgütern	4,34%
<b>Finanzwesen</b>	<b>32,74%</b>
Banken	8,75%
Finanzdienstleistungen	17,55%
Versicherungen	6,44%
<b>Gesundheitswesen</b>	<b>8,81%</b>
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	1,85%
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	6,96%
<b>Immobilien</b>	<b>5,48%</b>
Gebäudemanagement & Immobilienentwicklung	1,74%
Immobilienvermögensgesellschaften	3,74%
<b>Industrie</b>	<b>12,07%</b>
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	5,21%
Investitionsgüter	5,89%
Transportwesen	0,97%
<b>Informationstechnologie</b>	<b>2,91%</b>
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	0,16%
Hardware & Ausrüstung	1,23%
Software & Dienste	1,52%
<b>Kommunikationsdienste</b>	<b>6,40%</b>
Medien & Unterhaltung	0,91%
Telekommunikationsdienste	5,49%
<b>Nicht-Basiskonsumgüter</b>	<b>7,03%</b>
Automobile & Komponenten	1,80%
Dienstleistungsunternehmen	2,96%
Gebrauchsgüter & Bekleidung	0,88%
Vertrieb u. Einzelhandel für Nicht-Basiskonsumgüter	1,39%
<b>Quasi- &amp; Fremdwährungs-Staatsanl.</b>	<b>0,53%</b>
Quasi- & Fremdwährungs-Staatsanleihen	0,53%
<b>Roh-, Hilfs- &amp; Betriebsstoffe</b>	<b>4,08%</b>
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	4,08%
<b>Sonstige</b>	<b>0,67%</b>
Sonstige	0,67%
<b>Versorgungsbetriebe</b>	<b>13,64%</b>
Versorgungsbetriebe	13,64%



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

Das Finanzprodukt strebte keine nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das mit der EU-Taxonomie konform ist, an. Dennoch investierte das Finanzprodukt im Berichtszeitraum in taxonomiekonforme Wirtschaftsaktivitäten und trug damit zu mindestens einem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele bei. Der Anteil der taxonomiekonformen Investitionen betrug 6,12% (gemessen am Leistungsindikator Umsatz).

Wenn der Fonds im Berichtszeitraum einen Anteil an Investitionen in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ausweist, ergibt sich dieser aus Beteiligungen an Finanzunternehmen, die ihrerseits in entsprechende EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten investiert waren oder durch Unternehmen, deren Umsätze im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie unter den zulässigen Schwellen lagen. Bei sehr geringen Investitionen in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie kann der Fall auftreten, dass in den folgenden Abschnitten zwar entsprechende Investitionen bestätigt werden, diese aber aufgrund von Rundungen mit 0% ausgewiesen werden.

Die folgende Tabelle zeigt für den Berichtszeitraum den jeweiligen Anteil taxonomiekonformer Wirtschaftsaktivitäten zu einem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele (gemessen am Leistungsindikator Umsatz).

<b>Umweltziel</b>	<b>Anteil</b>
Klimaschutz	5,92%
Anpassung an den Klimawandel	0,02%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-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?**

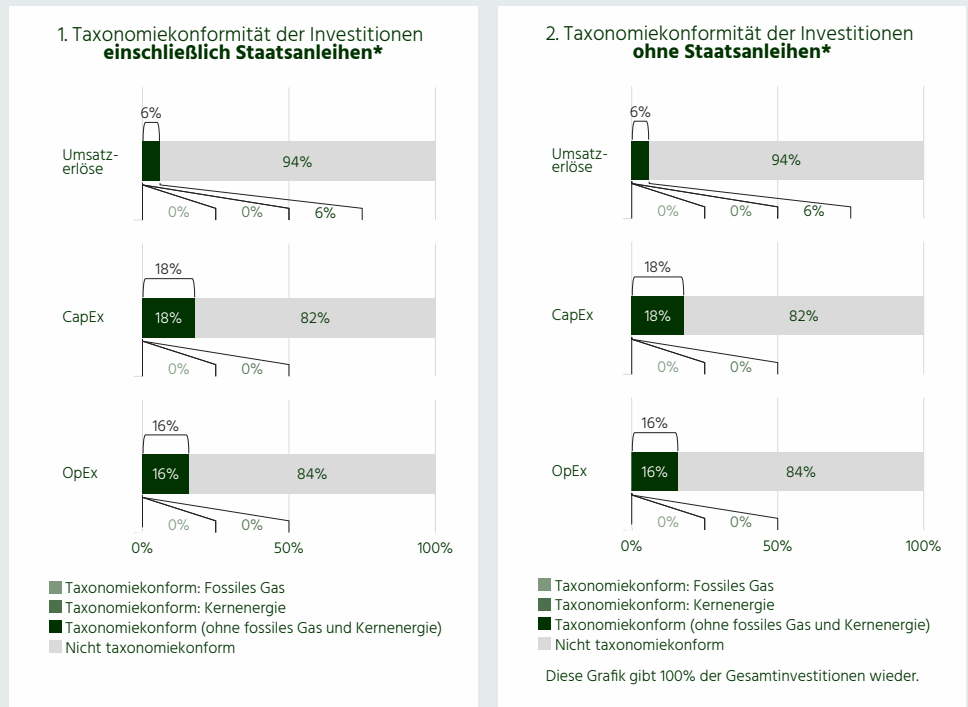
- Ja:
- In fossiles Gas       In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup>Tätigkeiten 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 CO<sub>2</sub>-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	4,71%
Übergangstätigkeiten	0,15%

 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 CO<sub>2</sub>-Intensität des Portfolios gegenüber eines breiten Marktindex signifikant reduziert. Zudem musste der Index sicherstellen, dass die gewichteten absoluten CO<sub>2</sub>-Emissionen im Durchschnitt jährlich um mindestens 7 % sinken. So wird dafür Sorge getragen, dass die gewichteten absoluten CO<sub>2</sub>-Emissionen einem Transitionsfad folgen, 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 93,21%.

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. 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 EUR Corporates IG Climate Change ESG Select CTB (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 CO<sub>2</sub>-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?**

01.03.2025 - 28.02.2026	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF
CO2-Emissionen (in tCO2e)	7.934.739,84

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

01.03.2025 - 28.02.2026	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF	Referenzindex
CO2-Emissionen (in tCO2e)	7.934.739,84	7.993.234,16

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

01.03.2025 - 28.02.2026	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF	Breiter Marktindex
CO2-Emissionen (in tCO2e)	7.934.739,84	43.000.626,94

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 Solutions 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 EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF

---

Frankfurt am Main, den 26. Mai 2026  
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 EUR Corporates Climate Change ESG CTB UCITS ETF – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. März 2025 bis zum 28. Februar 2026, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2026, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. März 2025 bis zum 28. Februar 2026 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“ aufgeführten sonstigen Informationen sind nicht Bestandteil der Prüfung des Jahresberichts und wurden daher im Einklang mit den gesetzlichen Vorschriften bei der Bildung des Prüfungsurteils zum Jahresbericht nicht einbezogen.

Nach unserer Beurteilung entspricht der beigefügte Jahresbericht aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse 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. Wir geben kein Prüfungsurteil zu den im Abschnitt „Sonstige Informationen“ aufgeführten sonstigen Informationen ab.

### 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 der Deka Investment GmbH sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen 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 Jahresbericht erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir in diesem Vermerk weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

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

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht oder zu unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

### Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Deka Investment GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung 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 einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens 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 im Jahresbericht aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, 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 eine aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellung nicht aufgedeckt wird, ist höher als das Risiko, dass eine aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellung nicht aufgedeckt wird, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- erlangen wir ein Verständnis von den für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollen, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit der internen Kontrollen der Deka Investment GmbH bzw. dieser Vorkehrungen und Maßnahmen 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 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 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 in internen Kontrollen, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 28. Mai 2026

## Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Andreas Koch  
Wirtschaftsprüfer

Leon Butzbach  
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 2024

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 112,8 Mio.

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Große Gallusstraße 14  
60315 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Prof. Dr. Thorsten Neumann  
Lehrstuhl für Volkswirtschaftslehre, Statistik und Asset Management der Hochschule Neu-Ulm, Kronberg

Peter Scherkamp, München

Dr. Bernd Türk, Frankfurt am Main

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Große Gallusstraße 14  
60315 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 28. Februar 2026

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



**Deka Investment GmbH**

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

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

