

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2022.

**Deka STOXX® Europe Strong  
Style Composite 40 UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der STOXX® Europe Strong Style Composite 40 Index 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 STOXX® Europe Strong Style Composite 40 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 STOXX® Europe Strong Style Composite 40 Index 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 2022

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka STOXX® Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2022 bis zum 31. Juli 2022.

Beherrscht zu Beginn noch die Corona-Pandemie, die sich moderat fortsetzende Erholung der globalen Wirtschaft sowie die rasch steigenden Inflationsraten die Schlagzeilen an den Börsen, so versetzte der völkerrechtswidrige Angriff Russlands auf die Ukraine Ende Februar das Geschehen an den internationalen Kapitalmärkten in einen ausgeprägten Krisenmodus. Umfangreiche Sanktionsmaßnahmen des Westens wurden gegen den russischen Aggressor auf den Weg gebracht. Russland seinerseits verhängte Gegenmaßnahmen und stoppte die Lieferung von Gas in mehrere europäische Länder oder reduzierte die Liefermengen, was zu weiteren signifikanten Preissteigerungen bei Energie und Rohstoffen führte sowie Befürchtungen hinsichtlich einer Energie-Knappheit im nächsten Winter zur Folge hatte.

Die Geld- und Fiskalpolitik wurde in den vergangenen sechs Monaten von der rasanten Inflationsentwicklung dominiert. Sowohl die EZB als auch die Federal Reserve haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet. Darüber hinaus vollzogen beide Notenbanken die Leitzins-Wende. Während die Fed diesen im Zeitraum von März bis Juli in vier Schritten um insgesamt 225 Basispunkte erhöhte, folgte die EZB im Juli mit einer ersten Anhebung um 50 Basispunkte. Dank einer stark expansiven Finanzpolitik haben sich die USA rascher als Europa von der Pandemie erholt. Zudem trifft der Krieg gegen die Ukraine die europäische Wirtschaft um ein Vielfaches stärker, wodurch sich Zinserhöhungen für die EZB problematischer darstellen. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo kräftig an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 0,8 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 2,6 Prozent. Nahezu sämtliche bedeutenden Aktienmärkte weltweit rangierten per saldo auf negativem Terrain. Die Inflationsentwicklung, hohe Rohstoffpreise, Lieferkettenprobleme sowie der Krieg in der Ukraine setzten die Kurse in den letzten sechs Monaten wiederholt unter Druck. Insbesondere Wachstumstitel waren hiervon überdurchschnittlich stark betroffen. In China belasteten zudem Lockdown-Maßnahmen und der sich zuletzt verschärfende Taiwan-Konflikt.

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 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.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Juli 2022	8
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2022	9
Anhang	11
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 beigelegt sind, erfolgen.**

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf ausgerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 Index nachzubilden. Dieser Index bildet sowohl 20 Growth- als auch 20 Value-Unternehmen in Europa ab. Die Value/Growth- Eigenschaft der einzelnen Unternehmen wird durch die Analyse von 6 fundamentalen Kennzahlen ermittelt, z.B. Kurs/Gewinn-Verhältnis, Marktwert/Buchwert-Verhältnis, Dividendenrendite und Gewinnwachstum. 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 STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	-10,0%	-20,1%	5,7%
<b>ISIN</b>	DE000ETFLO52		

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

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	CH0012530207	Bachem Holding AG Namens-Aktien B SF 0,05
Löschung	CH0012280076	Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,10
Neuaufnahme	CH1176493729	Bachem Holding AG Namens-Aktien SF 0,01
Neuaufnahme	CH1175448666	Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
ES0165386014	Solaria Energia Y Medio Ambi. Acciones Port. EO -,01	4,65
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3	4,31
FR0013506730	Vallourec S.A. Actions Port. EO 0,02	3,94
NO0010081235	NEL ASA Navne-Aksjer NK -,20	3,80
CH0319416936	Flughafen Zürich AG Namens-Aktien SF 10	3,78
GB00BN0SMB92	Capricorn Energy PLC Registered Shs LS-,016153846	3,77
NL0012817175	Alfen N.V. Registered Shares EO -,10	3,69
SE0007640156	Scandic Hotels Group AB Namn-Aktier EO -,25	3,65
JE00BVRZ8S85	Sanne Group PLC Registered Shares LS -,01	3,20
GB00BGBN7C04	SSP Group PLC Registered Shares LS -,01085	3,15
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port. EO -,20	3,13
BE0003818359	Galapagos N.V. Actions Nom. o.N.	3,12
PLJSW0000015	Jastrzebska Spolka Weglowa S.A Inhaber-Aktien ZY 5	2,95
FR0000120404	ACCOR S.A. Actions Port. EO 3	2,78
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG Inhaber-Aktien o.N.	2,63
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC Registered Shares LS 0.20	2,58
CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	2,46
CH1175448666	Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01	2,35
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	2,34
DK0060448595	Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1	2,30
DE0006452907	Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N.	2,29
IT0004056880	Amplifon S.p.A. Azioni nom. EO -,02	2,18
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.	2,15
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	2,09
FR0000077919	JCDecaux S.A. Actions au Porteur o.N.	2,08
IT0003007728	Tods S.p.A. Azioni nom. EO 2	2,07
GB0003718474	Games Workshop Group PLC Registered Shares LS -,05	2,03
SE0012673267	Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	2,02
FR0010557264	AB Science S.A. Actions au Port. EO -,01	1,98
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.	1,85
SE0009216278	Mips AB Namn-Aktier o.N.	1,76
PLMBION00016	Mabion SA Inhaber-Aktien ZY -,10	1,74
GB00B0YG1K06	Restaurant Group PLC, The Registered Shares LS -,28125	1,74
FR0011950732	Elior Group SA Actions au Port. EO -,01	1,71
AT0000A18XM4	ams-OSRAM AG Inhaber-Aktien o.N.	1,58
CH1176493729	Bachem Holding AG Namens-Aktien SF 0,01	1,58
DK0060952919	Netcompany Group A/S Navne-Aktier DK1	1,56
PLOPTTC00011	CD Projekt S.A. Inhaber-Aktien C ZY 1	1,41
DK0060946788	Ambu A/S Navne-Aktier B DK -,50	1,15
LU2010095458	Global Fashion Group S.A. Bearer Shares EO -,01	0,42

# Deka STOXX® Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>44.382.160,94</b>	<b>100,05</b>
1. Aktien		44.568.830,81	100,47
- Aeronautik und Weltraum	1.151.385,91		2,60
- Bau und Baustoffe	6.423.721,80		14,48
- Bergbau	1.313.095,48		2,96
- Büroausstattung	697.011,15		1,57
- Einzelhandel	1.682.199,62		3,79
- Elektrik / Elektronik	1.748.899,86		3,94
- Energieversorger	5.443.262,80		12,27
- Freizeit/Tourismus	2.867.976,39		6,47
- Pharmaindustrie / Biotech	9.659.272,78		21,77
- Software	1.648.379,60		3,72
- Sonstige Dienstleistungen	1.716.229,00		3,87
- Sonstige Finanzdienstleistungen	1.427.257,19		3,22
- Sonstige industrielle Werte	2.854.781,29		6,44
- Telekommunikation	188.011,81		0,42
- Textilien und Kleidung	1.750.781,16		3,95
- Unterhaltungsindustrie	1.827.890,54		4,12
- Verbrauchsgüter	2.168.674,43		4,89
2. Forderungen		21.112,27	0,05
3. Bankguthaben		-207.782,14	-0,47
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-21.536,87</b>	<b>-0,05</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>44.360.624,10</b>	<b>100,00</b>

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



# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	6.735	258	1.034	EUR 142,100	957.043,50	2,16
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG <sup>2)</sup>		STK	26.314	1.012	4.047	EUR 44,490	1.170.709,86	2,64
DE0006452907	Nemetschek SE		STK	15.675	604	2.412	EUR 65,000	1.018.875,00	2,30
DE0006969603	PUMA SE		STK	12.598	484	1.937	EUR 65,620	826.680,76	1,86
							EUR	3.973.309,12	8,96
Ausland									
FR0010557264	AB Science S.A.		STK	118.160	4.544	18.172	EUR 7,475	883.246,00	1,99
FR0000120404	ACCOR S.A.		STK	49.073	1.886	7.546	EUR 25,280	1.240.565,44	2,80
NL0012969182	Adyen N.V.		STK	533	20	82	EUR 1.745,000	930.085,00	2,10
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.		STK	14.283	549	2.197	EUR 134,600	1.922.491,80	4,33
NL0012817175	Alfen N.V.		STK	14.491	557	2.229	EUR 113,550	1.645.453,05	3,71
DK0060946788	Ambu A/S <sup>2)</sup>		STK	46.137	1.774	7.096	DKK 82,480	511.108,24	1,15
IT0004056880	Amplifon S.p.A.		STK	30.182	1.161	4.643	EUR 32,210	972.162,22	2,19
AT0000A18XM4	ams AG		STK	87.654	3.370	13.480	CHF 7,802	704.192,46	1,59
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	1.881	73	290	EUR 555,400	1.044.707,40	2,36
CH1176493729	Bachem Holding AG		STK	10.680	10.680	0	CHF 63,850	702.175,77	1,58
GB00BN0SMB92	Capricorn Energy PLC		STK	640.443	24.623	98.488	GBP 2,198	1.680.025,91	3,79
PLOPITC00011	CD Projekt S.A.		STK	32.775	1.260	5.040	PLN 90,810	629.504,60	1,42
DK0060448595	Coloplast AS		STK	8.991	346	1.384	DKK 849,400	1.025.734,91	2,31
FR0011950732	Elior Group SCA		STK	241.008	9.266	37.063	EUR 3,164	762.549,31	1,72
SE0012673267	Evolution AB (publ)		STK	9.587	368	1.473	SEK 978,400	902.305,88	2,03
CH0319416936	Flughafen Zürich AG		STK	10.377	398	1.594	CHF 157,700	1.685.067,09	3,80
BE0003818359	Galapagos N.V. <sup>2)</sup>		STK	28.020	1.077	4.309	EUR 49,580	1.389.231,60	3,13
GB0003718474	Games Workshop Group PLC		STK	9.811	377	1.508	GBP 77,450	906.864,72	2,04
LU2010095458	Global Fashion Group S.A. <sup>2)</sup>		STK	130.022	4.999	19.995	EUR 1,446	188.011,81	0,42
PLJSW0000015	Jastrzebska Spolka Weglowa S.A.		STK	123.132	4.734	18.936	PLN 50,420	1.313.095,48	2,96
FR0000077919	JCDecaux S.A.		STK	58.842	2.262	9.048	EUR 15,730	925.584,66	2,09
PLMBION00016	Mabion SA		STK	108.016	4.153	16.611	PLN 33,990	776.536,35	1,75
SE0009216278	Mips AB		STK	15.134	582	2.328	SEK 540,000	786.144,00	1,77
NO0010081235	NEL ASA - Anrechte		STK	1.009.555	38.812	155.250	NOK 16,530	1.692.918,50	3,82
DK0060952919	Netcompany Group A/S		STK	12.782	492	1.967	DKK 406,000	697.011,15	1,57
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC		STK	1.080.706	41.550	166.194	GBP 0,893	1.151.385,91	2,60
JE00BVRZ8585	Sanne Group PLC		STK	129.989	4.998	19.991	GBP 9,200	1.427.257,19	3,22
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.		STK	3.576	138	551	EUR 389,600	1.393.209,60	3,14
SE0007640156	Scandic Hotels Group AB		STK	408.444	15.704	62.813	SEK 41,420	1.627.410,95	3,67
ES0165386014	Solaria Energia Y Medio Ambiente S.A.		STK	92.137	3.543	14.170	EUR 22,470	2.070.318,39	4,67
GB00BGBN7C04	SSP Group PLC		STK	463.308	17.813	71.249	GBP 2,543	1.406.125,12	3,17
CH1175448666	Straumann Holding AG		STK	7.970	7.970	0	CHF 127,800	1.048.824,59	2,36
GB00B0YG1K06	The Restaurant Group PLC		STK	1.282.632	49.312	197.245	GBP 0,507	775.334,90	1,75
IT0003007728	Tod's S.p.A.		STK	26.770	1.030	4.118	EUR 34,520	924.100,40	2,08
FR0013506730	Vallourec S.A.		STK	195.142	7.503	30.010	EUR 9,006	1.757.448,85	3,96
CH0311864901	VAT Group AG		STK	3.878	148	595	CHF 274,800	1.097.332,44	2,47
							EUR	40.595.521,69	91,51
							EUR	44.568.830,81	100,47
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	Verwahrstelle	NOK		44.815,79			% 100,000	4.546,36	0,01
	Verwahrstelle	PLN		19.668,83			% 100,000	4.160,07	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung	EUR		20.527,96			EUR	20.527,96	0,05
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen	EUR		584,31			EUR	584,31	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
EUR-Kredite bei:									
	Verwahrstelle	EUR		-210.149,38			% 100,000	-210.149,38	-0,47
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	Verwahrstelle	CHF		-491,38			% 100,000	-505,98	-0,00
	Verwahrstelle	DKK		-13.642,31			% 100,000	-1.832,33	-0,00
	Verwahrstelle	SEK		-22.300,68			% 100,000	-2.145,22	-0,00
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	Verwahrstelle	GBP		-1.554,86			% 100,000	-1.855,66	-0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR		-21.536,87			EUR	-21.536,87	-0,05
Fondsvermögen									
	Anteilwert	EUR					EUR	44.360.624,10	100,00 <sup>1)</sup>
							EUR	34,11	

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Umlaufende Anteile						STK	1.300.556,00	

<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 Kurswert in EUR	gesamt
			befristet	unbefristet
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
DK0060946788	Ambu A/S	STK	40.000	443.122,22
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG	STK	6.879	306.046,71
BE0003818359	Galapagos N.V.	STK	21.000	1.041.180,00
LU2010095458	Global Fashion Group S.A.	STK	130.022	188.011,81
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				1.978.360,74
				<b>1.978.360,74</b>

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurse per 29.07.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)		29.07.2022
Britisches Pfund	(GBP)	0,83790 = 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	(DKK)	7,44535 = 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	9,85750 = 1 Euro (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,72800 = 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	10,39550 = 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,97115 = 1 Euro (EUR)

## 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
ISIN					
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Ausland</b>					
CH0012530207	Bachem Holding AG	STK	0	2.382	
CH0012280076	Straumann Holding AG	STK	0	889	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
	unbefristet	EUR			5.411

(Basiswerte: Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG (DE0005773303); Galapagos N.V. (BE0003818359); Global Fashion Group S.A. (LU2010095458))

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Anhang.

### Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 1.978.360,74

### Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten	EUR		1.977.581,63

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	EUR		1.291,27
--	-----	--	----------

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 1.291,27. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.

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

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR		34,11
Umlaufende Anteile	STK		1.300.556,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

100,47

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 31.07.2022 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 31.07.2022 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

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert) 0,12

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

#### Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	1.978.360,74
in % des Fondsvermögens	4,46

#### 10 größte Gegenparteien

Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.978.360,74
Sitzstaat	Deutschland

#### Arten von Abwicklung und Clearing

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem).

#### 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	1.978.360,74

#### 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>.

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

### Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	1.977.581,63
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	0,00

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.

### Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	1.291,27
in % der Bruttoerträge	100,00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	
absolut	0,00
in % der Bruttoerträge	0,00

### 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

4,44

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 Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Spanien, Königreich
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	425.182,58
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	388.997,40
3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	91.732,70
4. Name	Portugal, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	87.155,71
5. Name	ENI S.p.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	84.998,79
6. Name	Spanien, Königreich
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	75.860,74
7. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	71.742,29
8. Name	Europäische Union
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	54.110,66
9. Name	Royal Bank of Canada
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	50.556,24
10. Name	Deutschland, Bundesrepublik
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	50.268,27

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

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

### Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	1,00
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	1.977.581,63

### Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

---

Frankfurt am Main, den 1. August 2022  
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 2021

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;  
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Squaire  
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 2022

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)

