

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2023.

**Deka EURO STOXX 50 ESG  
Filtered UCITS ETF**



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der EURO STOXX 50 ESG Filtered (Preisindex) ist das geistige Eigentum (inklusive registrierte Marken) der STOXX Ltd., Zug, Schweiz ("STOXX"), der Gruppe Deutsche Börse oder deren Lizenzgeber und wird unter einer Lizenz verwendet. Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF ist weder gefördert noch beworben, vertrieben oder in irgendeiner anderen Weise von STOXX, der Gruppe Deutsche Börse oder von deren Lizenzgebern, Forschungspartnern oder Datenlieferanten unterstützt und STOXX, die Gruppe Deutsche Börse und deren Lizenzgeber, Forschungspartner oder Datenlieferanten übernehmen keinerlei Gewährleistung und schliessen jegliche Haftung (aus fahrlässigem sowie aus anderem Verhalten) diesbezüglich generell aus und im speziellen in Bezug auf jegliche Fehler, Unterlassungen oder Störungen des EURO STOXX 50 ESG Filtered (Preisindex) oder der darin enthaltenen Daten. 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 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka EURO STOXX 50® ESG Filtered UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2023 bis zum 31. Juli 2023.

Der Berichtszeitraum war von uneinheitlichen konjunkturellen Signalen geprägt, gleichzeitig rückte der Ukraine-Krieg an den Märkten sukzessive in den Hintergrund. Einerseits nahmen Befürchtungen vor Versorgungsengpässen im europäischen Energiesektor angesichts des milden Winters spürbar ab. Die Teuerungsraten entfernten sich zudem im Verlauf von ihren Höchstständen. Demgegenüber hat sich zumindest in Deutschland die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,25 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 4,0 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen wies trotz zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren im Bankensektor sowie der Auswirkungen steigender Leitzinsen eine Aufwärtsbewegung aus. Insbesondere große Technologiekonzerne verbuchten starke Kurszuwächse. Der Euro bewegte sich im Verhältnis zum US-Dollar in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende Juli bei 1,10 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte unter Schwankungen seitwärts und beendete die Berichtsperiode bei 85,6 US-Dollar je Barrel (Brent).

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 2023	9
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023	10
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

**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 EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS 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 EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered (Preisindex) nachzubilden.

Der EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered Index umfasst Aktien von großen Unternehmen mit Sitz in der Eurozone. 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.

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

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

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

## Wichtige Kennzahlen

### Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	9,7%	23,4%	15,6%

**ISIN** DE000ETFL466

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01
Löschung	NL0013267909	Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder EO0,5
Löschung	NL0010545661	CNH Industrial N.V. Aandelen op naam EO -,01
Löschung	BE0974259880	Dleteren Group S.A. Parts Sociales au Port. o.N.
Löschung	DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N
Löschung	NL0011585146	Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01
Löschung	NL0015001FS8	Ferrovial International SE Registered Shares EO-,01
Löschung	ES0118900010	Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -,20
Löschung	NL0010801007	IMCD N.V. Aandelen op naam EO -,16
Löschung	ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50
Löschung	IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom. o.N.
Löschung	AT0000746409	Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N.
Neuaufnahme	BE0974259880	Dleteren Group S.A. Parts Sociales au Port. o.N.
Neuaufnahme	FR0010908533	Edenred S.A. Actions Port. EO 2
Neuaufnahme	ES0130960018	Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50
Neuaufnahme	IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1
Neuaufnahme	NL0015001FS8	Ferrovial International SE Registered Shares EO-,01
Neuaufnahme	IE0004927939	Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13
Neuaufnahme	FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40
Neuaufnahme	ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50
Neuaufnahme	BE0974320526	Umicore S.A. Actions Nom. o.N.
Neuaufnahme	IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.
Neuaufnahme	FR0013176526	Valéo S.E. Actions Port. EO 1
Neuaufnahme	FR0013447729	Verallia SA Actions Port. (Prom.) EO 3,38

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	9,45
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	9,09
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	5,57
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	4,59
FR0000120321	Oréal S.A., L Actions Port. EO 0,2	4,24
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	3,82
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	3,62
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	2,93
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	2,90
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	2,84
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	2,50
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	2,29
FR0000120628	AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	2,23
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	2,16
NL0013654783	Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	2,08
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	2,01
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	1,98
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	1,93
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	1,92
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	1,90
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	1,84
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	1,79
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	1,75
IE0001827041	CRH PLC Registered Shares EO -,32	1,68
FR0000120693	Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	1,68
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	1,60
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port. EO 4	1,56
FI4000297767	Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	1,53
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port. EO-,25	1,47
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	1,47
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	1,37
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC Registered Shares EO -,09	1,32
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	1,26
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien o.N.	1,26
FR0010307819	Legrand S.A. Actions au Port. EO 4	1,00
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.	0,85
FI0009000681	Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	0,79
FI0009013403	KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N.	0,77
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	0,72
FR0010908533	Edenred S.A. Actions Port. EO 2	0,61
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	0,60
FI0009013296	Neste Oyj Registered Shs o.N.	0,59
DE000SYM9999	Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	0,52
IE0004927939	Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13	0,47
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22	0,45
DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien o.N.	0,32

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Zusammensetzung des Index (%)

BE0974320526	Umicore S.A. Actions Nom. o.N.	0,22
FR0013176526	Valéo S.E. Actions Port. EO 1	0,18
ES0130960018	Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50	0,16
FR0013447729	Verallia SA Actions Port. (Prom.) EO 3,38	0,13



# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>138.689.641,94</b>	<b>103,74</b>
1. Aktien		133.336.070,10	99,73
- Banken	19.076.486,83		14,27
- Bau und Baustoffe	2.872.166,00		2,15
- Chemische Industrie	976.544,60		0,73
- Einzelhandel	2.129.466,94		1,59
- Elektrik / Elektronik	21.906.845,48		16,39
- Energieversorger	4.278.128,74		3,20
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	3.662.970,80		2,74
- Papier- und Verpackungsindustrie	169.464,96		0,13
- Pharmaindustrie / Biotech	15.953.775,09		11,93
- Real Estate	794.588,40		0,59
- Software	7.428.546,00		5,56
- Sonstige Dienstleistungen	811.641,04		0,61
- Sonstige Finanzdienstleistungen	1.822.829,40		1,36
- Telekommunikation	7.604.956,97		5,69
- Textilien und Kleidung	19.776.340,20		14,79
- Transportation	2.533.438,72		1,90
- Unterhaltungsindustrie	2.717.087,56		2,03
- Verbrauchsgüter	8.446.481,10		6,32
- Versicherungen	10.374.311,27		7,76
2. Forderungen		78.502,33	0,06
3. Bankguthaben		5.275.069,51	3,95
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-4.995.454,45</b>	<b>-3,74</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>133.694.187,49</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000SYM9999	Symrise AG	STK		6.922	1.802	331	EUR 99,380	687.908,36	0,51	
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK		9.153	2.523	134	EUR 184,000	1.684.152,00	1,26	
DE0006599905	Merck KGaA	STK		7.114	1.957	150	EUR 159,800	1.136.817,20	0,85	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		7.512	1.920	161	EUR 342,600	2.573.611,20	1,92	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		190.864	52.474	4.001	EUR 19,842	3.787.123,49	2,83	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		54.226	14.908	1.137	EUR 46,720	2.533.438,72	1,89	
DE0008404005	Allianz SE	STK		22.199	6.102	465	EUR 217,400	4.826.062,60	3,61	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		17.638	4.850	370	EUR 110,860	1.955.348,68	1,46	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		71.881	19.761	1.506	EUR 40,000	2.875.240,00	2,15	
DE0005439004	Continental AG	STK		5.945	1.634	124	EUR 72,620	431.725,90	0,32	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		10.458	2.875	219	EUR 174,300	1.822.829,40	1,36	
DE0007164600	SAP SE	STK		59.715	18.867	1.174	EUR 124,400	7.428.546,00	5,56	
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK		37.410	11.401	3.044	EUR 21,240	794.588,40	0,59	
							EUR	32.537.391,95	24,34	
Ausland										
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK		53.704	14.264	796	EUR 31,385	1.685.500,04	1,26	
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	STK		49.282	13.687	1.029	EUR 52,050	2.565.128,10	1,92	
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK		19.319	6.337	2.490	EUR 652,200	12.599.851,80	9,42	
FR0000120628	AXA S.A.	STK		106.351	27.094	2.410	EUR 27,970	2.974.637,47	2,22	
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK		331.912	91.251	6.957	EUR 7,210	2.393.085,52	1,79	
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK		905.666	235.401	19.373	EUR 3,684	3.336.020,71	2,50	
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK		64.462	19.052	1.312	EUR 60,020	3.869.009,24	2,89	
IE0001827041	CRH PLC	STK		41.400	11.427	1.816	EUR 54,180	2.243.052,00	1,68	
FR0000120644	Danone S.A.	STK		35.292	9.765	729	EUR 55,530	1.959.764,76	1,47	
FR0010908533	Edenred S.A.	STK		13.738	13.738	0	EUR 59,080	811.641,04	0,61	
ES0130960018	Enagas S.A.	STK		12.978	12.978	0	EUR 16,135	209.400,03	0,16	
IT0003128367	ENEL S.p.A.	STK		427.589	427.589	0	EUR 6,272	2.681.838,21	2,01	
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK		16.678	4.833	632	EUR 182,940	3.051.073,32	2,28	
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC	STK		9.712	2.683	195	EUR 180,900	1.756.900,80	1,31	
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK		1.935	529	42	EUR 2.016,500	3.901.927,50	2,92	
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK		61.174	16.818	1.282	EUR 34,810	2.129.466,94	1,59	
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK		199.226	203.762	157.561	EUR 13,280	2.645.721,28	1,98	
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK		887.984	228.813	32.309	EUR 2,629	2.334.509,94	1,75	
FR0000121485	Kering S.A.	STK		3.960	1.089	116	EUR 523,600	2.073.456,00	1,55	
IE0004927939	Kingspan Group PLC	STK		8.618	8.618	0	EUR 73,000	629.114,00	0,47	
FI0009013403	KONE Oyj	STK		22.128	6.084	464	EUR 46,640	1.032.049,92	0,77	
FR0010307819	Legrand S.A.	STK		14.686	4.037	307	EUR 91,120	1.338.188,32	1,00	
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK		14.287	3.931	361	EUR 848,100	12.116.804,70	9,06	
FI0009013296	Neste Oyj	STK		23.617	6.494	496	EUR 33,460	790.224,82	0,59	
FI0009000681	Nokia Oyj	STK		292.778	80.126	8.906	EUR 3,578	1.047.559,68	0,78	
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK		198.056	53.375	6.265	EUR 10,306	2.041.165,14	1,53	
FR0000120321	Oréal S.A., L'	STK		13.355	3.707	347	EUR 423,200	5.651.836,00	4,23	
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK		11.147	3.170	262	EUR 200,600	2.236.088,20	1,67	
NL0013654783	Prosus N.V.	STK		38.460	10.042	6.174	EUR 72,030	2.770.273,80	2,07	
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK		13.078	13.078	0	EUR 73,420	960.186,76	0,72	
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK		62.973	17.386	1.605	EUR 97,090	6.114.048,57	4,57	
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK		31.434	8.642	659	EUR 162,040	5.093.565,36	3,81	
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA	STK		77.610	21.336	1.626	EUR 7,688	596.665,68	0,45	
BE0974320526	Umicore S.A.	STK		10.722	10.722	0	EUR 26,920	288.636,24	0,22	
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK		106.825	107.564	739	EUR 23,000	2.456.975,00	1,84	
FR0013176526	Valéo S.E.	STK		11.866	11.866	0	EUR 20,550	243.846,30	0,18	
FR0013447729	Verallia SA	STK		4.203	4.203	0	EUR 40,320	169.464,96	0,13	
							EUR	100.798.678,15	75,39	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	133.336.070,10	99,73
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	5.275.069,51	3,95	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle		EUR		5.275.069,51		%	100,000	5.275.069,51	3,95	
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	78.502,33	0,06	
Dividendenansprüche		EUR		7.187,48				7.187,48	0,01	
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR		71.314,85				71.314,85	0,05	
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-4.995.454,45	-3,74	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR		-4.979.324,22				-4.979.324,22	-3,72	
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsvergütung		EUR		-16.130,23				-16.130,23	-0,01	
Fondsvermögen							EUR	133.694.187,49	100,00 <sup>1)</sup>	
Anteilwert		EUR						99,69		
Umlaufende Anteile		STK						1.341.095,00		

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.07.2023

## Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzugänge 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>					
DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG	STK	230	4.906	
<b>Ausland</b>					
NL0012969182	Adyen N.V.	STK	332	1.506	
NL0013267909	Akzo Nobel N.V.	STK	2.040	9.498	
NL0010545661	CNH Industrial N.V.	STK	11.424	51.787	
BE0974259880	D'leteren Group S.A.	STK	1.163	1.163	
NL0011585146	Ferrari N.V.	STK	1.377	6.258	
ES0118900010	Ferrovial S.A.	STK	32.826	54.920	
NL0015001FS8	Ferrovial SE	STK	0	0	
NL0010801007	IMCD N.V.	STK	115	2.455	
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	21.067	21.067	
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	23.901	108.349	
AT0000746409	Verbund AG	STK	133	2.844	

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.02.2023 bis zum 31.07.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		726.371,92	0,542
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		2.048.719,98	1,528
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		6.970,04	0,005
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-108.955,80	-0,081
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-70.538,17	-0,053
6. Sonstige Erträge		2.765,85	0,002
davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern	24,70		0,000
davon: Sonstiges	2.741,15		0,002
Summe der Erträge		2.605.333,82	1,943
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-92,24	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-91.720,38	-0,068
3. Sonstige Aufwendungen		-17,20	0,000
davon: Sonstiges	-17,20		0,000
Summe der Aufwendungen		-91.829,82	-0,068
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		2.513.504,00	1,874
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		1.918.575,51	1,431
2. Realisierte Verluste		-170.359,97	-0,127
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.748.215,54	1,304
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		4.261.719,54	3,178
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		6.788.281,64	5,062
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-457.899,78	-0,341
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		6.330.381,86	4,720
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		10.592.101,40	7,898

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023
	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	94.820.154,18
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-1.204.687,35
2. Zwischenausschüttungen	-1.749.943,95
3. Mittelzufluss (netto)	31.555.466,85
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	31.555.466,85
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-318.903,64
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	10.592.101,40
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	6.788.281,64
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-457.899,78
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	133.694.187,49

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> ESG Filtered UCITS ETF

## Anhang.

### Angaben nach der Derivateverordnung

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

#### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	99,69
Umlaufende Anteile	STK	1.341.095,00

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

**99,73**

**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 31.07.2023 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 31.07.2023 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 (annualisiert)

0,17

#### 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 Quellensteuer-Erstattungen in Höhe von EUR 2.631,97 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.

---

Frankfurt am Main, den 1. August 2023

Deka Investment GmbH

Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

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

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Juli 2023

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)

