

## Änderung der Besonderen Anlagebedingungen zum 19. September 2022

Die Deka Investment GmbH („Gesellschaft“) ändert mit Genehmigung der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) mit Wirkung zum 19. September 2022 die Besonderen Anlagebedingungen („BAB“) für das von ihr verwaltete Wertpapierindex-Sondervermögen „**Deka EURO STOXX 50® ESG UCITS ETF**“ (ISIN: DE000ETFL466).

Anstelle des bislang nachgebildeten „EURO STOXX 50® ESG“ (Preisindex) wird künftig der „EURO STOXX 50® ESG Filtered“ (Preisindex) nachgebildet. Im Zuge dieser Umstellung wird das Sondervermögen in „Deka EURO STOXX 50® ESG Filtered UCITS ETF“ umbenannt.

Das Anlagekonzept des Fonds wird in diesem Zusammenhang nicht grundlegend geändert. Vielmehr wird weiterhin in denselben Kreis von Unternehmen investiert, die auch im bislang nachgebildeten Index „EURO STOXX 50® ESG“ sind. Gleichzeitig werden künftig erweiterte Nachhaltigkeitsaspekte im Index Berücksichtigung finden. Konkret berücksichtigt der künftig nachgebildete Index „EURO STOXX 50® ESG Filtered“ bei der Auswahl der Indexkonstituenten ESG-Kriterien, welche im Detail den nachfolgend abgedruckten BAB entnommen werden können.

Zudem wird der Abschluss von Wertpapier-Darlehensgeschäften ausgeschlossen sowie die Mindestkapitalbeteiligungsquote von derzeit 51 % des Wertes des Fondsvermögens auf künftig mindestens 80 % des Aktivvermögens des Fonds angehoben.

Schließlich wird neben redaktionellen Anpassungen die Anlagegrenze für Anteile an Investmentvermögen von derzeit 10 % auf künftig 5 % des Fondsvermögens gesenkt.

\*\*\*

Die BAB werden wie nachfolgend aufgeführt geändert:

Die Präambel wird geändert und erhält folgenden Wortlaut:

### Besondere Anlagebedingungen

zur Regelung des Rechtsverhältnisses zwischen den Anlegern und der Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main, („Gesellschaft“) für das von der Gesellschaft verwaltete Wertpapierindex-Sondervermögen gemäß der OGAW-Richtlinie

Deka EURO STOXX 50® ESG Filtered UCITS ETF,

die nur in Verbindung mit den für dieses Sondervermögen von der Gesellschaft aufgestellten „Allgemeinen Anlagebedingungen“ (AAB) für Wertpapierindex-Sondervermögen gelten.

§ 1 Abs. 2 wird geändert und erhält folgenden Wortlaut. § 1 Abs. 4 wird eingefügt. Die nachfolgende Nummerierung verschiebt sich entsprechend.

#### § 1 Vermögensgegenstände

(...)

2. Die Auswahl der für das Sondervermögen zu erwerbenden Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den EURO STOXX 50® ESG Filtered (Preisindex) nachzubilden.

(...)

4. Abweichend von § 13 AAB dürfen Wertpapier-Darlehensgeschäfte für das Sondervermögen nicht abgeschlossen werden.

(...)

§ 2 wird geändert und erhält folgenden Wortlaut:

#### § 2 Anlagegrenzen

1. § 11 AAB ist bei den Anlagegrenzen zu berücksichtigen. Nach § 209 KAGB können die in § 206 KAGB festgelegten Aussteller- und Anlagegrenzen überschritten werden, wenn dies zur Nachbildung des EURO STOXX 50® ESG Filtered (Preisindex) notwendig ist.

2. Der Index EURO STOXX 50® ESG Filtered berücksichtigt bei der Auswahl der Indexkonstituenten E (Environmental/Umwelt), S (social/sozial) und G (Governance/Unternehmensführung) -Kriterien (ESG-Kriterien) und setzt bei der Indexzusammensetzung auf Aktien von großen Unternehmen mit Sitz in der Eurozone.

Es kommen Mindestausschlüsse zum Einsatz (sog. Negativ-Screening). So werden keine Unternehmen in den Index aufgenommen, die Umsätze aus der Produktion und dem Vertrieb von geächteten Waffen im Sinne internationaler Konventionen, aus der Förderung von Kohle, dem Abbau, der Exploration und aus Dienstleistungen für Ölsand und Ölschiefer oder Umsätze im Zusammenhang mit sonstiger unkonventioneller Öl- und Erdgasförderung erzielen. Nicht enthalten sind zudem Unternehmen, die Umsätze in den Geschäftsfeldern Rüstungsgüter, Handfeuerwaffen, aus der Förderung von Erdöl oder der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz von Atomstrom (jeweils mehr als 5 %) sowie Umsätze aus der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz aus und von fossilen Brennstoffen (exklusive Erdgas) (mehr als 10 %) generieren. Unternehmen die Tabakwaren produzieren oder Umsätze aus dem Vertrieb oder durch Dienstleistungen mit Tabakwaren (mehr als 5%) erzielen werden ebenfalls ausgeschlossen.

Außerdem werden Unternehmen nicht in den Index aufgenommen, wenn sie eine Energieverbrauchsintensität (gemessen in GWh/ Mio. Euro Umsatz) von mehr als 300, sowie eine CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität (gemessen in Scope 1 und 2 t CO<sub>2</sub>e/ Mio. USD Umsatz) von mehr als 1.500 aufweisen. Unternehmen, die in Verbindung zu Umweltverstößen stehen, die nach Einstufung von Institutional Shareholder Services Inc. (nachfolgend „ISS ESG“) als „severe“ (schwerwiegend) oder „very severe“ (sehr schwerwiegend) eingestuft werden, sind nicht Bestandteil des Index.

Zudem enthält der Index nur Unternehmen, die bei ihrer Geschäftstätigkeit Verfahrensweisen einer nachhaltigen und verantwortungsvollen Unternehmensführung und somit die in Art. 2 Nr. 17 der Verordnung (EU) 2019/2088 genannten Governance-Aspekte, insbesondere im Hinblick auf Managementstrukturen, den Beziehungen zu den Arbeitnehmern, der Vergütung von Mitarbeitern sowie der Einhaltung von Steuervorschriften, beachten. Dies wird dadurch sichergestellt, dass alle Unternehmen aus dem Index ausgeschlossen werden, die gegen Verhaltensweisen zentraler normativer Rahmenbedingungen verstoßen, wie sie im UN Global Compact, den OECD Guidelines for Multinational Enterprises (OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen), den UN Guiding Principles for Business and Human Rights (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) oder den Sustainable Development Goals (Ziele für nachhaltige Entwicklung) verankert sind oder die nach Einstufung von ISS ESG Verstöße gegen fundamentale Menschenrechte begehen, die als „very severe“ (sehr schwerwiegend) eingestuft werden.

Über diese Mindestausschlüsse hinausgehend kann der Index weitere ESG-Ausschlusskriterien sowie strengere Umsatzschwellen aufnehmen. In diesem Fall sind diese dem Verkaufsprospekt zu entnehmen.

Schließlich nimmt die Gesellschaft ihre Rolle als Investor aktiv wahr und setzt sich durch gezielte Ausübung von Stimmrechten sowie im direkten Dialog mit den Emittenten für eine nachhaltige Unternehmensführung ein (sog. Engagement).

Durch das im Index verankerte Negativ-Screening sowie das Engagement, stellt die Gesellschaft sicher, dass keines der in Art. 2 Nr. 17 der Verordnung (EU) 2019/2088 genannten Umwelt- und Sozialziele erheblich beeinträchtigt wird.

3. Bis zu 5 % des Wertes des Sondervermögens dürfen in Anteilen an Investmentvermögen nach § 4 Absatz 3 und § 8 AAB angelegt werden, die ihrerseits in Vermögensgegenstände gemäß § 1 investieren.

4. Vorbehaltlich der in § 1 Absatz 2 und 3 sowie vorbehaltlich der in den vorstehenden Absätzen 1 bis 3 festgelegten Anlagegrenzen gilt zudem, dass mindestens 80 % des Aktivvermögens (die Höhe des Aktivvermögens bestimmt sich nach dem Wert der Vermögensgegenstände des Investmentfonds ohne Berücksichtigung von Verbindlichkeiten) des Sondervermögens in solche Kapitalbeteiligungen im Sinne des § 2 Absatz 8 Investmentsteuergesetz (InvStG) angelegt werden, die nach diesen Anlagebedingungen für das Sondervermögen erworben werden können. Dabei können die tatsächlichen Kapitalbeteiligungsquoten von Ziel-Investmentfonds berücksichtigt werden.

*§ 3 wird geändert und erhält folgenden Wortlaut:*

### **§ 3 Anteilklassen**

Alle Anteile haben gleiche Rechte; verschiedene Anteilklassen gemäß § 16 Absatz 3 AAB werden nicht gebildet.

*§ 6 Abs. 5 wird gelöscht. Die nachfolgende Nummerierung verschiebt sich entsprechend.*

*§ 7 Abs. 1 wird geändert und erhält folgenden Wortlaut:*

### **§ 7 Ausschüttung**

1. Die Gesellschaft schüttet grundsätzlich die während des Geschäftsjahres für Rechnung des Sondervermögens angefallenen und nicht zur Kostendeckung verwendeten Zinsen, Dividenden und sonstigen Erträge – unter Berücksichtigung des zugehörigen Ertragsausgleichs – aus. Realisierte Veräußerungsgewinne – unter Berücksichtigung des zugehörigen Ertragsausgleichs – können ebenfalls zur Ausschüttung herangezogen werden.

(...)

*§ 8 wird geändert und erhält folgenden Wortlaut:*



## § 8 Geschäftsjahr

Das Geschäftsjahr des Sondervermögens beginnt am 1. Februar und endet am 31. Januar des Folgejahres.

\*\*\*

Sollten Sie mit den vorgesehenen Anpassungen nicht einverstanden sein, können Sie Ihre Anteile grundsätzlich jederzeit kostenfrei zurückgeben.

Zum 19. September 2022 stehen aktualisierte Verkaufsunterlagen des Wertpapierindex-Sondervermögens zur Verfügung, die kostenfrei auf Anforderung bei der Deka Investment GmbH, Mainzer Landstraße 16, 60325 Frankfurt am Main oder unter [www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de) erhältlich sein werden.

Frankfurt am Main, im August 2022

**Deka Investment GmbH**  
**Die Geschäftsführung**