

Halbjahresbericht
zum 31. Juli 2022.

**Deka EURO STOXX 50[®] 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 2022

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 2022 bis zum 31. Juli 2022.

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

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

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Juli 2022	9
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2022	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 beigefügt sind, erfolgen.

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Anlagepolitik.

Der Deka EURO STOXX 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 EURO STOXX 50[®] 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[®] UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	-8,1%	-7,0%	4,3%
ISIN	DE000ETFLO29		

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

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FR0014008VX5	EuroAPI SAS Actions Nom. EO 1
Neuaufnahme	FR0014008VX5	EuroAPI SAS Actions Nom. EO 1

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)

NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	8,14
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	6,41
IE00BZ12WP82	Linde PLC Registered Shares EO 0,001	5,33
FR0000120271	TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	4,68
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	4,02
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	3,57
FR0000120321	Oréal S.A., L Actions Port. EO 0,2	3,23
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien o.N.	2,94
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	2,76
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	2,61
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	2,53
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	2,31
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	2,21
NL0000235190	Airbus SE Aandelen op naam EO 1	2,21
NL0013654783	Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	2,05
DE000BAY0017	Bayer AG Namens-Aktien o.N.	2,02
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	1,89
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	1,89
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	1,80
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	1,70
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	1,68
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	1,65
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	1,62
FR0000120628	AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	1,60
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	1,50
FR0000073272	SAFRAN Actions Port. EO -,20	1,46
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port. EO 4	1,46
DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien o.N.	1,44
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	1,42
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	1,38
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	1,38
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	1,34
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	1,25
FR0000120644	Danone S.A. Actions Port. EO-,25	1,24
DE0005810055	Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	1,17
NL00150001Q9	Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	1,14
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	1,14
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	1,12
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien o.N.	1,08
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	1,06
IE0001827041	CRH PLC Registered Shares EO -,32	1,05
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	1,01
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	0,99
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	0,95
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	0,92
DE0007664039	Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	0,91

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)

DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	0,84
FI0009013403	KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N.	0,65
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	0,64
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC Registered Shares EO -,09	0,62

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Juli 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		867.875.860,77	100,01
1. Aktien		858.856.545,94	98,97
- Aeronautik und Weltraum	31.552.685,34		3,64
- Banken	58.861.082,92		6,78
- Bau und Baustoffe	25.236.812,06		2,91
- Chemische Industrie	79.844.912,95		9,20
- Einzelhandel	8.156.680,21		0,94
- Elektrik / Elektronik	104.409.355,02		12,03
- Energieversorger	80.156.159,15		9,24
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	44.927.359,64		5,18
- Pharmaindustrie / Biotech	99.303.819,12		11,44
- Real Estate	7.215.418,46		0,83
- Software	30.629.164,96		3,53
- Sonstige Dienstleistungen	15.448.485,00		1,78
- Sonstige Finanzdienstleistungen	10.035.971,00		1,16
- Sonstige industrielle Werte	25.240.434,30		2,91
- Telekommunikation	37.484.138,00		4,32
- Textilien und Kleidung	91.407.315,80		10,53
- Transportation	11.872.474,50		1,37
- Unterhaltungsindustrie	5.322.529,44		0,61
- Verbrauchsgüter	45.982.760,39		5,30
- Versicherungen	45.768.987,68		5,27
2. Forderungen		1.008.861,87	0,12
3. Bankguthaben		8.010.452,96	0,92
II. Verbindlichkeiten		-97.908,45	-0,01
III. Fondsvermögen		867.777.952,32	100,00

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

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK		55.263	1.006	6.341	EUR 167,800	9.273.131,40	1,07	
DE0008404005	Allianz SE	STK		126.539	2.684	8.714	EUR 177,320	22.437.895,48	2,59	
DE000BASF111	BASF SE	STK		284.543	6.038	19.597	EUR 43,415	12.353.434,35	1,42	
DE000BAY0017	Bayer AG	STK		304.353	6.458	20.961	EUR 57,000	17.348.121,00	2,00	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		99.272	2.106	6.837	EUR 79,480	7.890.138,56	0,91	
DE0007100000	Daimler AG	STK		243.570	4.349	33.248	EUR 57,220	13.937.075,40	1,61	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		58.862	1.249	4.053	EUR 170,500	10.035.971,00	1,16	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		305.205	6.477	21.021	EUR 38,900	11.872.474,50	1,37	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		1.074.250	22.792	73.982	EUR 18,506	19.880.070,50	2,29	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		404.572	8.584	27.862	EUR 26,550	10.741.386,60	1,24	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		43.402	920	2.989	EUR 221,100	9.596.182,20	1,11	
DE0007164600	SAP SE	STK		337.772	6.554	23.287	EUR 90,680	30.629.164,96	3,53	
DE0007236101	Siemens AG	STK		232.545	4.737	16.011	EUR 108,540	25.240.434,30	2,91	
DE0007664039	Volkswagen AG	STK		56.714	1.204	3.907	EUR 137,300	7.786.832,20	0,90	
DE000A1ML711	Vonovia SE	STK		222.218	22.511	26.838	EUR 32,470	7.215.418,46	0,83	
							EUR	216.237.730,91	24,92	
Ausland										
NL0012969182	Adyen N.V. ²⁾	STK		8.853	336	609	EUR 1.745,000	15.448.485,00	1,78	
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK		323.963	6.874	22.312	EUR 26,885	8.709.745,26	1,00	
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl.	STK		162.005	19.114	10.903	EUR 134,120	21.728.110,60	2,50	
NL0000235190	Airbus SE	STK		180.998	4.462	12.440	EUR 104,880	18.983.070,24	2,19	
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. ²⁾	STK		276.300	6.326	19.029	EUR 52,270	14.442.201,00	1,66	
NL0010273215	ASML Holding N.V. ²⁾	STK		125.925	2.242	10.467	EUR 555,400	69.938.745,00	8,06	
FR0000120628	AXA S.A.	STK		611.800	11.355	67.560	EUR 22,450	13.734.910,00	1,58	
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK		1.919.652	34.545	279.024	EUR 4,417	8.479.102,88	0,98	
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK		5.291.567	89.840	426.355	EUR 2,440	12.911.423,48	1,49	
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK		352.490	6.302	28.091	EUR 46,000	16.214.540,00	1,87	
IE0001827041	CRH PLC	STK		239.827	4.303	22.547	EUR 37,425	8.975.525,48	1,03	
FR0000120644	Danone S.A.	STK		198.073	3.373	16.553	EUR 53,810	10.658.308,13	1,23	
IT0003128367	ENEL S.p.A.	STK		2.406.621	51.064	165.743	EUR 4,909	11.814.102,49	1,36	
IT0003132476	ENI S.p.A.	STK		778.218	16.512	53.595	EUR 11,716	9.117.602,09	1,05	
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK		93.072	1.661	6.425	EUR 152,450	14.188.826,40	1,64	
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC	STK		54.456	1.260	3.749	EUR 97,740	5.322.529,44	0,61	
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK		10.927	229	753	EUR 1.334,000	14.576.618,00	1,68	
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK		1.821.035	59.819	125.412	EUR 10,430	18.993.395,05	2,19	
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK		344.309	7.304	23.711	EUR 23,690	8.156.680,21	0,94	
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK		1.210.356	26.571	83.319	EUR 9,491	11.487.488,80	1,32	
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK		5.651.121	119.904	389.189	EUR 1,729	9.768.527,76	1,13	
FR0000121485	Kering S.A.	STK		22.506	383	1.573	EUR 556,900	12.533.591,40	1,44	
FI0009013403	KONE Oyj	STK		124.546	2.027	8.594	EUR 44,500	5.542.297,00	0,64	
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK		273.830	4.950	28.871	EUR 20,155	5.519.043,65	0,64	
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK		154.920	2.072	12.930	EUR 295,400	45.763.368,00	5,27	
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK		81.517	1.602	5.618	EUR 675,000	55.023.975,00	6,34	
FR0000120321	Oréal S.A., l'	STK		75.261	1.862	5.172	EUR 368,100	27.703.574,10	3,19	
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK		63.564	1.349	4.378	EUR 191,500	12.172.506,00	1,40	
NL0013654783	Prosus N.V.	STK		276.750	12.715	18.769	EUR 63,610	17.604.067,50	2,03	
FR0000073272	SAFRAN	STK		117.495	2.494	8.092	EUR 106,980	12.569.615,10	1,45	
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK		355.357	8.103	24.451	EUR 97,210	34.544.253,97	3,98	
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK		176.373	3.829	12.142	EUR 134,540	23.729.223,42	2,73	
NL00150001Q9	Stellantis N.V.	STK		701.840	15.760	48.299	EUR 13,922	9.771.016,48	1,13	
FR0000120271	TotalEnergies SE ²⁾	STK		808.502	14.348	62.824	EUR 49,760	40.231.059,52	4,64	
FR0000125486	VINCI S.A.	STK		174.141	2.427	22.491	EUR 93,380	16.261.286,58	1,87	
							EUR	642.618.815,03	74,05	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	858.856.545,94	98,97
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	8.010.452,96	0,92
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	8.010.452,96			% 100,000	8.010.452,96	0,92	
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	1.008.861,87	0,12
Forderungen aus Kompensationszahlungen			EUR	10.850,10				10.850,10	0,00	
Forderungen aus Quellensteuerrückstattung			EUR	997.560,48				997.560,48	0,11	
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	451,29				451,29	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-97.908,45	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungvergütung			EUR	-97.908,49				-97.908,45	-0,01	
Fondsvermögen								EUR	867.777.952,32	100,00 ¹⁾
Anteilwert			EUR					37,47		
Umlaufende Anteile			STK					23.161.645,00		

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.

Deka EURO STOXX 50[®] 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:						
NL0012969182	Adyen N.V.	STK	1.779		3.104.355,00	
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	STK	222.624		11.636.556,48	
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	5.433		3.017.488,20	
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	21.000		1.044.960,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen					18.803.359,68	18.803.359,68

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurse per 29.07.2022

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					
FR0000120222	CNP Assurances S.A.	STK	1.009	1.009	
FR0014008VX5	EuroAPI SAS	STK	16.151	16.151	
ES0644580906	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	1.821.035	1.821.035	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			115.403

(Basiswerte: adidas AG (DE000A1EWWW0); Adyen N.V. (NL0012969182); Ahold Delhaize N.V., Koninkl. (NL0011794037); Air Liquide-SA Ét. Expl. P.G. Cl. (FR0000120073); Airbus SE (NL0000235190); Allianz SE (DE0008404005); Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. (BE0974293251); ASML Holding N.V. (NL0010273215); AXA S.A. (FR0000120628); Banco Bilbao Vizcaya Argent. (ES0113211835); Banco Santander S.A. (ES0113900J37); BASF SE (DE000BASF111); BNP Paribas S.A. (FR0000131104); Daimler AG (DE0007100000); Danone S.A. (FR0000120644); Deutsche Börse AG (DE0005810055); Deutsche Post AG (DE0005552004); Deutsche Telekom AG (DE0005557508); ENEL S.p.A. (IT0003128367); ENI S.p.A. (IT0003132476); EssilorLuxottica S.A. (FR0000121667); EssilorLuxottica S.A. - Anrechte (FR0014009LO3); EuroAPI SAS (FR0014008VX5); Hermes International S.C.A. (FR0000052292); Iberdrola S.A. (ES0144580Y14); 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 (NL0015000VF4); LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE (FR0000121014); Münchener Rückvers.-Ges. AG (DE0008430026); Oréal S.A., L' (FR0000120321); Pernod-Ricard S.A. (FR0000120693); Prosus N.V. (NL0013654783); SAFRAN (FR0000073272); Sanofi S.A. (FR0000120578); SAP SE (DE0007164600); Schneider Electric SE (FR0000121972); Siemens AG (DE0007236101); TotalEnergies SE (FR0000120271); VINCI S.A. (FR0000125486); Volkswagen AG (DE0007664039))

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.02.2022 bis zum 31.07.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		8.781.429,74	0,379
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		14.150.162,70	0,611
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		3.960,92	0,000
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-1.317.227,28	-0,057
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-481.626,70	-0,021
6. Sonstige Erträge		121.387,59	0,005
davon: Kompensationszahlungen	121.387,59		0,005
Summe der Erträge		21.258.086,97	0,918
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-663.084,18	-0,029
2. Sonstige Aufwendungen		-17.495,48	-0,001
davon: Kosten Erstattung Quellensteuer		-54,56	0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-17.436,50		-0,001
Summe der Aufwendungen		-680.579,66	-0,029
III. Ordentlicher Nettoertrag		20.577.507,31	0,888
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		9.462.170,87	0,409
2. Realisierte Verluste		-6.225.810,11	-0,269
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		3.236.360,76	0,140
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		23.813.868,07	1,028
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-72.811.545,02	-3,144
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-47.397.624,96	-2,046
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-120.209.169,98	-5,190
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-96.395.301,91	-4,162

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023	
	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		1.025.867.443,17
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-2.972.499,24
2. Zwischenausschüttungen		-13.886.137,65
3. Mittelzufluss (netto)		-45.320.560,19
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	12.473.430,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-57.793.990,19	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		485.008,14
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-96.395.301,91
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-72.811.545,02	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-47.397.624,96	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		867.777.952,32

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

Deka EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **18.803.359,68**

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen
 Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten	EUR		18.653.533,85

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	EUR	4.040,07
---	------------	-----------------

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 4.040,07. 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	123.667,39
---	------------	-------------------

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

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	37,47
Umlaufende Anteile	STK	23.161.645,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,97
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,33
--	------

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Erträgen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Erträgen sind Kompensationszahlungen in Höhe von EUR 123667,39 enthalten.

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -17.883,25 und Spesen für Steuerrückerstattungen in Höhe von EUR -55,15 enthalten.

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

Wertpapierleihe

EUR

Verwendete Vermögensgegenstände	absolut	18.803.359,68
	in % des Fondsvermögens	2,17

10 größte Gegenparteien

Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	18.803.359,68
Sitzstaat	Deutschland

Arten von Abwicklung und Clearing

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	0,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	18.803.359,68

Deka EURO STOXX 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)	18.653.533,85
	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	4.040,07
	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.

2,19

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Spanien, Königreich
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4.010.517,81
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3.669.220,65
3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	865.264,46
4. Name	Portugal, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	822.106,21
5. Name	ENI S.p.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	801.748,84
6. Name	Spanien, Königreich
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	715.548,50
7. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	676.708,59
8. Name	Europäische Union
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	510.392,82
9. Name	Royal Bank of Canada
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	476.873,70
10. Name	Deutschland, Bundesrepublik
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	474.161,02

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	18.653.533,85

Deka EURO STOXX 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 1. August 2022

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 2021

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg 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 2022

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