

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2021.

**Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> UCITS  
ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der EURO STOXX 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 EURO STOXX 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 EURO STOXX 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 EURO STOXX 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](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 2021	9
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2021	10
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	16

**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 EURO STOXX 50<sup>®</sup> UCITS ETF

## Anlagepolitik.

Der Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> 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 STOXX 50<sup>®</sup> Index nachzubilden. Dieser Index enthält Aktientitel von 50 Unternehmen aus den Euroländern. Die Auswahl der Titel erfolgt nach den Kriterien Börsenkapitalisierung, Börsenumsatz und Branchenzugehörigkeit. 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 STOXX 50<sup>®</sup> UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	19,3%	29,9%	7,9%

**ISIN** DE000ETFLO29

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

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

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

<b>Zu- oder Abgang</b>	<b>ISIN</b>	<b>Wertpapiername</b>
Löschung	FI0009000681	Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06
Neuaufnahme	DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.

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

Zusammensetzung des Index (%)		
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	8,94
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	5,96
IE00BZ12WP82	Linde PLC Registered Shares EO 0,001	4,47
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	4,40
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	3,31
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien o.N.	3,28
FR0000120271	Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50	3,22
FR0000120321	Oréal S.A., L Actions Port. EO 0,2	3,15
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	2,89
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	2,67
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	2,32
NL0000235190	Airbus SE Aandelen op naam EO 1	2,25
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	2,14
DE0007100000	Daimler AG Namens-Aktien o.N.	2,11
DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien o.N.	2,03
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	2,02
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	1,99
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	1,98
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien o.N.	1,91
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	1,89
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	1,88
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port. EO 4	1,85
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	1,79
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	1,76
DE000BAY0017	Bayer AG Namens-Aktien o.N.	1,65
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	1,58
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	1,51
FR0000120628	AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	1,50
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	1,42
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	1,41
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	1,40
FR0000073272	SAFRAN Actions Port. EO -,20	1,40
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port. EO-,25	1,34
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	1,27
DE0007664039	Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	1,25
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	1,18
IE0001827041	CRH PLC Registered Shares EO -,32	1,12
NL0013654783	Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	1,11
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	1,06
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	1,06
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	1,01
FI0009013403	KONE Corp. (New) Registered Shares Cl.B o.N.	0,94
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	0,91
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	0,90
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	0,89
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	0,84

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

## Zusammensetzung des Index (%)

ES0109067019	Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	0,83
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC Registered Shares EO -,09	0,81
FR0000127771	Vivendi S.A. Actions Port. EO 5,5	0,72
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port. EO 1	0,70



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

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>1.070.429.195,33</b>	<b>100,01</b>
1. Aktien		1.062.446.558,15	99,27
- Aeronautik und Weltraum	38.687.370,20		3,61
- Audiovisuelle Industrie	7.685.794,50		0,72
- Banken	70.054.954,68		6,55
- Bau und Baustoffe	30.598.991,92		2,86
- Chemische Industrie	93.653.042,42		8,75
- Einzelhandel	11.257.912,89		1,05
- Elektrik / Elektronik	138.231.513,19		12,92
- Energieversorger	93.039.420,86		8,69
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	55.245.564,20		5,16
- Pharmaindustrie / Biotech	115.546.939,30		10,80
- Real Estate	10.742.683,42		1,00
- Software	46.763.871,60		4,37
- Sonstige Finanzdienstleistungen	9.475.008,50		0,89
- Sonstige industrielle Werte	34.875.015,84		3,26
- Sonstiges	31.540.254,38		2,95
- Telekommunikation	31.903.946,15		2,98
- Textilien und Kleidung	103.169.781,00		9,64
- Transportation	19.934.188,39		1,86
- Unterhaltungsindustrie	8.555.430,60		0,80
- Verbrauchsgüter	53.546.681,59		5,00
- Versicherungen	57.938.192,52		5,41
2. Forderungen		1.082.566,82	0,10
3. Bankguthaben		6.900.070,36	0,64
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-130.919,70</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>1.070.298.275,63</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> 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		66.151	9.446	5.635	EUR 306,100	20.248.821,10	1,89	
DE0008404005	Allianz SE	STK		146.076	20.864	12.538	EUR 210,000	30.675.960,00	2,87	
DE000BASF111	BASF SE	STK		325.418	46.478	27.931	EUR 66,220	21.549.179,96	2,01	
DE000BAY0017	Bayer AG	STK		348.075	49.715	29.875	EUR 50,290	17.504.691,75	1,64	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		113.534	16.216	9.744	EUR 83,880	9.523.231,92	0,89	
DE0007100000	Daimler AG	STK		297.437	42.481	25.528	EUR 75,280	22.391.057,36	2,09	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		67.318	9.616	5.778	EUR 140,750	9.475.008,50	0,89	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		349.049	49.851	29.957	EUR 57,110	19.934.188,39	1,86	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		1.148.842	164.084	98.603	EUR 17,506	20.111.628,05	1,88	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		462.691	497.393	34.702	EUR 32,135	14.868.575,29	1,39	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		49.638	7.090	4.260	EUR 227,900	11.312.500,20	1,06	
DE0007164600	SAP SE	STK		386.990	55.288	33.436	EUR 120,840	46.763.871,60	4,37	
DE0007236101	Siemens AG	STK		265.048	37.832	22.782	EUR 131,580	34.875.015,84	3,26	
DE0007664039	Volkswagen AG	STK		64.862	9.263	5.566	EUR 205,500	13.329.141,00	1,25	
DE000A1ML711	Vonovia SE	STK		191.219	36.529	22.485	EUR 56,180	10.742.683,42	1,00	
							EUR	303.305.554,38	28,34	
Ausland										
NL0012969182	Adyen N.V.	STK		9.925	1.432	833	EUR 2.289,500	22.723.287,50	2,12	
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK		370.502	54.773	27.612	EUR 26,195	9.705.299,89	0,91	
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl.	STK		167.852	23.993	14.372	EUR 146,580	24.603.746,16	2,30	
NL0000235190	Airbus SE	STK		206.277	30.121	17.638	EUR 115,700	23.866.248,90	2,23	
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK		159.612	22.796	13.699	EUR 55,240	8.816.966,88	0,82	
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	STK		300.080	42.776	24.597	EUR 53,400	16.024.272,00	1,50	
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK		148.629	21.388	14.975	EUR 639,000	94.973.931,00	8,87	
FR0000120628	AXA S.A.	STK		728.964	104.145	66.333	EUR 21,880	15.949.732,32	1,49	
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK		6.143.820	877.497	527.314	EUR 3,088	18.969.044,25	1,77	
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK		408.577	58.355	35.067	EUR 51,450	21.021.286,65	1,96	
IE0001827041	CRH PLC <sup>2)</sup>	STK		281.719	40.352	25.799	EUR 42,250	11.902.627,75	1,11	
FR0000120644	Danone S.A.	STK		230.235	33.007	19.723	EUR 62,060	14.288.384,10	1,33	
IT0003128367	ENEL S.p.A. <sup>2)</sup>	STK		2.752.344	393.106	236.229	EUR 7,780	21.413.236,32	2,00	
FR0010208488	Engie S.A.	STK		658.854	94.102	56.549	EUR 11,252	7.413.425,21	0,69	
IT0003132476	ENI S.p.A.	STK		890.013	127.118	76.389	EUR 10,024	8.921.490,31	0,83	
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. <sup>2)</sup>	STK		105.642	16.136	9.845	EUR 159,160	16.813.980,72	1,57	
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC	STK		59.454	11.375	4.400	EUR 143,900	8.555.430,60	0,80	
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK		2.076.357	295.276	155.730	EUR 10,160	21.095.787,12	1,97	
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK		393.771	56.242	33.797	EUR 28,590	11.257.912,89	1,05	
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK		1.382.657	198.030	118.608	EUR 10,846	14.996.297,82	1,40	
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK		6.462.932	923.075	554.703	EUR 2,332	15.068.325,96	1,41	
FR0000121485	Kering S.A.	STK		25.952	3.727	2.680	EUR 756,200	19.624.902,40	1,83	
FI0009013403	KONE Oyj	STK		143.256	20.414	12.627	EUR 69,820	10.002.133,92	0,93	
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK		322.787	46.101	27.704	EUR 38,890	12.553.186,43	1,17	
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK		184.002	26.336	17.415	EUR 258,150	47.500.116,30	4,44	
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK		93.925	13.417	8.080	EUR 673,900	63.296.057,50	5,91	
FR0000120321	Oréal S.A., l'	STK		86.828	12.636	7.307	EUR 385,900	33.506.925,20	3,13	
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. <sup>2)</sup>	STK		72.696	11.267	5.452	EUR 186,100	13.528.725,60	1,26	
NL0013654783	Prosus N.V.	STK		157.546	22.501	13.522	EUR 74,850	11.792.318,10	1,10	
FR0000073272	SAFRAN	STK		134.371	26.654	10.078	EUR 110,300	14.821.121,30	1,38	
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK		404.790	58.345	34.687	EUR 86,880	35.168.155,20	3,29	
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK		200.913	28.695	17.244	EUR 141,300	28.389.006,90	2,65	
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK		931.757	133.681	88.352	EUR 36,700	34.195.481,90	3,19	
FR0000125486	VINCI S.A.	STK		209.577	37.512	15.718	EUR 89,210	18.696.364,17	1,75	
FR0000127771	Vivendi S.A. <sup>2)</sup>	STK		269.677	43.294	62.642	EUR 28,500	7.685.794,50	0,72	
							EUR	759.141.003,77	70,93	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	1.062.446.558,15	99,27
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	6.900.070,36	0,64
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	6.900.070,36			% 100,000	6.900.070,36	0,64	
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	1.082.566,82	0,10
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	1.082.224,72				1.082.224,72	0,10	
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	342,10				342,10	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-130.919,70	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-130.919,70				-130.919,70	-0,01	
Fondsvermögen								EUR	1.070.298.275,63	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert								EUR	41,20	
Umlaufende Anteile								STK	25.981.099,00	

<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 STOXX 50<sup>®</sup> UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung		Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Wertpapierdarlehen Kurswert in EUR		gesamt
				befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen						
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:						
IE0001827041	CRH PLC	STK	8.972		379.067,00	
IT0003128367	ENEL S.p.A.	STK	35.826		278.726,28	
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK	31		4.933,96	
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	2.347		436.776,70	
FR0000127771	Vivendi S.A.	STK	7.137		203.404,50	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen					1.302.908,44	<b>1.302.908,44</b>

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurse per 30.07.2021

Devisenkurse (in Mengennotiz)		30.07.2021
US-Dollar	(USD)	1,18580 = 1 Euro (EUR)

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

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzugänge zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Ausland</b>					
ES06445809M0	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	2.076.357	2.076.357	
FI0009000681	Nokia Oyj	STK	138.549	1.931.026	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			135.133

(Basiswerte: adidas AG (DE000A1EWWW0); Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. (FR0000120073); Airbus SE (NL0000235190); Allianz SE (DE0008404005); AXA S.A. (FR0000120628); Banco Santander S.A. (ES0113900J37); Bayer AG (DE000BAY0017); Bayerische Motoren Werke AG (DE0005190003); BNP Paribas S.A. (FR0000131104); Danone S.A. (FR0000120644); Deutsche Börse AG (DE0005810055); Deutsche Post AG (DE0005552004); Deutsche Telekom AG (DE0005557508); ENI S.p.A. (IT0003132476); EssilorLuxottica S.A. (FR0000121667); EssilorLuxottica S.A. - Anrechte (FR0014002Z59); Industria de Diseño Textil SA (ES0148396007); Infineon Technologies AG (DE0006231004); ING Groep N.V. (NL0011821202); Intesa Sanpaolo S.p.A. (IT0000072618); Kering S.A. (FR0000121485); KONE Oyj (FI0009013403); Koninklijke Philips N.V. (NL0000009538); Koninklijke Philips N.V. - Anrechte (NL0015000AH4); Linde PLC (IE00BZ12WV82); LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE (FR0000121014); Münchener Rückvers.-Ges. AG (DE0008430026); Pernod-Ricard S.A. (FR0000120693); Sanofi S.A. (FR0000120578); SAP SE (DE0007164600); Schneider Electric SE (FR0000121972); Vivendi S.A. (FR0000127771); Vonovia SE (DE000A1ML711); Vonovia SE - Anrechte (DE000A3H3L51); Vonovia SE - Anrechte (DE000A3H3L69))

# Deka EURO STOXX 50<sup>®</sup> 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 <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		6.863.598,51	0,264
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		10.251.702,17	0,395
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		9.079,49	0,000
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-1.029.539,73	-0,040
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-189.975,91	-0,007
6. Sonstige Erträge		366.697,76	0,014
davon: Kompensationszahlungen	366.697,76		0,014
Summe der Erträge		16.271.562,29	0,626
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-767.313,15	-0,030
2. Sonstige Aufwendungen		-17.278,15	-0,001
davon: Bankgebühren	-42,78		0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-17.235,37		-0,001
Summe der Aufwendungen		-784.591,30	-0,030
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		15.486.970,99	0,596
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		19.109.603,01	0,736
2. Realisierte Verluste		-5.865.758,86	-0,226
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		13.243.844,15	0,510
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		28.730.815,14	1,106
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		110.418.554,26	4,250
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		30.862.534,53	1,188
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		141.281.088,79	5,438
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		170.011.903,93	6,544
<b>Entwicklung des Sondervermögens</b>		2021 / 2022	
	EUR	EUR	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		848.962.056,45	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-3.135.855,72	
2. Zwischenausschüttungen		-10.828.061,58	
3. Mittelzufluss (netto)		65.428.401,73	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	143.581.341,94		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-78.152.940,21		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-140.169,18	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		170.011.903,93	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	110.418.554,26		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	30.862.534,53		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		1.070.298.275,63	

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

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

## Anhang.

### Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 1.302.908,44

### 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>95.276,62</b>
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		95.276,62
<b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten</b>	<b>EUR</b>		<b>1.352.923,88</b>
<b>Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren</b>	<b>EUR</b>		<b>9.052,69</b>

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 9.052,69. 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 369.710,29

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

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	41,20
Umlaufende Anteile	STK	25.981.099,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 99,27

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) 0,14

### 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)

Dem Sondervermögen wurden im Geschäftszeitraum Kompensationszahlungen in Höhe von 369.710,29 EUR gutgeschrieben.

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

In den sonstigen Aufwendungen sind Negative Einlagezinsen in Höhe von EUR 17.035,71 enthalten.

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

Verwendete Vermögensgegenstände	Wertpapierleihe	
	EUR	
	absolut	1.302.908,44
	in % des Fondsvermögens	0,12

### 10 größte Gegenparteien

Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	4.933,96
Sitzstaat	Deutschland
Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.297.974,48
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)

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

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	0,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	1.302.908,44

## 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)	1.352.923,88
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	95.276,62

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	9.052,69
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

0,12

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)	128.670,97
2. Name	Bankia S.A.
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	128.055,34
3. Name	Italien, Republik
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	63.748,96
4. Name	Agence Française de Développement
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	61.783,24
5. Name	FMS Wertmanagement
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	54.309,94
6. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	53.095,14
7. Name	Landesbank Baden-Württemberg
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	46.982,54
8. Name	Investitionsbank Berlin

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

8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	44.036,09
9. Name	Siemens AG
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	29.605,91
10. Name	NRW.BANK
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	29.425,24

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

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

**Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte**

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	1,00
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	1.452.973,26

**Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte**

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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

---

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 Squaire  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin



**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Juli 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](http://www.deka-etf.de)