

Halbjahresbericht
zum 31. Juli 2023.

**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 2023

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 2023 bis zum 31. Juli 2023.

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

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

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

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka-etf.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Juli 2023	8
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	13

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[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka STOXX[®] 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[®] 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).

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

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

Wichtige Kennzahlen

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	2,7%	3,6%	9,2%
ISIN	DE000ETFLO52		

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

Deka STOXX[®] 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	CH0012138530	Credit Suisse Group AG Namens-Aktien SF -,04
Neuaufnahme	ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom. EO -,50

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
IT0005495657	Saipem S.p.A. Azioni nom. o.N.	4,98
GB0031215220	Carnival PLC Registered Shares DL 1,66	4,26
FR0000121147	Faurecia SE Actions Port. EO 7	3,83
PLKGHM000017	KGHM Polska Miedz S.A. Inhaber-Aktien ZY 10	3,37
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	3,34
CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	3,29
NL0011585146	Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	3,14
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC Registered Shares LS-,27285714	3,11
PLDINPL00011	Dino Polska S.A. Inhaber-Aktien ZY -,10	3,09
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	3,01
FR0000131906	Renault S.A. Actions Port. EO 3,81	2,97
FR0013506730	Vallourec S.A. Actions Port. EO 0,02	2,91
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20	2,88
SE0012673267	Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	2,82
CH1175448666	Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01	2,73
IT0000433307	Saras S.p.A. Raffinerie Sarde Azioni nom. o.N.	2,71
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	2,65
FR0000031122	Air France-KLM S.A. Actions Port. EO 1	2,64
SE0000107203	Industrivärden AB Namn-Aktier C o.N.	2,63
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,054141	2,55
IT0004056880	Amplifon S.p.A. Azioni nom. EO -,02	2,41
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder EO -,04	2,21
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.	2,16
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier DK -,20	2,16
DK0010272202	GENMAB AS Navne Aktier DK 1	2,16
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE Namens-Aktien o.N.	2,14
SE0015810247	Kinnevik AB Namn-Aktier B SK 0,025	2,10
NO0010199151	PGS ASA Navne-Aksjer (new) NK 3	2,04
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A. Acciones Port. EO -,25	2,02
DK0060448595	Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1	2,00
NO0003055501	Nordic Semiconductor ASA Navne-Aksjer NK 0,01	1,99
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC Registered Shares LS 1,101698	1,96
SE0012853455	EQT AB Namn-Aktier o.N.	1,92
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.	1,73
SE0015988019	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.	1,65
SE0016844831	Volvo Car AB Namn-Aktier B o.N.	1,64
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port. EO -,20	1,63
ES0165386014	Solaria Energia Y Medio Ambi. Acciones Port. EO -,01	1,49
DK0015998017	Bavarian Nordic Navne-Aktier DK 10	1,29
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom. EO -,50	0,40

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Juli 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		48.404.750,43	100,05
1. Aktien		48.201.636,57	99,63
- Banken	923.919,41		1,91
- Bau und Baustoffe	2.999.752,74		6,20
- Bergbau	1.622.501,05		3,35
- Chemische Industrie	1.928.600,55		3,99
- Elektrik / Elektronik	2.408.729,13		4,98
- Energieversorger	5.467.652,69		11,30
- Holdinggesellschaften	2.278.934,95		4,71
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	5.583.795,49		11,54
- Pharmaindustrie / Biotech	8.109.081,21		16,76
- Sonstige Dienstleistungen	3.331.855,35		6,89
- Sonstige industrielle Werte	2.988.137,38		6,18
- Telekommunikation	2.095.455,56		4,33
- Textilien und Kleidung	2.651.558,04		5,48
- Transportation	2.962.991,54		6,12
- Unterhaltungsindustrie	1.359.062,58		2,81
- Verbrauchsgüter	1.489.608,90		3,08
2. Forderungen		74.502,22	0,15
3. Bankguthaben		128.611,64	0,27
II. Verbindlichkeiten		-26.096,53	-0,05
III. Fondsvermögen		48.378.653,90	100,00

¹⁾ Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		7.896	281	0	EUR 105,350	831.843,60	1,72
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE	STK		25.023	892	0	EUR 41,265	1.032.574,10	2,13
DE0006969603	PUMA SE	STK		16.966	604	0	EUR 61,440	1.042.391,04	2,15
							EUR	2.906.808,74	6,01
Ausland									
NL0012969182	Adyen N.V.	STK		756	27	0	EUR 1.689,800	1.277.488,80	2,64
FR0000031122	Air France-KLM S.A.	STK		809.228	28.825	0	EUR 1,571	1.270.892,57	2,63
IT0004056880	Amplifon S.p.A.	STK		37.701	1.343	0	EUR 30,790	1.160.813,79	2,40
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK		2.226	79	0	EUR 652,200	1.451.797,20	3,00
DK0015998017	Bavarian Nordic	STK		31.949	1.138	0	DKK 145,400	623.332,39	1,29
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC	STK		24.215	862	0	GBP 43,460	1.228.129,19	2,54
GB0031215220	Carnival PLC	STK		133.565	4.758	0	GBP 13,180	2.054.366,55	4,25
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A.	STK		26.224	934	0	EUR 37,140	973.959,36	2,01
DK0060448595	Coloplast AS	STK		8.535	304	0	DKK 842,400	964.761,36	1,99
PLDINPL00011	Dino Polska S.A.	STK		14.700	524	0	PLN 446,300	1.489.608,90	3,08
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC	STK		283.939	10.114	0	GBP 4,523	1.498.723,42	3,10
SE0012853455	EQT AB	STK		42.576	1.517	0	SEK 251,400	923.919,41	1,91
SE0012673267	Evolution AB (publ)	STK		12.130	432	0	SEK 1.298,000	1.359.062,58	2,81
FR0000121147	Faurecia SE	STK		80.963	2.884	0	EUR 22,820	1.847.575,66	3,82
NL0011585146	Ferrari N.V.	STK		5.195	185	0	EUR 291,400	1.513.823,00	3,13
DK0010272202	GENMAB AS	STK		2.780	99	0	DKK 2.787,000	1.039.632,34	2,15
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK		798	28	0	EUR 2.016,500	1.609.167,00	3,33
SE0000107203	Industrivärden AB	STK		49.216	1.753	0	SEK 298,100	1.266.403,94	2,62
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA	STK		96.846	96.846	0	GBP 1,711	193.375,55	0,40
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC	STK		44.918	1.600	0	GBP 18,010	944.069,53	1,95
PLKGHM000017	KGHM Polska Miedz S.A.	STK		57.605	2.051	0	PLN 124,050	1.622.501,05	3,35
SE0015810247	Kinnevik AB	STK		81.658	2.909	0	SEK 143,650	1.012.531,01	2,09
NL0000009082	Kon. KPN N.V.	STK		322.868	11.501	0	EUR 3,292	1.062.881,46	2,20
SE0015988019	NIBE Industrier AB	STK		97.540	3.475	0	SEK 94,740	797.664,19	1,65
NO0003055501	Nordic Semiconductor ASA	STK		71.539	2.548	0	NOK 149,200	956.931,93	1,98
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK		9.482	337	0	DKK 1.092,200	1.389.633,06	2,87
NO0010199151	PGS ASA	STK		1.544.509	55.017	0	NOK 7,110	984.531,02	2,04
FR0000131906	Renault S.A.	STK		35.873	1.278	0	EUR 39,905	1.431.512,07	2,96
IT0005495657	Saipem S.p.A.	STK		1.650.229	58.782	0	EUR 1,456	2.402.733,42	4,97
IT0000433307	Saras S.p.A. Raffinerie Sarde	STK		1.006.016	35.836	0	EUR 1,300	1.307.317,79	2,70
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.	STK		2.759	98	0	EUR 284,500	784.935,50	1,62
ES0165386014	Solaria Energia Y Medio Ambiente S.A.	STK		50.421	1.796	0	EUR 14,225	717.238,73	1,48
CH1175448666	Straumann Holding AG	STK		8.713	310	0	CHF 144,150	1.314.129,17	2,72
FR0013506730	Vallourec S.A.	STK		118.247	4.212	0	EUR 11,860	1.402.409,42	2,90
CH0311864901	VAT Group AG	STK		4.095	146	0	CHF 370,100	1.585.727,96	3,28
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS	STK		42.685	1.521	0	DKK 181,640	1.040.362,75	2,15
SE0016844831	Volvo Car AB	STK		176.200	6.276	0	SEK 52,000	790.884,76	1,63
							EUR	45.294.827,83	93,63
							EUR	48.201.636,57	99,63
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbrieft							EUR	146.241,16	0,30
und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle			EUR	144.609,33		%	100,000	144.609,33	0,30
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			NOK	18.006,33		%	100,000	1.614,34	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			GBP	14,99		%	100,000	17,49	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	74.502,22	0,15
Dividendenansprüche			EUR	53.695,64				53.695,64	0,11
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	20.806,58				20.806,58	0,04
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-17.629,52	-0,04
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			CHF	-5.121,80		%	100,000	-5.358,93	-0,01
Verwahrstelle			DKK	-11.828,72		%	100,000	-1.587,22	-0,00
Verwahrstelle			PLN	-26.975,90		%	100,000	-6.124,97	-0,01
Verwahrstelle			SEK	-52.809,01		%	100,000	-4.558,40	-0,01
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-26.096,53	-0,05
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-26.096,53				-26.096,53	-0,05
Fondsvermögen							EUR	48.378.653,90	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	34,44	

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Umlaufende Anteile						STK	1.404.556,00	

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurse per 31.07.2023

Devisenkurse (in Mengennotiz)		31.07.2023
Australische Dollar (AUD)	1,63620	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund (GBP)	0,85690	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone (DKK)	7,45250	= 1 Euro (EUR)
Israelische Schekel (ILS)	4,03940	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar (CAD)	1,45125	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland Dollar (NZD)	1,77155	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone (NOK)	11,15400	= 1 Euro (EUR)
Polish Zloty (PLN)	4,40425	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone (SEK)	11,58500	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken (CHF)	0,95575	= 1 Euro (EUR)
Singapur Dollar (SGD)	1,46395	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar (USD)	1,10255	= 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
	Schwedische Krone (SEK)	11,585 = 1 EUR			
	Schweizer Franken (CHF)	0,95575 = 1 EUR			
	Singapur Dollar (SGD)	1,46395 = 1 EUR			
	US-Dollar (USD)	1,10255 = 1 EUR			
ISIN					
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Ausland					
CH0012138530	Credit Suisse Group AG		STK	7.597	213.252

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

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

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		22.597,82	0,016
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		466.330,92	0,332
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		936,93	0,001
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-3.389,68	-0,002
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-24.727,45	-0,018
6. Sonstige Erträge		3.363,60	0,002
davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern	67,52		0,000
davon: Sonstiges	3.296,08		0,002
Summe der Erträge		465.112,14	0,331
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-1.476,46	-0,001
2. Verwaltungsvergütung		-149.866,60	-0,107
3. Sonstige Aufwendungen		-1.500,90	-0,001
davon: Bankgebühren	-13,48		0,000
davon: Kosten Erstattung Quellensteuer	-595,00		0,000
davon: Sonstiges	-892,42		-0,001
Summe der Aufwendungen		-152.843,96	-0,109
III. Ordentlicher Nettoertrag		312.268,18	0,222
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.740,37	0,001
2. Realisierte Verluste		-751.981,77	-0,535
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-750.241,40	-0,534
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-437.973,22	-0,312
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.735.510,39	1,236
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		34.787,73	0,025
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.770.298,12	1,260
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.332.324,90	0,949
Entwicklung des Sondervermögens		2022 / 2023	
	EUR	EUR	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		45.515.069,50	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00	
2. Zwischenausschüttungen		-70.227,80	
3. Mittelzufluss (netto)		1.604.027,55	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	1.604.027,55		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-2.540,25	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.332.324,90	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	1.735.510,39		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	34.787,73		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		48.378.653,90	

¹⁾ Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung

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

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	34,44
Umlaufende Anteile	STK	1.404.556,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,63

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2023 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2023 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)

0,17

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Erträgen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Erträgen sind Korrekturbuchungen bei Sollzinsen in Höhe von EUR 2.309,07 und Quellenseuererstattungen in Höhe von EUR 869,97 enthalten.

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind Kosten für Steuerberatung in Höhe von EUR 714,00 und Kosten für Steuerrückerstattungen in Höhe von EUR 595,00 enthalten.

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

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

Frankfurt am Main, den 1. August 2023
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Juli 2023

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



Deka Investment GmbH

Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
www.deka-etf.de

