

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2020.

**Deka Oekom Euro  
Nachhaltigkeit UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Das Finanzinstrument wird von der Solactive AG (dem „Lizenzgeber“) nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt und der Lizenzgeber bietet keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung, weder hinsichtlich der Ergebnisse aus einer Nutzung des Index und/oder der Index-Marke noch hinsichtlich des Index-Stands zu irgendeinem bestimmten Zeitpunkt noch in sonstiger Hinsicht. Der Index wird durch den Lizenzgeber berechnet und veröffentlicht, wobei sich der Lizenzgeber nach besten Kräften bemüht, für die Richtigkeit der Berechnung des Index Sorge zu tragen. Es besteht für den Lizenzgeber – unbeschadet seiner Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten – keine Verpflichtung gegenüber Dritten, einschließlich Investoren und/oder Finanzintermediären des Finanzinstruments, auf etwaige Fehler in dem Index hinzuweisen. Weder die Veröffentlichung des Index durch den Lizenzgeber noch die Lizenzierung des Index sowie der Index-Marke für die Nutzung im Zusammenhang mit dem Finanzinstrument stellt eine Empfehlung des Lizenzgebers zur Kapitalanlage dar oder beinhaltet in irgendeiner Weise eine Zusicherung oder Meinung des Lizenzgebers hinsichtlich einer etwaigen Investition in dieses Finanzinstrument. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

# Bericht der Geschäftsführung.

31. Juli 2020

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2020 bis zum 31. Juli 2020.

Zu Beginn zeigten sich die internationalen Finanzmärkte noch in zuversichtlicher Verfassung. Ende Februar kippte die Stimmung jedoch schlagartig, als die Bedrohung der globalen Wirtschaftsentwicklung durch die Corona-Pandemie als solche erkennbar wurde. Die Beschränkung der Verkehrsfreiheit und weitgehende Lockdown-Maßnahmen trübten die weltweiten Konjunkturperspektiven in unvergleichbarem Ausmaß ein. Die Ende Juli veröffentlichten BIP-Daten der USA und Deutschlands für das zweite Quartal 2020 dokumentierten den dramatischen Einbruch der Wirtschaftsleistung, wobei seit Mai die Anzeichen für eine Erholung zunahmen.

Seitens der Geld- und Fiskalpolitik erfolgte als Reaktion auf die durch die Corona-Krise gestiegenen konjunkturellen Risiken die Implementierung umfangreicher Unterstützungspakete. Die EZB stockte im Verlauf der Pandemie ihr PEPP-Anleihekaufprogramm auf 1,35 Bio. Euro auf. Auch die US-Notenbank kauft mittlerweile direkt Unternehmensanleihen und senkte die Leitzinsen massiv. Zudem kündigte sie an, dass vor 2022 nicht mit Zinserhöhungen zu rechnen sei. Ende Juli rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei knapp minus 0,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries mit plus 0,5 Prozent und damit auf signifikant niedrigerem Niveau als Anfang Februar.

Die meisten Aktienmärkte wiesen in den ersten Tagen der Berichtsperiode noch Zuwächse auf, einige Indizes erklommen sogar neue Rekordmarken. Mit zunehmend pessimistischeren Pandemie-Szenarien stießen Anleger ab Ende Februar in großem Stil Aktien ab und sorgten für teils dramatische Kurseinbrüche. Die staatlichen Hilfspakete, die Versorgung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken sowie die Hoffnung auf eine Eindämmung der Pandemie sorgten im Anschluss jedoch für eine spürbare Beruhigung der Märkte. Das Gros der etablierten Aktienbörsen musste auf Halbjahressicht dennoch Einbußen hinnehmen. Stark nachgefragt waren indes Technologiewerte, deren Geschäfte durch die Pandemie-Maßnahmen teilweise einen kräftigen Schub erhielten.

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter [www.deka-etf.de](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.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Juli 2020	8
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2020	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

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

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF ist ein börsenhandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den Solactive Eurozone Sustainability Index (Preisindex) nachzubilden. Dieser Index besteht aus den 30 größten nachhaltigen Unternehmen der Eurozone, basierend auf dem Rating von Institutional Shareholder Services Inc. Die Aktien werden nach Free Float Market Cap gewichtet, wobei ein Cap pro Unternehmen bei 10 Prozent liegt. Informationen zu den Basiswerten sind unter [www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de) erhältlich. Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrunde liegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt.

Grundlage hierfür ist, dass die Entscheidungen über den Erwerb oder die Veräußerung von Vermögensgegenständen sowie über deren Gewichtung im Sondervermögen von dem zugrunde liegenden Index abhängig sind (passives Management).

Zusatzerträge können durch Wertpapierdarlehensgeschäfte erzielt werden.

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

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

## Wichtige Kennzahlen

### Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	-13,3%	-7,2%	-3,1%

ISIN DE000ETFL474

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

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. EO 1
Löschung	FR0000121261	Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom. EO 2
Löschung	DE0007100000	Daimler AG Namens-Aktien o.N.
Löschung	FR0000120644	Danone S.A. Actions Port. EO-,25
Löschung	FR0000130650	Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,50
Löschung	DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.
Löschung	FR0000121485	Kering S.A. Actions Port. EO 4
Löschung	FI0009013403	KONE Corp. (New) Registered Shares Cl.B o.N.
Löschung	FR0010307819	Legrand S.A. Actions au Port. EO 4
Löschung	FR0000120321	Oréal S.A., L Actions Port. EO 0,2
Löschung	FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.
Löschung	DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien o.N.
Löschung	FR0000130809	Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25
Löschung	FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05
Neuaufnahme	FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50
Neuaufnahme	DE0007100000	Daimler AG Namens-Aktien o.N.
Neuaufnahme	FR0000130650	Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,50
Neuaufnahme	DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.
Neuaufnahme	NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01
Neuaufnahme	IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.
Neuaufnahme	FI0009013403	KONE Corp. (New) Registered Shares Cl.B o.N.
Neuaufnahme	NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50
Neuaufnahme	FR0010307819	Legrand S.A. Actions au Port. EO 4
Neuaufnahme	FI0009013296	Neste Oyj Registered Shs o.N.
Neuaufnahme	FI0009000681	Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06
Neuaufnahme	FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port. EO 4
Neuaufnahme	DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien o.N.
Neuaufnahme	FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	12,83
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	7,49
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	6,60
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	5,30
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien o.N.	4,29
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	4,05
FR0000120628	AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	3,92
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	3,83
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	3,56
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	3,43
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	3,21
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	3,04
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	2,89
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	2,68
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	2,55
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	2,50
IE0001827041	CRH PLC Registered Shares EO -,32	2,38
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	2,34
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50	2,24
FI0009000681	Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	2,23
FI0009013403	KONE Corp. (New) Registered Shares Cl.B o.N.	2,18
FR0000130650	Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,50	2,06
FI4000297767	Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	2,04
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	1,94
FR0000133308	Orange S.A. Actions Port. EO 4	1,92
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	1,79
FR0010307819	Legrand S.A. Actions au Port. EO 4	1,74
FI0009013296	Neste Oyj Registered Shs o.N.	1,67
ES0178430E18	Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1	1,64
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	1,64

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2020.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>60.931.248,65</b>	<b>100,04</b>
1. Aktien		60.527.852,21	99,37
- Banken	9.320.621,72		15,30
- Bau und Baustoffe	3.595.430,32		5,90
- Chemische Industrie	5.355.893,20		8,79
- Einzelhandel	1.541.133,68		2,53
- Elektrik / Elektronik	13.651.495,22		22,41
- Energieversorger	1.012.629,60		1,66
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	2.401.605,70		3,94
- Pharmaindustrie / Biotech	2.450.247,03		4,02
- Software	1.247.131,30		2,05
- Sonstige Finanzdienstleistungen	1.750.535,80		2,87
- Sonstiges	1.176.591,36		1,93
- Telekommunikation	3.505.789,96		5,76
- Textilien und Kleidung	2.593.951,00		4,26
- Transportation	2.075.573,58		3,41
- Versicherungen	8.849.222,74		14,53
2. Forderungen		56.809,09	0,09
3. Bankguthaben		346.587,35	0,57
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-21.412,56</b>	<b>-0,04</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>60.909.836,09</b>	<b>100,00</b>

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



# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2020.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2020	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK		11.090	6.888	1.412	EUR 233,900	2.593.951,00	4,26	
DE0008404005	Allianz SE	STK		25.716	10.314	3.156	EUR 176,220	4.531.673,52	7,44	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		19.781	7.982	2.435	EUR 54,700	1.082.020,70	1,78	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		11.323	4.638	1.385	EUR 154,600	1.750.535,80	2,87	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		60.583	24.244	7.453	EUR 34,260	2.075.573,58	3,41	
DE0006231004	Infineon Technologies AG <sup>2)</sup>	STK		76.710	30.535	9.497	EUR 21,130	1.620.882,30	2,66	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		8.646	3.312	1.099	EUR 224,800	1.943.620,80	3,19	
							EUR	15.598.257,70	25,61	
Ausland										
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. <sup>2)</sup>	STK		28.633	29.800	1.167	EUR 139,600	3.997.166,80	6,56	
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK		27.776	11.893	3.321	EUR 42,360	1.176.591,36	1,93	
NL0010273215	ASML Holding N.V. <sup>2)</sup>	STK		25.914	10.666	3.137	EUR 299,700	7.766.425,80	12,75	
FR0000120628	AXA S.A.	STK		140.769	57.798	17.021	EUR 16,864	2.373.928,42	3,90	
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK		1.018.870	411.056	125.813	EUR 1,809	1.842.728,28	3,03	
FR0000131104	BNP Paribas S.A. <sup>2)</sup>	STK		67.908	26.895	9.798	EUR 34,115	2.316.681,42	3,80	
IE0001827041	CRH PLC	STK		46.742	17.614	6.092	EUR 30,760	1.437.783,92	2,36	
FR0000130650	Dassault Systèmes S.A. <sup>2)</sup>	STK		8.093	9.012	6.847	EUR 154,100	1.247.131,30	2,05	
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK		68.434	27.422	8.431	EUR 22,520	1.541.133,68	2,53	
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK		240.709	249.937	9.228	EUR 5,896	1.419.220,26	2,33	
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. <sup>2)</sup>	STK		886.759	970.641	83.882	EUR 1,707	1.513.874,96	2,49	
FI0009013403	KONE Corp. (New)	STK		19.625	23.692	19.751	EUR 67,240	1.319.585,00	2,17	
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V. <sup>2)</sup>	STK		10.484	10.890	406	EUR 129,600	1.358.726,40	2,23	
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. <sup>2)</sup>	STK		55.827	23.807	8.320	EUR 43,890	2.450.247,03	4,02	
FR0010307819	Legrand S.A.	STK		16.110	17.929	13.536	EUR 65,480	1.054.882,80	1,73	
FI0009013296	Neste Oyj	STK		26.045	26.045	0	EUR 38,880	1.012.629,60	1,66	
FI0009000681	Nokia Oyj	STK		332.300	345.042	12.742	EUR 4,060	1.349.138,00	2,21	
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK		188.454	84.388	75.392	EUR 6,566	1.237.388,96	2,03	
FR0000133308	Orange S.A. <sup>2)</sup>	STK		117.457	46.767	20.375	EUR 9,912	1.164.233,78	1,91	
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK		32.668	34.248	1.580	EUR 98,240	3.209.304,32	5,27	
ES0178430E18	Telefónica S.A.	STK		279.712	111.438	48.438	EUR 3,548	992.418,18	1,63	
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK		128.316	51.453	22.718	EUR 7,721	990.727,84	1,63	
FR0000125486	VINCI S.A. <sup>2)</sup>	STK		29.638	35.061	5.423	EUR 72,800	2.157.646,40	3,54	
							EUR	44.929.594,51	73,76	
							EUR	60.527.852,21	99,37	
Summe Wertpapiervermögen										
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	346.587,35	0,57
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	346.587,35	%	100,000		346.587,35	0,57	
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	56.809,09	0,09
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	56.009,15				56.009,15	0,09	
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	799,94				799,94	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-21.412,56	-0,04
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-21.412,56				-21.412,56	-0,04	
Fondsvermögen								EUR	60.909.836,09	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert							EUR	12,28		
Umlaufende Anteile							STK	4.961.859,00		

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

<sup>2)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Wertpapierdarlehen		gesamt
			befristet	unbefristet	
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl.	STK 4.044		564.542,40	
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK 10.755		3.223.273,50	
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK 10.820		369.124,30	
FR0000130650	Dassault Systèmes S.A.	STK 260		40.066,00	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK 16.171		341.693,23	
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK 75.302		128.555,57	
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.	STK 1.388		179.884,80	
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK 4.172		183.109,08	
FR0000133308	Orange S.A.	STK 16.491		163.458,79	
FR0000125486	VINCI S.A.	STK 887		64.573,60	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				5.258.281,27	5.258.281,27

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.07.2020

## 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>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE0007100000	Daimler AG	STK	40.393	40.393	
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK	6.138	6.138	
DE0007236101	Siemens AG	STK	47.156	47.156	
<b>Ausland</b>					
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK	13.634	66.604	
FR0000121261	Cie Génle Éts Michelin SCpA	STK	788	8.479	
FR0000120644	Danone S.A.	STK	2.759	29.699	
FR0000121485	Kering S.A.	STK	340	3.668	
FR0000120321	Oréal S.A., L'	STK	1.099	11.829	
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	781	8.407	
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	16.135	51.137	
ES06784309C1	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	257.873	257.873	
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield	STK	631	6.795	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			33.116

(Basiswerte: adidas AG (DE000A1EWWW0); Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. (FR0000120073); Amadeus IT Group S.A. (ES0109067019); ASML Holding N.V. (NL0010273215); AXA S.A. (FR0000120628); BNP Paribas S.A. (FR0000131104); Deutsche Post AG (DE0005552004); Industria de Diseño Textil SA (ES0148396007); Infineon Technologies AG (DE0006231004); ING Groep N.V. (NL0011821202); Koninklijke DSM N.V. (NL0000009827); Koninklijke DSM N.V. - Anrechte (NL0014926453); Koninklijke Philips N.V. (NL0000009538); Legrand S.A. (FR0010307819); Schneider Electric SE (FR0000121972); Siemens AG (DE0007236101); Société Générale S.A. (FR0000130809); UniCredit S.p.A. (IT0005239360); VINCI S.A. (FR0000125486))

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.02.2020 bis zum 31.07.2020

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		402.932,82	0,081
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		477.410,34	0,096
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		2.426,29	0,000
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-60.439,93	-0,012
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-11.489,76	-0,002
6. Sonstige Erträge		14.266,88	0,003
davon: Erstattete Quellensteuer für Vorjahre	23,97		0,000
davon: Kompensationszahlungen	14.242,91		0,003
Summe der Erträge		825.106,64	0,166
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-14,40	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-118.135,01	-0,024
3. Sonstige Aufwendungen		-626,41	0,000
davon: Bankgebühren	-9,67		0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-616,74		0,000
Summe der Aufwendungen		-118.775,82	-0,024
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		706.330,82	0,142
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		1.356.323,59	0,273
2. Realisierte Verluste		-3.793.499,34	-0,765
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-2.437.175,75	-0,491
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-1.730.844,93	-0,349
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.538.242,26	0,310
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-6.776.143,60	-1,366
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-5.237.901,34	-1,056
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-6.968.746,27	-1,404
<b>Entwicklung des Sondervermögens</b>		2020 / 2021	
	EUR	EUR	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		48.838.299,83	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-170.674,36	
2. Zwischenausschüttungen		-384.948,72	
3. Mittelzufluss (netto)		19.425.822,50	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	21.874.102,50		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-2.448.280,00		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		170.083,11	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-6.968.746,27	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	1.538.242,26		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-6.776.143,60		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		60.909.836,09	

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

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

## Anhang.

### Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 5.258.281,28

### Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)  
DekaBank Deutsche Girozentrale

	EUR	Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
<b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:</b>	<b>EUR</b>		<b>6.065.686,15</b>
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		6.065.686,15
<b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten</b>	<b>EUR</b>		<b>223.642,59</b>
<b>Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)</b>	<b>EUR</b>		<b>2.405,46</b>

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 3.207,28. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 801,82.

**Erträge aus Kompensationszahlungen in Folge von Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR 14.733,74

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	12,28
Umlaufende Anteile	STK	4.961.859,00

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)** 99,37

**Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)** 0,00

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2020 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2020 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums 0,29

### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

### Angaben zu den wesentlichen sonstigen Erträgen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Erträgen sind Kompensationszahlungen in Höhe von EUR 14.733,74 enthalten.

### Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -578,25 enthalten.

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

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

### Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	5.258.281,28
in % des Fondsvermögens	8,63

### 10 größte Gegenparteien

	Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	Sitzstaat	5.078.396,48 Deutschland
	Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	Sitzstaat	179.884,80 Deutschland

### Arten von Abwicklung und Clearing

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem) und per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte).

### Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	0,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	5.258.281,28

### Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

### Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindizes (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder dem GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter [www.eurexrepo.com](http://www.eurexrepo.com) entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag i.H.v. 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

### Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

### Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	223.642,59
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	6.065.686,15

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

# Deka Oekom Euro Nachhaltigkeit UCITS ETF

## Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	2.405,46
in % der Bruttoerträge	75,00

Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	absolut	801,82
	in % der Bruttoerträge	25,00

## Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (absoluter Betrag)

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

## Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

8,69

Die hier angegebene Prozentzahl bezieht sich auf das gesamte Wertpapiervermögen des Fonds einschließlich / ausschließlich Anteilen an Zielfonds/ Geldmarktfonds. Die Anlagebedingungen können jedoch Beschränkungen enthalten, so dass das Verleihen ggf. nur in geringerem Umfang zulässig ist.

## Zehn größte Sicherheiten ausstellende, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Investitionsbank Berlin
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.916.840,33
2. Name	Volvo Treasury AB
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.001.091,30
3. Name	Hamburgische Investitions- und Fö
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	945.460,85
4. Name	Bayerische Landesbank
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	799.882,31
5. Name	LfA Förderbank Bayern
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	554.770,98
6. Name	NRW.BANK
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	329.437,02
7. Name	The Bank of New York Mellon Corp.
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	198.356,35
8. Name	SpareBank 1 Boligkredit AS
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	174.046,32
9. Name	Bayer US Finance LLC
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	148.393,72
10. Name	Banco Santander S.A.
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	30.653,44

## Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

## Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2,00
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	4.768.187,90
Name	J.P. Morgan AG Frankfurt
verwahrter Betrag absolut	1.521.140,84

## Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften

gesonderte Konten / Depots	0,00
Sammelkonten/Depots	0,00
Andere Konten/Depots	0,00
Verwahrart bestimmt Empfänger	0,00

---

Frankfurt am Main, den 3. August 2020  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2019

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

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsischen Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)

Jörg Boysen

Thomas Ketter

Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

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

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Juli 2020

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





**Deka Investment GmbH**

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

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