

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2020.

**Deka EURO iSTOXX ex Fin  
Dividend+ UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der EURO iSTOXX Ex Financials High Dividend 50 (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 iSTOXX ex Fin Dividend+ 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 iSTOXX Ex Financials High Dividend 50 (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 2020

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ 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 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 2020        | 10 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2020      | 11 |
| Anhang                                      | 15 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 18 |

**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 iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den EURO iSTOXX ex Financials High Dividend 50 (Preisindex) nachzubilden. Dieser Index umfasst die 50 Unternehmen des EURO STOXX® ex Financials Universums mit der höchsten Dividendenrendite. Die Bestandteile des Index werden der Nettodividende entsprechend gewichtet. 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 EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

|                      | 6 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. |
|----------------------|----------|--------|--------------|
| <b>Performance *</b> | -17,2%   | -13,9% | -2,4%        |

|             |              |
|-------------|--------------|
| <b>ISIN</b> | DE000ETF1482 |
|-------------|--------------|

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

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

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

| Zu- oder Abgang | ISIN         | Wertpapiername  |
|-----------------|--------------|---|
| Löschung        | ES0105046009 | Aena SME S.A. Acciones Port. EO 10                            |
| Löschung        | NL0013267909 | Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder EO0,5                    |
| Löschung        | IT0003506190 | Atlantia S.p.A. Azioni Nom. EO 1                              |
| Löschung        | FR0000120503 | Bouygues S.A. Actions Port. EO 1                              |
| Löschung        | DE0005439004 | Continental AG Inhaber-Aktien o.N.                            |
| Löschung        | DE0006062144 | Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.                               |
| Löschung        | DE0008232125 | Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N.                 |
| Löschung        | DE0005557508 | Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.                        |
| Löschung        | DE000ENAG999 | E.ON SE Namens-Aktien o.N.                                    |
| Löschung        | IT0003128367 | ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1                                  |
| Löschung        | FR0010208488 | Engie S.A. Actions Port. EO 1                                 |
| Löschung        | DE000EVNK013 | Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N.                       |
| Löschung        | NL0010877643 | Fiat Chrysler Automobiles N.V. Aandelen op naam EO 0,01       |
| Löschung        | DE0006047004 | HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien o.N.                       |
| Löschung        | ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75                         |
| Löschung        | FI0009007835 | Metso Corp. Registered Shares o.N.                            |
| Löschung        | FI0009000681 | Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06                           |
| Löschung        | FR0000121501 | Peugeot S.A. Actions Port. (C.R.) EO 1                        |
| Löschung        | BE0003810273 | Proximus S.A. Actions au Porteur o.N.                         |
| Löschung        | FR0000131906 | Renault S.A. Actions Port. EO 3,81                            |
| Löschung        | FR0000120578 | Sanofi S.A. Actions Port. EO 2                                |
| Löschung        | LU0088087324 | SES S.A. Bearer FDRs (rep.Shs A) o.N.                         |
| Löschung        | FI0009005961 | Stora Enso Oyj Reg. Shares Cl.R EO 1,70                       |
| Löschung        | LU0156801721 | Tenaris S.A. Actions Nom. DL 1                                |
| Löschung        | IT0003242622 | Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22            |
| Löschung        | FR0000124141 | Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5             |
| Löschung        | FI0009003727 | Wärtsilä Corp. Reg. Shares o.N.                               |
| Neuaufnahme     | BE0974293251 | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.          |
| Neuaufnahme     | FR0000120172 | Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5                           |
| Neuaufnahme     | FR0000121261 | Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom. EO 2                 |
| Neuaufnahme     | FR0000125007 | Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4 |
| Neuaufnahme     | IE0001827041 | CRH PLC Registered Shares EO -,32                             |
| Neuaufnahme     | FR0000120644 | Danone S.A. Actions Port. EO-,25                              |
| Neuaufnahme     | DE0005552004 | Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.                           |
| Neuaufnahme     | DE000ENAG999 | E.ON SE Namens-Aktien o.N.                                    |
| Neuaufnahme     | FI0009007884 | Elisa Oyj Registered Shares Class A o.N.                      |
| Neuaufnahme     | IT0003128367 | ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1                                  |
| Neuaufnahme     | ES0118900010 | Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -,20                         |
| Neuaufnahme     | DE0006047004 | HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien o.N.                       |
| Neuaufnahme     | ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75                         |
| Neuaufnahme     | FI0009013403 | KONE Corp. (New) Registered Shares Cl.B o.N.                  |
| Neuaufnahme     | FI0009007835 | Metso Corp. Registered Shares o.N.                            |
| Neuaufnahme     | AT0000743059 | OMV AG Inhaber-Aktien o.N.                                    |
| Neuaufnahme     | FI0009014377 | Orion Corp. Registered Shares Cl.B o.N.                       |

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

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

| Zu- oder Abgang | ISIN         | Wertpapiername  |
|-----------------|--------------|---|
| Neuaufnahme     | FR0000121501 | Peugeot S.A. Actions Port. (C.R.) EO 1                      |
| Neuaufnahme     | DE000PAH0038 | Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N |
| Neuaufnahme     | FR0000120578 | Sanofi S.A. Actions Port. EO 2                              |
| Neuaufnahme     | DE0007236101 | Siemens AG Namens-Aktien o.N.                               |
| Neuaufnahme     | FR0000121220 | Sodexo S.A. Actions Port. EO 4                              |
| Neuaufnahme     | IT0003242622 | Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22          |
| Neuaufnahme     | NL0000388619 | Unilever N.V. Aandelen op naam EO -,16                      |
| Neuaufnahme     | FR0013176526 | Valéo S.A. Actions Port. EO 1                               |
| Neuaufnahme     | FR0000127771 | Vivendi S.A. Actions Port. EO 5,5                           |
| Neuaufnahme     | DE0007664039 | Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.                      |

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) |   |      |
|-------------------------------|---|------|
| FR0010220475                  | Alstom S.A. Actions Port. EO 7                                | 5,90 |
| DE0007100000                  | Daimler AG Namens-Aktien o.N.                                 | 3,72 |
| IT0003132476                  | ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.                                   | 3,38 |
| ES0173516115                  | Repsol S.A. Acciones Port. EO 1                               | 3,11 |
| ES0130960018                  | Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50                            | 2,95 |
| ES0130670112                  | Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20                            | 2,94 |
| ES0178430E18                  | Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1                           | 2,72 |
| FI0009007132                  | Fortum Oyj Registered Shares EO 3,40                          | 2,69 |
| FR0000130577                  | Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40                    | 2,65 |
| FR0000120271                  | Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50                         | 2,64 |
| ES0167050915                  | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. EO -,50          | 2,56 |
| ES0173093024                  | Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50         | 2,47 |
| ES0116870314                  | Naturgy Energy Group S.A. Acciones Port. EO 1                 | 2,45 |
| IT0003153415                  | Snam S.p.A. Azioni nom. o.N.                                  | 2,20 |
| FR0013176526                  | Valéo S.A. Actions Port. EO 1                                 | 2,19 |
| NL0000009082                  | Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder EO -,04                    | 2,16 |
| DE000BASF111                  | BASF SE Namens-Aktien o.N.                                    | 2,11 |
| PTGALOAM0009                  | Galp Energia SGPS S.A. Acções Nominativas EO 1                | 2,03 |
| PTEDPOAM0009                  | EDP - Energias de Portugal SA Acções Nom. EO 1                | 1,92 |
| DE000ENAG999                  | E.ON SE Namens-Aktien o.N.                                    | 1,91 |
| BE0003470755                  | Solvay S.A. Actions au Porteur A o.N.                         | 1,89 |
| AT0000743059                  | OMV AG Inhaber-Aktien o.N.                                    | 1,89 |
| FR0010613471                  | Suez S.A. Actions Port. EO 4                                  | 1,81 |
| FI0009005987                  | UPM Kymmene Corp. Registered Shares o.N.                      | 1,78 |
| FR0000125007                  | Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4 | 1,77 |
| DE0005552004                  | Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.                           | 1,74 |
| IT0003128367                  | ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1                                  | 1,73 |
| FR0000133308                  | Orange S.A. Actions Port. EO 4                                | 1,72 |
| ES0144580Y14                  | Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75                         | 1,71 |
| DE0005190003                  | Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1                  | 1,70 |
| DE000PAH0038                  | Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N   | 1,66 |
| IT0003242622                  | Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22            | 1,65 |
| DE0007236101                  | Siemens AG Namens-Aktien o.N.                                 | 1,65 |
| FR0000121220                  | Sodexo S.A. Actions Port. EO 4                                | 1,63 |
| BE0974293251                  | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.          | 1,58 |
| DE000BAY0017                  | Bayer AG Namens-Aktien o.N.                                   | 1,58 |
| FR0000121261                  | Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom. EO 2                 | 1,55 |
| NL0000388619                  | Unilever N.V. Aandelen op naam EO -,16                        | 1,52 |
| FR0000120578                  | Sanofi S.A. Actions Port. EO 2                                | 1,46 |
| NL0011794037                  | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01   | 1,41 |
| FI0009007884                  | Elisa Oyj Registered Shares Class A o.N.                      | 1,34 |
| FI0009013403                  | KONE Corp. (New) Registered Shares Cl.B o.N.                  | 1,30 |
| DE0007664039                  | Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.                        | 1,29 |
| FR0000120172                  | Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5                           | 1,24 |
| FI0009014377                  | Orion Corp. Registered Shares Cl.B o.N.                       | 1,20 |
| FR0000120644                  | Danone S.A. Actions Port. EO-,25                              | 1,17 |



# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) |  |      |
|-------------------------------|--|------|
| NL0000379121                  | Randstad N.V. Aandelen aan toonder EO 0,10 | 1,14 |
| IE0001827041                  | CRH PLC Registered Shares EO -,32          | 1,11 |
| FR0000127771                  | Vivendi S.A. Actions Port. EO 5,5          | 1,11 |
| ES0118900010                  | Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -,20      | 0,97 |

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2020.

|                                   | Kurswert<br>in EUR | Kurswert<br>in EUR    | % des Fonds-<br>vermögens <sup>1)</sup> |
|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|---|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>    |                    | <b>271.484.326,46</b> | <b>100,14</b>                           |
| 1. Aktien                         |                    | 265.031.858,41        | 97,76                                   |
| - Audiovisuelle Industrie         | 2.933.952,00       |                       | 1,08                                    |
| - Bau und Baustoffe               | 16.964.616,94      |                       | 6,26                                    |
| - Chemische Industrie             | 10.609.703,24      |                       | 3,91                                    |
| - Energieversorger                | 104.623.619,33     |                       | 38,59                                   |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau    | 35.570.828,24      |                       | 13,12                                   |
| - Papier und andere Basisprodukte | 4.725.144,00       |                       | 1,74                                    |
| - Pharmaindustrie / Biotech       | 15.232.758,42      |                       | 5,62                                    |
| - Sonstige industrielle Werte     | 20.003.292,28      |                       | 7,38                                    |
| - Sonstiges                       | 3.033.886,56       |                       | 1,12                                    |
| - Telekommunikation               | 21.054.900,47      |                       | 7,77                                    |
| - Transportation                  | 4.617.185,94       |                       | 1,70                                    |
| - Unterhaltungsindustrie          | 7.020.826,25       |                       | 2,59                                    |
| - Verbrauchsgüter                 | 18.641.144,74      |                       | 6,88                                    |
| 2. Forderungen                    |                    | 1.357.449,88          | 0,50                                    |
| 3. Bankguthaben                   |                    | 5.095.018,17          | 1,88                                    |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>      |                    | <b>-378.281,94</b>    | <b>-0,14</b>                            |
| <b>III. Fondsvermögen</b>         |                    | <b>271.106.044,52</b> | <b>100,00</b>                           |

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

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ 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   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |             |                 |                      |
| DE000BASF111   | BASF SE                                      | STK   |                                       | 119.498            | 57.119                             | 19.579            | EUR 46,810  | 5.593.701,38    | 2,06                 |
| DE000BAY0017   | Bayer AG                                     | STK   |                                       | 74.315             | 24.572                             | 19.089            | EUR 56,240  | 4.179.475,60    | 1,54                 |
| DE0005190003   | Bayerische Motoren Werke AG                  | STK   |                                       | 82.598             | 39.685                             | 33.117            | EUR 54,700  | 4.518.110,60    | 1,67                 |
| DE0007100000   | Daimler AG                                   | STK   |                                       | 263.892            | 149.486                            | 42.171            | EUR 37,400  | 9.869.560,80    | 3,64                 |
| DE0005552004   | Deutsche Post AG                             | STK   |                                       | 134.769            | 166.318                            | 31.549            | EUR 34,260  | 4.617.185,94    | 1,70                 |
| DE000ENAG999   | E.ON SE <sup>2)</sup>                        | STK   |                                       | 509.964            | 560.127                            | 645.543           | EUR 9,936   | 5.067.002,30    | 1,87                 |
| DE000PAH0038   | Porsche Automobil Holding SE                 | STK   |                                       | 91.734             | 98.231                             | 6.497             | EUR 48,090  | 4.411.488,06    | 1,63                 |
| DE0007236101   | Siemens AG                                   | STK   |                                       | 40.249             | 48.664                             | 8.415             | EUR 108,320 | 4.359.771,68    | 1,61                 |
| DE0007664039   | Volkswagen AG                                | STK   |                                       | 27.371             | 27.626                             | 255               | EUR 125,000 | 3.421.375,00    | 1,26                 |
|  |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | 46.037.671,36   | 16,98                |
| Ausland  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |             |                 |                      |
| ES0167050915   | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA <sup>2)</sup>  | STK   |                                       | 347.116            | 211.779                            | 51.804            | EUR 19,550  | 6.786.117,80    | 2,50                 |
| NL0011794037   | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.               | STK   |                                       | 152.474            | 37.712                             | 111.854           | EUR 24,470  | 3.731.038,78    | 1,38                 |
| FR0010220475   | Alstom S.A. <sup>2)</sup>                    | STK   |                                       | 331.220            | 162.543                            | 213.206           | EUR 47,230  | 15.643.520,60   | 5,77                 |
| BE0974293251   | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. <sup>2)</sup> | STK   |                                       | 90.970             | 91.819                             | 849               | EUR 46,120  | 4.195.536,40    | 1,55                 |
| FR0000120172   | Carrefour S.A.                               | STK   |                                       | 243.582            | 245.856                            | 2.274             | EUR 13,500  | 3.288.357,00    | 1,21                 |
| FR0000121261   | Cie Génie Étis Michelin SCpA <sup>2)</sup>   | STK   |                                       | 46.492             | 50.042                             | 3.550             | EUR 88,340  | 4.107.103,28    | 1,51                 |
| FR0000125007   | Compagnie de Saint-Gobain S.A. <sup>2)</sup> | STK   |                                       | 150.112            | 161.514                            | 11.402            | EUR 31,170  | 4.678.991,04    | 1,73                 |
| IE0001827041   | CRH PLC                                      | STK   |                                       | 95.444             | 96.335                             | 891               | EUR 30,760  | 2.935.857,44    | 1,08                 |
| FR0000120644   | Danone S.A. <sup>2)</sup>                    | STK   |                                       | 54.964             | 55.477                             | 513               | EUR 56,540  | 3.107.664,56    | 1,15                 |
| PTEDPOAM0009   | EDP - Energias de Portugal SA <sup>2)</sup>  | STK   |                                       | 1.187.984          | 641.195                            | 1.125.477         | EUR 4,285   | 5.090.511,44    | 1,88                 |
| FI0009007884   | Elisa Oyj                                    | STK   |                                       | 70.439             | 71.459                             | 1.020             | EUR 50,460  | 3.554.351,94    | 1,31                 |
| ES0130960018   | Enagas S.A.                                  | STK   |                                       | 366.060            | 133.272                            | 127.472           | EUR 21,370  | 7.822.702,20    | 2,89                 |
| ES0130670112   | Endesa S.A.                                  | STK   |                                       | 324.107            | 127.554                            | 93.431            | EUR 24,040  | 7.791.532,28    | 2,87                 |
| IT0003128367   | ENEL S.p.A.                                  | STK   |                                       | 591.595            | 652.124                            | 781.839           | EUR 7,729   | 4.572.437,76    | 1,69                 |
| IT0003132476   | ENI S.p.A. <sup>2)</sup>                     | STK   |                                       | 1.187.795          | 796.238                            | 143.220           | EUR 7,541   | 8.957.162,10    | 3,30                 |
| ES0118900010   | Ferrovial S.A. <sup>2)</sup>                 | STK   |                                       | 123.609            | 124.763                            | 1.154             | EUR 20,740  | 2.563.650,66    | 0,95                 |
| FI0009007132   | Fortum Oyj                                   | STK   |                                       | 413.883            | 191.897                            | 64.141            | EUR 17,220  | 7.127.065,26    | 2,63                 |
| PTGALOAM0009   | Galp Energia SGPS S.A. <sup>2)</sup>         | STK   |                                       | 604.421            | 312.128                            | 89.239            | EUR 8,900   | 5.379.346,90    | 1,98                 |
| ES0144580Y14   | Iberdrola S.A.                               | STK   |                                       | 414.431            | 459.409                            | 584.080           | EUR 10,920  | 4.525.586,52    | 1,67                 |
| NL0000009082   | Kon. KPN N.V. <sup>2)</sup>                  | STK   |                                       | 2.611.007          | 1.039.342                          | 441.808           | EUR 2,194   | 5.728.549,36    | 2,11                 |
| FI0009013403   | KONE Corp. (New)                             | STK   |                                       | 51.194             | 51.936                             | 742               | EUR 67,240  | 3.442.284,56    | 1,27                 |
| ES0116870314   | Naturgy Energy Group S.A. <sup>2)</sup>      | STK   |                                       | 412.288            | 172.145                            | 66.827            | EUR 15,740  | 6.489.413,12    | 2,39                 |
| AT0000743059   | OMV AG <sup>2)</sup>                         | STK   |                                       | 187.388            | 201.466                            | 14.078            | EUR 26,720  | 5.007.007,36    | 1,85                 |
| FR0000133308   | Orange S.A.                                  | STK   |                                       | 460.138            | 125.256                            | 122.568           | EUR 9,912   | 4.560.887,86    | 1,68                 |
| FI0009014377   | Orion Corp.                                  | STK   |                                       | 85.627             | 86.868                             | 1.241             | EUR 37,020  | 3.169.911,54    | 1,17                 |
| FR0000130577   | Publicis Groupe S.A.                         | STK   |                                       | 257.645            | 133.520                            | 36.653            | EUR 27,250  | 7.020.826,25    | 2,59                 |
| NL0000379121   | Randstad N.V. <sup>2)</sup>                  | STK   |                                       | 74.616             | 64.389                             | 127.412           | EUR 40,660  | 3.033.886,56    | 1,12                 |
| ES0173093024   | Red Electrica Corporacion S.A. <sup>2)</sup> | STK   |                                       | 395.793            | 161.443                            | 147.791           | EUR 16,520  | 6.538.500,36    | 2,41                 |
| ES0173516115   | Repsol S.A.                                  | STK   |                                       | 1.254.398          | 877.596                            | 150.065           | EUR 6,580   | 8.253.938,84    | 3,04                 |
| FR0000120578   | Sanofi S.A. <sup>2)</sup>                    | STK   |                                       | 43.672             | 47.853                             | 53.652            | EUR 88,550  | 3.867.155,60    | 1,43                 |
| IT0003153415   | Snam S.p.A.                                  | STK   |                                       | 1.296.767          | 439.015                            | 535.507           | EUR 4,500   | 5.835.451,50    | 2,15                 |
| FR0000121220   | Sodexo S.A. <sup>2)</sup>                    | STK   |                                       | 74.100             | 74.791                             | 691               | EUR 58,280  | 4.318.548,00    | 1,59                 |
| BE0003470755   | Solvay S.A.                                  | STK   |                                       | 75.931             | 44.225                             | 10.637            | EUR 66,060  | 5.016.001,86    | 1,85                 |
| FR0010613471   | Suez S.A. <sup>2)</sup>                      | STK   |                                       | 429.393            | 201.512                            | 221.439           | EUR 11,185  | 4.802.760,71    | 1,77                 |
| ES0178430E18   | Telefónica S.A.                              | STK   |                                       | 2.032.444          | 1.252.038                          | 263.971           | EUR 3,548   | 7.211.111,31    | 2,66                 |
| IT0003242622   | Terna Rete Elettrica Nazio.SpA               | STK   |                                       | 692.380            | 767.128                            | 970.190           | EUR 6,306   | 4.366.148,28    | 1,61                 |
| FR0000120271   | Total S.A. <sup>2)</sup>                     | STK   |                                       | 223.548            | 125.585                            | 38.323            | EUR 31,300  | 6.997.052,40    | 2,58                 |
| NL0000388619   | Unilever N.V.                                | STK   |                                       | 80.196             | 80.944                             | 748               | EUR 50,080  | 4.016.215,68    | 1,48                 |
| FI0009005987   | UPM Kymmene Corp. <sup>2)</sup>              | STK   |                                       | 208.800            | 95.865                             | 54.133            | EUR 22,630  | 4.725.144,00    | 1,74                 |
| FR0013176526   | Valéo S.A. <sup>2)</sup>                     | STK   |                                       | 266.831            | 360.087                            | 93.256            | EUR 21,740  | 5.800.905,94    | 2,14                 |
| FR0000127771   | Vivendi S.A.                                 | STK   |                                       | 130.980            | 132.202                            | 1.222             | EUR 22,400  | 2.933.952,00    | 1,08                 |
|  |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | 218.994.187,05  | 80,78                |
|  |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | 265.031.858,41  | 97,76                |
| Summe Wertpapiervermögen   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |             |                 |                      |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | 5.095.018,17    | 1,88                 |
| EUR-Guthaben bei:  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |             |                 |                      |
| Verwahrstelle  |  |       | EUR                                   | 5.095.018,17       |                                    | %                 | 100,000     | 5.095.018,17    | 1,88                 |
| Sonstige Vermögensgegenstände  |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | 1.357.449,88    | 0,50                 |
| Dividendenansprüche  |  |       | EUR                                   | 178.124,72         |                                    |                   |             | 178.124,72      | 0,07                 |
| Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung                            |  |       | EUR                                   | 1.176.336,84       |                                    |                   |             | 1.176.336,84    | 0,43                 |
| Forderungen aus Wertpapier-Darlehen                                    |  |       | EUR                                   | 2.988,32           |                                    |                   |             | 2.988,32        | 0,00                 |
| Sonstige Verbindlichkeiten   |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | -378.281,94     | -0,14                |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften                             |  |       | EUR                                   | -307.239,90        |                                    |                   |             | -307.239,90     | -0,11                |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung                                 |  |       | EUR                                   | -71.042,04         |                                    |                   |             | -71.042,04      | -0,03                |
| Fondsvermögen  |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | 271.106.044,52  | 100,00 <sup>1)</sup> |
| Anteilwert   |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR         | 16,87           |                      |
| Umlaufende Anteile   |  |       |                                       |                    |                                    |                   | STK         | 16.072.343,00   |                      |

<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.

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

| ISIN   | Gattungsbezeichnung            |     | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Wertpapierdarlehen<br>Kurswert in EUR |               | gesamt               |
|--|--------------------------------|-----|---|---------------------------------------|---------------|----------------------|
|  |                                |     |   | befristet                             | unbefristet   |                      |
| Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen   |                                |     |   |                                       |               |                      |
| Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: |                                |     |   |                                       |               |                      |
| ES0167050915   | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA  | STK | 3.611                                       |                                       | 70.595,05     |                      |
| FR0010220475   | Alstom S.A.                    | STK | 3.358                                       |                                       | 158.598,34    |                      |
| BE0974293251   | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. | STK | 20.880                                      |                                       | 962.985,60    |                      |
| FR0000121261   | Cie Génle ÉtS Michelin SCpA    | STK | 758   |                                       | 66.961,72     |                      |
| FR0000125007   | Compagnie de Saint-Gobain S.A. | STK | 90.000                                      |                                       | 2.805.300,00  |                      |
| FR0000120644   | Danone S.A.                    | STK | 3.886                                       |                                       | 219.714,44    |                      |
| DE000ENAG999   | E.ON SE                        | STK | 80.000                                      |                                       | 794.880,00    |                      |
| PTEDPOAM0009   | EDP - Energias de Portugal SA  | STK | 19.580                                      |                                       | 83.900,30     |                      |
| IT0003132476   | ENI S.p.A.                     | STK | 310.000                                     |                                       | 2.337.710,00  |                      |
| ES0118900010   | Ferrovial S.A.                 | STK | 5.118                                       |                                       | 106.147,32    |                      |
| PTGALOAM0009   | Galp Energia SGPS S.A.         | STK | 3.835                                       |                                       | 34.131,50     |                      |
| NL0000009082   | Kon. KPN N.V.                  | STK | 27.327                                      |                                       | 59.955,44     |                      |
| ES0116870314   | Naturgy Energy Group S.A.      | STK | 2.177                                       |                                       | 34.265,98     |                      |
| AT0000743059   | OMV AG                         | STK | 19  |                                       | 507,68        |                      |
| NL0000379121   | Randstad N.V.                  | STK | 64.698                                      |                                       | 2.630.620,68  |                      |
| ES0173093024   | Red Electrica Corporacion S.A. | STK | 3.276                                       |                                       | 54.119,52     |                      |
| FR0000120578   | Sanofi S.A.                    | STK | 3.151                                       |                                       | 279.021,05    |                      |
| FR0000121220   | Sodexo S.A.                    | STK | 1.466                                       |                                       | 85.438,48     |                      |
| FR0010613471   | Suez S.A.                      | STK | 14.721                                      |                                       | 164.654,39    |                      |
| FR0000120271   | Total S.A.                     | STK | 42.750                                      |                                       | 1.338.075,00  |                      |
| FI0009005987   | UPM Kymmene Corp.              | STK | 4.083                                       |                                       | 92.398,29     |                      |
| FR0013176526   | Valéo S.A.                     | STK | 4.566                                       |                                       | 99.264,84     |                      |
| Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen                  |                                |     |   |                                       | 12.479.245,62 | <b>12.479.245,62</b> |

## 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.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|-------------------------------------|--|---|-------------------|----------------------|---------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |  |   |                   |                      |                     |
| <b>Aktien</b>                       |  |   |                   |                      |                     |
| <b>Inland</b>                       |  |   |                   |                      |                     |
| DE0005439004                        | Continental AG                             | STK   | 29.084            | 69.840               |                     |
| DE0006062144                        | Covestro AG                                | STK   | 61.875            | 221.540              |                     |
| DE0008232125                        | Deutsche Lufthansa AG                      | STK   | 25.891            | 365.403              |                     |
| DE0005557508                        | Deutsche Telekom AG                        | STK   | 49.211            | 422.636              |                     |
| DE000EVNK013                        | Evonik Industries AG                       | STK   | 28.366            | 222.614              |                     |
| DE0006047004                        | HeidelbergCement AG                        | STK   | 77.514            | 77.514               |                     |
| <b>Ausland</b>                      |  |   |                   |                      |                     |
| ES06670509G4                        | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte   | STK   | 187.141           | 187.141              |                     |
| ES06670509H2                        | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte   | STK   | 330.918           | 330.918              |                     |
| ES0105046009                        | Aena SME S.A.                              | STK   | 9.000             | 38.320               |                     |
| NL0013267909                        | Akzo Nobel N.V.                            | STK   | 17.327            | 244.533              |                     |
| IT0003506190                        | Atlantia S.p.A.                            | STK   | 106.625           | 359.963              |                     |
| FR0000120503                        | Bouygues S.A.                              | STK   | 20.541            | 164.191              |                     |
| PTEDPOAM5010                        | EDP - Energias de Portugal S.A. - Anrechte | STK   | 1.094.881         | 1.094.881            |                     |
| FR0010208488                        | Engie S.A.                                 | STK   | 55.509            | 478.606              |                     |
| NL0010877643                        | Fiat Chrysler Automobiles N.V.             | STK   | 537.506           | 1.859.638            |                     |
| ES06445809K4                        | Iberdrola S.A. - Anrechte                  | STK   | 397.671           | 397.671              |                     |
| FI0009007835                        | Metso Corp.                                | STK   | 155.505           | 155.505              |                     |
| FI0009000681                        | Nokia Oyj                                  | STK   | 118.638           | 1.674.386            |                     |
| FR0000121501                        | Peugeot S.A.                               | STK   | 298.637           | 298.637              |                     |
| BE0003810273                        | Proximus S.A.                              | STK   | 19.865            | 280.365              |                     |
| FR0000131906                        | Renault S.A.                               | STK   | 480.358           | 719.960              |                     |
| ES06735169G0                        | Repsol S.A. - Anrechte                     | STK   | 935.942           | 935.942              |                     |
| LU0088087324                        | SES S.A.                                   | STK   | 815.200           | 1.446.578            |                     |
| FI00090005961                       | Stora Enso Oyj                             | STK   | 59.835            | 468.293              |                     |
| ES06784309C1                        | Telefónica S.A. - Anrechte                 | STK   | 1.396.792         | 1.396.792            |                     |
| LU0156801721                        | Tenaris S.A.                               | STK   | 369.859           | 806.825              |                     |
| FR0000124141                        | Veolia Environnement S.A.                  | STK   | 15.849            | 223.684              |                     |
| FI0009003727                        | Wärtsilä Corp.                             | STK   | 92.120            | 762.551              |                     |

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|------|--|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
|      | <b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b><br>unbefristet | EUR                                   |                |                   | 225.338          |

(Basiswerte: ACS, Act.de Constr.y Serv. SA (ES0167050915); Aena SME S.A. (ES0105046009); Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. (NL0011794037); Akzo Nobel N.V. (NL0013267909); Alstom S.A. (FR0010220475); Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. (BE0974293251); Atlantia S.p.A. (IT0003506190); BASF SE (DE000BASF111); Bayer AG (DE000BAY0017); Bouygues S.A. (FR0000120503); Cie Génle Éts Michelin SCpA (FR0000121261); Compagnie de Saint-Gobain S.A. (FR0000125007); Continental AG (DE0005439004); Covestro AG (DE0006062144); Daimler AG (DE0007100000); Deutsche Lufthansa AG (DE0008232125); Deutsche Post AG (DE0005552004); Deutsche Telekom AG (DE0005557508); E.ON SE (DE000ENAG999); Enagas S.A. (ES0130960018); Engie S.A. (FR0010208488); ENI S.p.A. (IT0003132476); Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643); Galp Energia SGPS S.A. (PTGALOAM0009); Kon. KPN N.V. (NL0000009082); Naturgy Energy Group S.A. (ES0116870314); OMV AG (AT0000743059); Peugeot S.A. (FR0000121501); Porsche Automobil Holding SE (DE000PAH0038); Publicis Groupe S.A. (FR0000130577); Randstad N.V. (NL0000379121); Red Electrica Corporacion S.A. (ES0173093024); Renault S.A. (FR0000131906); Repsol S.A. (ES0173516115); Sanofi S.A. (FR0000120578); SES S.A. (LU0088087324); Siemens AG (DE0007236101); Sham S.p.A. (IT0003153415); Sodexo S.A. (FR0000121220); Stora Enso Oyj (FI0009005961); Suez S.A. (FR0010613471); Telefónica S.A. (ES0178430E18); Tenaris S.A. (LU0156801721); Total S.A. (FR0000120271); Total S.A. - Anrechte (FR0013517257); Unilever N.V. (NL0000388619); Veolia Environnement S.A. (FR0000124141))

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

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

|  | insgesamt<br>EUR | insgesamt<br>EUR | je Anteil <sup>1)</sup><br>EUR |
|--|------------------|------------------|--------------------------------|
| <b>I. Erträge</b>  |                  |                  |                                |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) |                  | 1.167.746,06     | 0,073                          |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)     |                  | 5.067.687,89     | 0,315                          |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland                     |                  | 46,20            | 0,000                          |
| 4. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften    |                  | 10.376,56        | 0,001                          |
| 5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer                       |                  | -175.161,91      | -0,011                         |
| 6. Abzug ausländischer Quellensteuer                           |                  | -508.321,66      | -0,032                         |
| 7. Sonstige Erträge  |                  | 79.511,15        | 0,005                          |
| davon: Kompensationszahlungen                                  |                  |                  | 0,005                          |
| Summe der Erträge  | 77.077,79        | 5.641.884,29     | 0,351                          |
| <b>II. Aufwendungen</b>  |                  |                  |                                |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme                                   |                  | -0,42            | 0,000                          |
| 2. Verwaltungsvergütung  |                  | -416.028,79      | -0,026                         |
| 3. Sonstige Aufwendungen                                       |                  | -3.827,28        | 0,000                          |
| davon: Bankgebühren  | -50,00           |                  | 0,000                          |
| davon: Kosten Erstattung Quellensteuer                         | -0,05            |                  | 0,000                          |
| davon: Negative Einlagezinsen                                  | -3.778,16        |                  | 0,000                          |
| Summe der Aufwendungen   |                  | -419.856,49      | -0,026                         |
| <b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>                           |                  | 5.222.027,80     | 0,325                          |
| <b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>                               |                  |                  |                                |
| 1. Realisierte Gewinne   |                  | 8.832.831,01     | 0,550                          |
| 2. Realisierte Verluste  |                  | -53.526.912,20   | -3,330                         |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften                            |                  | -44.694.081,19   | -2,781                         |
| <b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>            |                  | -39.472.053,39   | -2,456                         |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne             |                  | -10.250.269,06   | -0,638                         |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste            |                  | -11.918.049,01   | -0,742                         |
| <b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>     |                  | -22.168.318,07   | -1,379                         |
| <b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>                       |                  | -61.640.371,46   | -3,835                         |

Entwicklung des Sondervermögens

|  | 2020 / 2021    | 2020 / 2021    |
|--|----------------|----------------|
|  | EUR            | EUR            |
| <b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b> |                | 333.707.452,10 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr                   |                | -1.650.799,40  |
| 2. Zwischenausschüttungen  |                | -1.469.053,98  |
| 3. Mittelzufluss (netto)   |                | 609.651,97     |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen                     | 51.471.085,05  |                |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen                    | -50.861.433,08 |                |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich                            |                | 1.549.165,29   |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres                                  |                | -61.640.371,46 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne            | -10.250.269,06 |                |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste           | -11.918.049,01 |                |
| <b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>  |                | 271.106.044,52 |

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

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF Anhang.

## Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 12.479.245,62

## 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>15.659.110,86</b> |
| davon:  |            |                 |                      |
| Schuldverschreibungen   | EUR        |                 | 15.659.110,86        |
| <b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten</b>                | <b>EUR</b> |                 | <b>1.022.499,36</b>  |
| <b>Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)</b> | <b>EUR</b> |                 | <b>10.185,65</b>     |

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 13.580,87. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 3.395,22.

**Erträge aus Kompensationszahlungen in Folge von Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR **76.254,74**

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

## Sonstige Angaben

Anteilwert EUR 16,87  
Umlaufende Anteile STK 16.072.343,00

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)** **97,76**  
**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 0,41

## 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 76.254,74 enthalten.

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

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -3.707,36 enthalten.

# Deka EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

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

### Verwendete Vermögensgegenstände

|                         |               |
|-------------------------|---------------|
| absolut                 | 12.479.245,62 |
| in % des Fondsvermögens | 4,60          |

### 10 größte Gegenparteien

|                                |                                |
|--------------------------------|--------------------------------|
| Name                           | DekaBank Deutsche Girozentrale |
| Bruttovolumen offene Geschäfte | 11.664.666,35                  |
| Sitzstaat                      | Deutschland                    |
| Name                           | Clearstream Banking AG         |
| Bruttovolumen offene Geschäfte | 814.579,27                     |
| Sitzstaat                      | 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                     | 12.479.245,62 |

### 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)     | 1.022.499,36  |
| 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                     | 15.659.110,86 |

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 EURO iSTOXX ex Fin Dividend+ UCITS ETF

## Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut 10.185,65  
in % der Bruttoerträge 75,00

Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)  
absolut 3.395,22  
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

4,71

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                                       | Bayerische Landesbank               |
| 1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 7.985.770,00                        |
| 2. Name                                       | Bayerische Landesbodenkreditanstalt |
| 2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 2.337.755,58                        |
| 3. Name                                       | Commerzbank AG                      |
| 3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 2.024.515,35                        |
| 4. Name                                       | Wells Fargo & Co.                   |
| 4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 1.310.940,75                        |
| 5. Name                                       | Landeskreditbank Baden-Württemberg  |
| 5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 626.435,75                          |
| 6. Name                                       | Brandenburg, Land                   |
| 6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 526.464,58                          |
| 7. Name                                       | Banco Santander S.A.                |
| 7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 140.150,32                          |
| 8. Name                                       | Deutsche Hypothekbank [A.-G.]       |
| 8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 135.725,70                          |
| 9. Name                                       | McDonald's Corp.                    |
| 9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)  | 115.263,27                          |
| 10. Name                                      | Kering S.A.                         |
| 10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 108.963,71                          |

## 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         | 14.626.286,65            |
| Name                              | J.P. Morgan AG Frankfurt |
| verwahrter Betrag absolut         | 2.055.323,58             |

## 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)

