

Halbjahresbericht
zum 31. Juli 2021.

**Deka STOXX Europe 50[®]
UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Lizenzvermerk

Der STOXX Europe 50[®] 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 50[®] 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 50[®] 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 2021

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka STOXX Europe 50® UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2021 bis zum 31. Juli 2021.

Die europäische Wirtschaft litt im Berichtszeitraum zunächst weiterhin unter den Belastungen der Corona-Pandemie. So schrumpfte in Deutschland die gesamtwirtschaftliche Leistung im ersten Quartal 2021 merklich. Vor allem der private Konsum büßte durch die Lockdown-Maßnahmen angesichts erneut steigender Infektionszahlen und auftretender Virusmutationen ein. Erst in der zweiten Berichtshälfte mehrten sich die Erholungszeichen. An den Finanzmärkten überwogen in den letzten sechs Monaten optimistische Konjunkturperspektiven. Die Kombination aus erfolgreich verlaufenden Impfmaßnahmen und hoher Liquidität am Markt auf der Suche nach auskömmlichen Renditen befeuerte zudem den Risikoappetit der Anleger.

Eine wichtige Stütze bildeten im Berichtszeitraum die Geld- und Finanzpolitik. Die EZB wie auch die US-Notenbank Federal Reserve bekräftigten ihren expansiven Kurs. Ausgehend von den Impulsgebern USA und China vollzog sich die Erholung des Welthandels in raschem Tempo, was sich auch in deutlich gestiegenen Rohstoffpreisen und einer merklich anziehenden Inflation dokumentierte. An den Anleihemärkten war in der zweiten Berichtshälfte allerdings von wachsender Inflationsgefahr wenig zu spüren, die Renditen gaben wieder deutlich nach. Ende Juli 2021 rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen mit minus 0,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries bei plus 1,2 Prozent.

Die Aktienmärkte erzielten auf Halbjahressicht kräftige Kurssteigerungen, beflügelt von zahlreichen Konjunkturstimuli wie auch der anhaltenden Flutung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken. Einige etablierte Aktienindizes erreichten in diesem Zuge neue Rekordmarken.

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 2021 | 9 |
| Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2021 | 10 |
| Anhang | 14 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 17 |

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 STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

Anlagepolitik.

Der Deka STOXX Europe 50[®] 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 STOXX Europe 50[®] Index nachzubilden. Dieser Index besteht aus den 50 Unternehmen Europas, welche die größte Marktkapitalisierung des Streubesitzes (Free-Float) aufweisen. 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 der Rücknahme von Anteilscheinen.

Wichtige Kennzahlen

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

| | 6 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. |
|----------------------|----------|--------|--------------|
| Performance * | 17,7% | 23,4% | 7,2% |

| | |
|-------------|--------------|
| ISIN | DE000ETFL250 |
|-------------|--------------|

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

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

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

Im Berichtszeitraum hat der Emittent keine Veränderungen der Indexzusammensetzung mitgeteilt.

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|---|------|
| CH0038863350 | Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10 | 7,03 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09 | 6,12 |
| CH0012032048 | Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N. | 5,23 |
| CH0012005267 | Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50 | 4,40 |
| FR0000121014 | LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3 | 4,08 |
| GB0009895292 | AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25 | 3,43 |
| IE00BZ12WP82 | Linde PLC Registered Shares EO 0,001 | 3,06 |
| DE0007164600 | SAP SE Inhaber-Aktien o.N. | 3,02 |
| DK0060534915 | Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20 | 2,95 |
| GB00B10RZP78 | Unilever PLC Registered Shares LS -,031111 | 2,92 |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. Actions Port. EO 2 | 2,27 |
| DE0007236101 | Siemens AG Namens-Aktien o.N. | 2,25 |
| GB0002374006 | Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185 | 2,24 |
| GB0005405286 | HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50 | 2,21 |
| FR0000120271 | Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50 | 2,21 |
| FR0000120321 | Oréal S.A., L Actions Port. EO 0,2 | 2,16 |
| DE0008404005 | Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N. | 1,98 |
| GB0009252882 | GlaxoSmithKline PLC Registered Shares LS -,25 | 1,91 |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE Actions Port. EO 4 | 1,83 |
| GB0007188757 | Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10 | 1,75 |
| GB00B03MLX29 | Royal Dutch Shell Reg. Shares Class A EO -,07 | 1,60 |
| FR0000120073 | Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.CI. Actions Port. EO 5,50 | 1,59 |
| GB0007980591 | BP PLC Registered Shares DL -,25 | 1,57 |
| GB0002875804 | British American Tobacco PLC Registered Shares LS -,25 | 1,54 |
| NL0000235190 | Airbus SE Aandelen op naam EO 1 | 1,54 |
| NL0012969182 | Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01 | 1,47 |
| DE0007100000 | Daimler AG Namens-Aktien o.N. | 1,44 |
| DE000BASF111 | BASF SE Namens-Aktien o.N. | 1,39 |
| IT0003128367 | ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1 | 1,38 |
| ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75 | 1,36 |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2 | 1,36 |
| GB00BH0P3Z91 | BHP Group PLC Registered Shares DL -,50 | 1,31 |
| DE000A1EWWW0 | adidas AG Namens-Aktien o.N. | 1,31 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N. | 1,30 |
| FR0000121485 | Kering S.A. Actions Port. EO 4 | 1,27 |
| CH0012221716 | ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12 | 1,24 |
| FR0000125486 | VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50 | 1,21 |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10 | 1,17 |
| DE000BAY0017 | Bayer AG Namens-Aktien o.N. | 1,13 |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC Registered Shares LS -,144397 | 1,12 |
| CH0244767585 | UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10 | 1,11 |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10 | 1,09 |
| BE0974293251 | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N. | 1,03 |
| FR0000120628 | AXA S.A. Actions Port. EO 2,29 | 1,03 |
| IT0000072618 | Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N. | 0,97 |
| FR0000073272 | SAFRAN Actions Port. EO -,20 | 0,96 |

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)

| | | |
|--------------|---|------|
| GB0007099541 | Prudential PLC Registered Shares LS -,05 | 0,95 |
| GB00BH4HKS39 | Vodafone Group PLC Registered Shares DL 0,2095238 | 0,90 |
| GB00BDR05C01 | National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289 | 0,88 |
| NL0013654783 | Prosus N.V. Registered Shares EO -,05 | 0,76 |

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Juli 2021.

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens ¹⁾ |
|--------------------------------|--------------------|----------------------|---|
| I. Vermögensgegenstände | | 42.683.957,54 | 100,02 |
| 1. Aktien | | 42.438.511,57 | 99,44 |
| - Aeronautik und Weltraum | 1.058.699,60 | | 2,48 |
| - Banken | 2.394.384,67 | | 5,61 |
| - Bau und Baustoffe | 511.619,35 | | 1,20 |
| - Bergbau | 1.302.283,71 | | 3,05 |
| - Chemische Industrie | 2.562.716,29 | | 6,00 |
| - Einzelhandel | 462.419,31 | | 1,08 |
| - Elektrik / Elektronik | 3.901.376,77 | | 9,14 |
| - Energieversorger | 3.817.552,95 | | 8,95 |
| - Landwirtschaft und Fischerei | 653.200,98 | | 1,53 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 612.779,20 | | 1,44 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 11.204.145,87 | | 26,25 |
| - Software | 1.279.695,60 | | 3,00 |
| - Sonstige Dienstleistungen | 622.744,00 | | 1,46 |
| - Sonstige industrielle Werte | 954.349,74 | | 2,24 |
| - Sonstiges | 476.610,46 | | 1,12 |
| - Telekommunikation | 1.253.642,84 | | 2,94 |
| - Textilien und Kleidung | 2.822.866,00 | | 6,61 |
| - Verbrauchsgüter | 4.371.624,70 | | 10,24 |
| - Versicherungen | 2.175.799,53 | | 5,10 |
| 2. Forderungen | | 57.412,83 | 0,13 |
| 3. Bankguthaben | | 188.033,14 | 0,44 |
| II. Verbindlichkeiten | | -6.597,77 | -0,02 |
| III. Fondsvermögen | | 42.677.359,77 | 100,00 |

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

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2021.

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.07.2021 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens | |
|--|---------------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------------|-----------------|----------------------|------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | | |
| DE000A1EWWW0 | adidas AG | STK | | 1.810 | 2 | 0 | EUR 306,100 | 554.041,00 | 1,30 | |
| DE0008404005 | Allianz SE | STK | | 3.997 | 1 | 0 | EUR 210,000 | 839.370,00 | 1,97 | |
| DE000BASF111 | BASF SE | STK | | 8.905 | 4 | 1 | EUR 66,220 | 589.689,10 | 1,38 | |
| DE000BAY0017 | Bayer AG | STK | | 9.525 | 4 | 1 | EUR 50,290 | 479.012,25 | 1,12 | |
| DE0007100000 | Daimler AG | STK | | 8.140 | 4 | 1 | EUR 75,280 | 612.779,20 | 1,44 | |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | STK | | 31.439 | 15 | 4 | EUR 17,506 | 550.371,13 | 1,29 | |
| DE0007164600 | SAP SE | STK | | 10.590 | 5 | 7 | EUR 120,840 | 1.279.695,60 | 3,00 | |
| DE0007236101 | Siemens AG | STK | | 7.253 | 2 | 1 | EUR 131,580 | 954.349,74 | 2,24 | |
| | | | | | | | EUR | 5.859.308,02 | 13,73 | |
| Ausland | | | | | | | | | | |
| CH0012221716 | ABB Ltd. | STK | | 17.053 | 0 | 330 | CHF 33,130 | 525.696,37 | 1,23 | |
| NL0012969182 | Adyen N.V. | STK | | 272 | 1 | 0 | EUR 2.289,500 | 622.744,00 | 1,46 | |
| FR0000120073 | Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. | STK | | 4.593 | 3 | 0 | EUR 146,580 | 673.241,94 | 1,58 | |
| NL0000235190 | Airbus SE | STK | | 5.645 | 24 | 1 | EUR 115,700 | 653.126,50 | 1,53 | |
| BE0974293251 | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. | STK | | 8.212 | 34 | 0 | EUR 53,400 | 438.520,80 | 1,03 | |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. | STK | | 4.067 | 2 | 61 | EUR 639,000 | 2.598.813,00 | 6,09 | |
| GB0009895292 | AstraZeneca PLC | STK | | 15.004 | 2.285 | 0 | GBP 82,680 | 1.454.485,54 | 3,41 | |
| FR0000120628 | AXA S.A. | STK | | 19.949 | 1 | 102 | EUR 21,880 | 436.484,12 | 1,02 | |
| GB000BOP3291 | BHP Group PLC | STK | | 20.478 | 1.033 | 0 | GBP 23,240 | 557.988,89 | 1,31 | |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. | STK | | 11.181 | 5 | 1 | EUR 51,450 | 575.262,45 | 1,35 | |
| GB0007980591 | BP PLC | STK | | 196.222 | 743 | 963 | GBP 2,892 | 665.346,49 | 1,56 | |
| GB0002875804 | British American Tobacco PLC | STK | | 20.784 | 0 | 1.452 | GBP 26,805 | 653.200,98 | 1,53 | |
| GB0002374006 | Diageo PLC | STK | | 22.676 | 7 | 0 | GBP 35,705 | 949.286,65 | 2,22 | |
| IT0003128367 | ENEL S.p.A. | STK | | 75.320 | 37 | 10 | EUR 7,780 | 585.989,60 | 1,37 | |
| GB0009252882 | GlaxoSmithKline PLC | STK | | 48.786 | 157 | 0 | GBP 14,178 | 810.983,60 | 1,90 | |
| GB0005405286 | HSBC Holdings PLC | STK | | 201.200 | 654 | 15 | GBP 3,975 | 937.588,70 | 2,20 | |
| ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. | STK | | 56.821 | 635 | 0 | EUR 10,160 | 577.301,36 | 1,35 | |
| IT0000072618 | Intesa Sanpaolo S.p.A. | STK | | 176.863 | 86 | 23 | EUR 2,332 | 412.356,08 | 0,97 | |
| FR0000121485 | Kering S.A. | STK | | 710 | 0 | 12 | EUR 756,200 | 536.902,00 | 1,26 | |
| IE00BZ12WP82 | Linde PLC | STK | | 5.035 | 0 | 44 | EUR 258,150 | 1.299.785,25 | 3,05 | |
| FR0000121014 | LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE | STK | | 2.570 | 1 | 1 | EUR 673,900 | 1.731.923,00 | 4,06 | |
| GB00BDR05C01 | National Grid PLC ²⁾ | STK | | 34.470 | 349 | 0 | GBP 9,241 | 373.475,52 | 0,88 | |
| CH0038863350 | Nestlé S.A. | STK | | 27.933 | 13 | 4 | CHF 114,800 | 2.983.817,25 | 6,99 | |
| CH0012005267 | Novartis AG | STK | | 23.920 | 12 | 3 | CHF 83,880 | 1.866.948,54 | 4,37 | |
| DK0060534915 | Novo-Nordisk AS | STK | | 16.057 | 0 | 330 | DKK 580,000 | 1.252.024,63 | 2,93 | |
| FR0000120321 | Oréal S.A., L' | STK | | 2.376 | 12 | 0 | EUR 385,900 | 916.898,40 | 2,15 | |
| NL0013654783 | Prosus N.V. | STK | | 4.311 | 2 | 1 | EUR 74,850 | 322.678,35 | 0,76 | |
| GB0007099541 | Prudential PLC | STK | | 25.360 | 73 | 0 | GBP 13,565 | 403.339,66 | 0,95 | |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group | STK | | 7.141 | 3 | 1 | GBP 55,230 | 462.419,31 | 1,08 | |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC | STK | | 19.229 | 18 | 0 | GBP 21,140 | 476.610,46 | 1,12 | |
| GB0007188757 | Rio Tinto PLC | STK | | 10.405 | 4 | 0 | GBP 61,010 | 744.294,82 | 1,74 | |
| GB00B03MLX29 | Royal Dutch Shell | STK | | 39.765 | 20 | 5 | EUR 17,092 | 679.663,38 | 1,59 | |
| FR0000073272 | SAFRAN | STK | | 3.677 | 260 | 0 | EUR 110,300 | 405.573,10 | 0,95 | |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. | STK | | 11.077 | 22 | 1 | EUR 86,880 | 962.369,76 | 2,25 | |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE | STK | | 5.498 | 3 | 1 | EUR 141,300 | 776.867,40 | 1,82 | |
| FR0000120271 | TotalEnergies SE | STK | | 25.498 | 12 | 229 | EUR 36,700 | 935.776,60 | 2,19 | |
| CH0244767585 | UBS Group AG | STK | | 33.750 | 0 | 1.024 | CHF 14,940 | 469.177,44 | 1,10 | |
| GB00B10RZP78 | Unilever PLC | STK | | 25.493 | 13 | 3 | GBP 41,510 | 1.240.725,09 | 2,91 | |
| FR0000125486 | VINCI S.A. ²⁾ | STK | | 5.735 | 287 | 0 | EUR 89,210 | 511.619,35 | 1,20 | |
| GB00BH4HKS39 | Vodafone Group PLC | STK | | 279.401 | 19.344 | 0 | GBP 1,162 | 380.593,36 | 0,89 | |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG | STK | | 1.459 | 1 | 0 | CHF 365,800 | 496.605,75 | 1,16 | |
| | | | | | | | EUR | 34.358.505,49 | 80,51 | |
| Sonstige Beteiligungswertpapiere | | | | | | | | | | |
| Ausland | | | | | | | | | | |
| CH0012032048 | Roche Holding AG - Genusschein | STK | | 6.812 | 3 | 0 | CHF 350,350 | 2.220.698,06 | 5,20 | |
| | | | | | | | EUR | 2.220.698,06 | 5,20 | |
| | | | | | | | EUR | 42.438.511,57 | 99,44 | |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | | | |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | | | |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | EUR | | 188.033,14 | | | % | 100,000 | 188.033,14 | 0,44 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | | |
| Dividendenansprüche | | EUR | | 27.899,56 | | | | 57.412,83 | 0,13 | |
| Forderungen aus Kompensationszahlungen | | EUR | | 11.311,99 | | | | 27.899,56 | 0,07 | |
| Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung | | EUR | | 18.029,19 | | | | 11.311,99 | 0,03 | |
| Forderungen aus Wertpapier-Darlehen | | EUR | | 172,09 | | | | 18.029,19 | 0,04 | |
| | | | | | | | | 172,09 | 0,00 | |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | | |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | | EUR | | -6.597,77 | | | | -6.597,77 | -0,02 | |
| | | | | | | | | -6.597,77 | -0,02 | |
| Fondsvermögen | | | | | | | | | | |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 42.677.359,77 | 100,00 ¹⁾ | |
| | | | | | | | EUR | 35,76 | | |

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.07.2021 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|------|---------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------|-----------------|----------------------|
| | Umlaufende Anteile | | | | | | STK | 1.193.505,00 | |

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

²⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Wertpapierdarlehen Kurswert in EUR befristet | unbefristet | gesamt |
|--------------|--|---------------------------------------|--|-------------|-------------------|
| | Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: | | | | |
| GB00BDR05C01 | National Grid PLC | STK | 30.000 | 325.043,97 | |
| FR0000125486 | VINCI S.A. | STK | 3.446 | 307.417,66 | |
| | Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen | | | 632.461,63 | 632.461,63 |

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurs per 30.07.2021

| | | |
|-------------------------------|-------|------------------------|
| Devisenkurse (in Mengennotiz) | | 30.07.2021 |
| Britisches Pfund | (GBP) | 0,85290 = 1 Euro (EUR) |
| Dänische Krone | (DKK) | 7,43840 = 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken | (CHF) | 1,07470 = 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 |
|--------------|---|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| | Börsengehandelte Wertpapiere | | | | |
| | Aktien | | | | |
| | Ausland | | | | |
| ES06445809M0 | Iberdrola S.A. - Anrechte | STK | 56.821 | 56.821 | |
| | Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes): | | | | |
| | unbefristet | EUR | | | 12.613 |

(Basiswerte: 3i Group PLC (GB00B1YW4409); ABB Ltd. (CH0012221716); ABN AMRO Bank N.V. (NL0011540547); ACCOR S.A. (FR0000120404); Adecco Group AG (CH0012138605); AEGON N.V. (NL0000303709); AGEAS SA/NV (BE0974264930); Akzo Nobel N.V. (NL0013267909); Alcon AG (CH0432492467); Alfa Laval AB (SE0000695876); Alstom S.A. (FR0010220475); Antofagasta PLC (GB0000456144); Arkema S.A. (FR0010313833); Arountown SA (LU1673108939); Assa-Abloy AB (SE0007100581); Assicurazioni Generali S.p.A. (IT0000062072); Associated British Foods PLC (GB0006731235); AstraZeneca PLC (GB0009895292); Atlas Copco AB (SE0011166628); Atos SE (FR0000051732); Auto Trader Group PLC (GB00BVYVW23); AVEVA Group PLC (GB00BBGG9VW75); Aviva PLC (GB0002162385); BAE Systems PLC (GB0002634946); Baloise Holding AG (CH0012410517); Banque Cantonale Vaudoise (CH0531751755); Barratt Developments PLC (GB0000811801); Bayerische Motoren Werke AG (DE0005190037); Beiersdorf AG (DE0005200000); bioMerieux (FR0013280286); Boliden AB (SE0012455673); Boliden AB (SE0015811559); Boliden AB (SE0015811567); Bolloré S.A. (FR0000039299); BP PLC (GB0007980591); Brenntag SE (DE000A1DAHH0); British American Tobacco PLC (GB0002875804); British Land Co. PLC, The (GB0001367019); BT Group PLC (GB0030913577); Bunzl PLC (GB00B0744B38); Burberry Group PLC (GB0031743007); Bureau Veritas SA (FR0006174348); CaixaBank S.A. (ES0140609019); Cargill SE (FR0000125338); Carlsberg AS (DK0010181759); Cie Génle Étis Michelin SCpA (FR0000121261); CNP Assurances S.A. (FR0000120222); Coca-Cola Europacific Pa. PLC (GB00BDCPN049); Coca-Cola HBC AG (CH0198251305); Continental AG (DE0005439004); Covestro AG (DE0006062144); Crédit Agricole S.A. (FR0000045072); Crédit Agricole S.A. - Anrechte (FR0014003323); Credit Suisse Group AG (CH0012138530); Credit Suisse Group AG - Anrechte (CH1111011453); Danske Bank AS (DK0010274414); DCC PLC (IE0002424939); Delivery Hero SE (DE000A2E4K43); Deutsche Bank AG (DE0005140008); Deutsche Lufthansa AG (DE0008232125); Deutsche Wohnen SE (DE000A0HNSC6); Direct Line Insurance Grp PLC (GB00BY9D0Y18); Edenred S.A. (FR0010908533); Edenred S.A. - Anrechte (FR0014003968); Electrolux, AB (SE0000103814); Elia Group (BE0003822393); Ems-Chemie Holding AG (CH0016440353); Entain PLC (IM00B5VQMV65); Epiroc AB (SE0011166941); Epiroc AB (SE0015658117); Epiroc AB (SE0015658133); EQT AB (SE0012853455); Erste Group Bank AG (AT0000652011); Essity AB (SE0009922164); Evolution AB (publ) (SE0012673267); Evraz PLC (GB00B71N6K86); Experian PLC (GB00B19NLV48); Faurecia SE (FR0000121147); Ferrari N.V. (NL0011585146); Fresenius Medical Care KGaA (DE0005785802); Fresenius SE & Co. KGaA (DE0005785604); Fresnillo PLC (GB00B2QPKJ12); FUCHS PETROLUB SE (DE0005790430); Getlink SE (FR0010533075); Givaudan SA (CH0010645932); GlaxoSmithKline PLC (GB0009252882); Glencore PLC (JE00B4T3BW64); Grifols S.A. (ES0171996087); Grpe Bruxelles Lambert SA (GBL) (BE0003797140); H & M Hennes & Mauritz AB (SE0000106270); H. Lundbeck A/S (DK0010287234); Halma PLC (GB0004052071); Hannover Rück SE (DE0008402215); Hargreaves Lansdown PLC (GB00B1VZ0M25); HeidelbergCement AG (DE0006047004); Heineken Holding N.V. (NL0000008977); Heineken N.V. (NL0000009165); HelloFresh SE (DE000A161408); Henkel AG & Co. KGaA (DE0006048408); Henkel AG & Co. KGaA (DE0006048432); Hexagon AB (SE0000103699); Hexagon AB (SE0015961909); Hikma Pharmaceuticals PLC (GB00B0LCW083); HOCHTIEF AG (DE0006070006); ICA Gruppen AB (SE0000652216); Iliad S.A. (FR0004035913); Imperial Brands PLC (GB0004544929); Industrivärden AB (SE0000107203); Industrivärden AB (SE0000190126); Infrastrut. Wireless Italiane (IT0005090300); InterContinental Hotels Group (GB00BHJYC057); Intertek Group PLC (GB0031638363); Intesa Sanpaolo S.p.A. (IT0000072618); Investor AB (SE0000107419); Investor AB (SE0015811963); Johnson, Matthey PLC (GB00BZ4BQC70); Julius Baer Gruppe AG (CH0102484968); Just Eat Takeaway.com N.V. (NL0012015705); KBC Groep N.V. (BE0003565737); Kerry Group PLC (IE0004906560); Kingfisher PLC (GB0033195214); Kingspan Group PLC (IE0004927939); KION GROUP AG (DE000KGX8881); Knorr-Bremse AG (DE000KBX1006); Koninklijke Vopak N.V. (NL0009432491); Kühne & Nagel Internat. AG (CH0025238863); L E Lundbergföretagen AB (SE0000108847); LA FRANCAISE DES JEUX (FR0013451333); Land Securities Group PLC (GB00BYWOPQ60); LANXESS AG (DE0005470405); Latour Investment AB (SE0010100958); LEG Immobilien SE (DE000LEG1110); LEG Immobilien SE - Anrechte (DE000LEG1227); Legal & General Group PLC (GB0005603997); Legrand S.A. (FR0010307819); Lloyds Banking Group PLC (GB0008706128); London Stock Exchange Group PLC (GB00B05WJX34); Merck KGaA (DE0006599905); Moncler S.p.A. (IT0004965148); Mondi PLC (GB00B1CRLC47); Morrison Supermarkets PLC, Wm. (GB0006043169); Mowi ASA (NO0003054108); MTU Aero Engines AG (DE000A0D9PT0); Natixis S.A. (FR0000120685); NatWest Group PLC (GB00B7T77214); Neste Oyj (FI0009013296); Nestlé S.A. (CH0038863350); NIBE Industrier AB (SE0008321293); NIBE Industrier AB (SE0015988019); Norsk Hydro ASA (NO0005052605); Novartis AG (CH0012005267); Novozymes A/S (DK00060336014); Orkla ASA

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

(NO0003733800); Orsted A/S (DK0060094928); Pandora A/S (DK0060252690); Partners Group Holding AG (CH0024608827); Pearson PLC (GB0006776081); Persimmon PLC (GB0006825383); Phoenix Group Holdings PLC (GB00BGXQNP29); PUJMA SE (DE0006969603); Raiffeisen Bank Intl AG (AT0000606306); Randstad N.V. (NL0000379121); RATIONAL AG (DE0007010803); Reckitt Benckiser Group (GB00B24CGK77); Renault S.A. (FR0000131906); Rentokil Initial PLC (GB00B082RF11); Rio Tinto PLC (GB0007188757); Roche Holding AG (CH0012032113); Rolls Royce Holdings PLC (GB00B63H8491); Royal Dutch Shell (GB00B03MLX29); Royal Dutch Shell (GB00B03MM408); Sage Group PLC, The (GB00B8C3BL03); Sainsbury PLC, J. (GB00B019KW72); Sandvik AB (SE0000667891); Schibsted ASA (NO0003028904); Schibsted ASA (NO0010736879); Schindler Holding AG (CH0024638196); Schindler Holding AG (CH0024638212); SCOR SE (FR0010411983); Scout24 AG (DE000A12DM80); Securitas AB (SE0000163594); Segro PLC (GB00B5ZN1N88); SES S.A. (LU0088087324); Severn Trent PLC (GB00B1FH8J72); SGS S.A. (CH0002497458); Siemens Gamesa Renew. En. S.A. (ES0143416115); Siemens Healthineers AG (DE0005HL1006); Sika AG (CH0418792922); Skandinaviska Enskilda Banken (SE0000148884); Skanska AB (SE0000113250); SKF AB (SE0000108227); Smith & Nephew PLC (GB0009223206); Smiths Group PLC (GB00B1WY2338); Sofina S.A. (BE0003717312); Sonova Holding AG (CH0012549785); Spirax-Sarco Engineering PLC (GB00BWFQ14); St. James's Place PLC (GB0007669376); Standard Life Aberdeen PLC (GB00BF8Q6K64); STMicroelectronics N.V. (NL0000226223); Suez S.A. (FR0010613471); Svenska Cellulosa AB (SE0000112724); Svenska Handelsbanken AB (SE0007100599); Swatch Group AG, The (CH0012255144); Swatch Group AG, The (CH0012255151); Swedish Match AB (SE0000310336); Swedish Match AB (SE0015812219); Swiss Life Holding AG (CH0014852781); Swiss Prime Site AG (CH0008038389); Swiss Re AG (CH0126881561); Swisscom AG (CH0008742519); Symrise AG (DE000SYM9999); Taylor Wimpey PLC (GB0008782301); TeamViewer AG (DE000A2YN900); Tele2 AB (SE0005190238); Telecom Italia S.p.A. (IT0003497168); Telenor ASA (NO0010063308); Téléperformance SE (FR0000051807); Telia Company AB (SE0000667925); Tesco PLC (GB00BLGZ9862); UCB S.A. (BE0003739530); Umicore S.A. (BE0974320526); Unibail-Rodamco-Westfield SE (FR0013326246); UniCredit S.p.A. (IT0005239360); Uniper SE (DE000UNSE018); United Internet AG (DE0005089031); United Utilities Group PLC (GB00B39J2M42); Verbund AG (AT0000746409); Vestas Wind Systems AS (DK0010268606); Vestas Wind Systems AS (DK0061539921); Vodafone Group PLC (GB00BH4HKS39); voestalpine AG (AT0000937503); Volkswagen AG (DE0007664005); Volvo (publ), AB (SE0000115446); Whitbread PLC (GB00B1KJJ408); Wolters Kluwer N.V. (NL0000395903); Wolters Kluwer N.V. - Anrechte (NL00150008J9); WPP PLC (JE00B8KF9B49); Yara International ASA (NO0010208051); Zurich Insurance Group AG (CH0011075394); ABB Ltd. (CH0012221716); Air Liquide-SA Ét. Expl. P.G. Cl. (FR0000120073); Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. (BE0974293251); ASML Holding N.V. (NL0010273215); BP PLC (GB0007980591); Diageo PLC (GB0002374006); ENEL S.p.A. (IT0003128367); Intesa Sanpaolo S.p.A. (IT0000072618); Nestlé S.A. (CH0038863350); Oréal S.A., L' (FR0000120321); Relx PLC (GB00B2B0DG97); Roche Holding AG - Genussscheine (CH0012032048); Royal Dutch Shell (GB00B03MLX29); Schneider Electric SE (FR0000121972); Unilever PLC (GB00B10RZP78); VINCI S.A. (FR0000125486)

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.02.2021 bis zum 31.07.2021

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 148.176,16 | 0,124 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 506.199,47 | 0,424 |
| 3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften | | 2.177,41 | 0,002 |
| 4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -22.226,43 | -0,019 |
| 5. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -44.834,39 | -0,038 |
| 6. Sonstige Erträge | | 203.636,85 | 0,171 |
| davon: Kompensationszahlungen | 203.636,84 | | 0,171 |
| Summe der Erträge | | 793.129,07 | 0,665 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Verwaltungsvergütung | | -38.465,86 | -0,032 |
| 2. Sonstige Aufwendungen | | -703,33 | -0,001 |
| davon: Negative Einlagezinsen | -703,33 | | -0,001 |
| Summe der Aufwendungen | | -39.169,19 | -0,033 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 753.959,88 | 0,632 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 50.594,10 | 0,042 |
| 2. Realisierte Verluste | | -20.274,86 | -0,017 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 30.319,24 | 0,025 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 784.279,12 | 0,657 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | 4.967.558,35 | 4,162 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | 740.902,80 | 0,621 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 5.708.461,15 | 4,783 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 6.492.740,27 | 5,440 |
| Entwicklung des Sondervermögens | | 2021 / 2022 | |
| | EUR | EUR | |
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 36.705.439,88 | |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -118.707,70 | |
| 2. Zwischenausschüttungen | | -617.280,04 | |
| 3. Mittelzufluss (netto) | | 216.059,67 | |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 224.085,07 | | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -8.025,40 | | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -892,31 | |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 6.492.740,27 | |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | 4.967.558,35 | | |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | 740.902,80 | | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | 42.677.359,77 | |

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

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **632.461,63**

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten EUR **659.545,20**

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich) EUR **2.172,08**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 2.172,08. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.

Erträge aus Kompensationszahlungen in Folge von Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich) EUR **203.472,77**

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

Sonstige Angaben

Anteilwert EUR 35,76
 Umlaufende Anteile STK 1.193.505,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) **99,44**
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 31.07.2021 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 31.07.2021 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) 0,19

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 sonstigen Erträgen (exklusive Ertragsausgleich)

Im sonstigen Ertrag sind Erträge aus Kompensationszahlungen in Höhe von 203.472,77 EUR enthalten.

Angaben zu den sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind Negative Einlagezinsen in Höhe von EUR 701,07 enthalten.

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

| Verwendete Vermögensgegenstände | Wertpapierleihe | |
|---------------------------------|-------------------------|------------|
| | EUR | |
| | absolut | 632.461,63 |
| | in % des Fondsvermögens | 1,48 |

10 größte Gegenparteien

| Bruttovolumen | Name |
|------------------|---------------------------|
| offene Geschäfte | Clearstream Banking AG |
| Sitzstaat | 632.461,63 Deutschland |

Arten von Abwicklung und Clearing

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

| | | |
|--|---------------------------------|------------|
| | unter 1 Tag | 0,00 |
| | 1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage) | 0,00 |
| | 1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage) | 0,00 |
| | 1 bis 3 Monate | 0,00 |
| | 3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage) | 0,00 |
| | über 1 Jahr | 0,00 |
| | unbefristet | 632.461,63 |

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

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 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) | 659.545,20 |
| 1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage) | 0,00 |
| 1 bis 3 Monate | 0,00 |
| 3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage) | 0,00 |
| über 1 Jahr | 0,00 |
| unbefristet | 0,00 |

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

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

| | |
|---|----------|
| absolut | 2.172,08 |
| in % der Bruttoerträge | 100,00 |
| Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent) | |
| absolut | 0,00 |
| in % der Bruttoerträge | 0,00 |

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

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

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.

1,49

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

| | |
|---|--|
| 1. Name | Bankia S.A. |
| 1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 62.413,94 |
| 2. Name | Italien, Republik |
| 2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 31.072,01 |
| 3. Name | Agence Française de Développement |
| 3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 30.112,95 |
| 4. Name | FMS Wertmanagement |
| 4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 26.470,91 |
| 5. Name | Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM] |
| 5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 25.879,06 |
| 6. Name | Landesbank Baden-Württemberg |
| 6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 22.898,97 |
| 7. Name | Investitionsbank Berlin |
| 7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 21.462,83 |
| 8. Name | Siemens AG |
| 8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 14.383,44 |
| 9. Name | NRW.BANK |
| 9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 14.342,10 |
| 10. Name | HSBC France S.A. |
| 10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 14.329,11 |

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

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

| | |
|-----------------------------------|------------------------|
| Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer | 1,00 |
| Name | Clearstream Banking AG |
| verwahrter Betrag absolut | 659.545,20 |

Deka STOXX Europe 50[®] UCITS ETF

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

| | |
|-----------------------------|------|
| gesonderte Konten / Depots | 0,00 |
| Sammelkonten/Depots | 0,00 |
| Andere Konten/Depots | 0,00 |
| Verwahrt bestimmt Empfänger | 0,00 |

Frankfurt am Main, den 2. August 2021
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 2020

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 Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The 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 2021

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