

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2021.

**Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong  
Value 20 UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der STOXX® Europe Strong Value 20 Index ist das geistige Eigentum (inklusive registrierte Marken) der STOXX Ltd., Zug, Schweiz ("STOXX"), der Gruppe Deutsche Börse oder deren Lizenzgeber und wird unter einer Lizenz verwendet. Deka STOXX® Europe Strong Value 20 UCITS ETF ist weder gefördert noch beworben, vertrieben oder in irgendeiner anderen Weise von STOXX, der Gruppe Deutsche Börse oder von deren Lizenzgebern, Forschungspartnern oder Datenlieferanten unterstützt und STOXX, die Gruppe Deutsche Börse und deren Lizenzgeber, Forschungspartner oder Datenlieferanten übernehmen keinerlei Gewährleistung und schliessen jegliche Haftung (aus fahrlässigem sowie aus anderem Verhalten) diesbezüglich generell aus und im speziellen in Bezug auf jegliche Fehler, Unterlassungen oder Störungen des STOXX® Europe Strong Value 20 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 Strong Value 20 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	8
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2021	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

**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<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf ausgerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 Index nachzubilden. Dieser Index bildet 20 Value-Unternehmen in Europa ab. Die Value-Eigenschaft der einzelnen Unternehmen wird durch die Analyse von 6 fundamentalen Kennzahlen ermittelt, z.B. Kurs/Gewinn-Verhältnis, Marktwert/Buchwert-Verhältnis, Dividendenrendite und Gewinnwachstum. Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrunde liegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt.

Grundlage hierfür ist, dass die Entscheidungen über den Erwerb oder die Veräußerung von Vermögensgegenständen sowie über deren Gewichtung im Sondervermögen von dem zugrunde liegenden Index abhängig sind (passives Management).

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<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	29,1%	71,0%	11,0%
<b>ISIN</b>	DE000ETFLO45		

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

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 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<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
PLALIOR00045	Alior Bank S.A. Inhaber-Aktien ZY 10	7,90
IT0003007728	Tods S.p.A. Azioni nom. EO 2	7,20
DE0006202005	Salzgitter AG Inhaber-Aktien o.N.	7,07
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG Namens-Aktien o.N.	7,03
NO0010716582	Aker Solutions ASA Navne-Aksjer NK 1,08	6,69
LU0156801721	Tenaris S.A. Actions Nom. DL 1	5,73
CH0010702154	Komax Holding AG Nam.-Akt. SF 0,10	5,35
SE0008374250	Fingerprint Cards AB Namn-Aktier B SK -,04	5,27
FR0000121121	Eurazeo SE Actions au Porteur o.N.	5,23
DE0005909006	Bilfinger SE Inhaber-Aktien o.N.	4,89
CH0023405456	Dufry AG Nam.-Aktien SF 5	4,75
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International PLC Registered Shares LS -,10	4,54
FR0000077919	JCDecaux S.A. Actions au Porteur o.N.	4,33
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	3,88
BMG4593F1389	Hiscox Ltd. Registered Shares LS -,065	3,82
SE0007640156	Scandic Hotels Group AB Namn-Aktier EO -,25	3,58
IT0000433307	Saras S.p.A. Raffinerie Sarde Azioni nom. o.N.	3,53
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3	3,51
IT0003506190	Atlantia S.p.A. Azioni Nom. EO 1	3,24
GB00B0H2K534	Petrofac Ltd. Registered Shares DL -,02	2,47

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>58.268.908,67</b>	<b>100,05</b>
1. Aktien		58.071.909,03	99,72
- Banken	9.875.289,30		16,96
- Bau und Baustoffe	4.872.855,86		8,37
- Bergbau	4.104.088,78		7,05
- Chemische Industrie	3.887.467,34		6,68
- Einzelhandel	6.843.016,46		11,75
- Elektrik / Elektronik	3.059.664,73		5,25
- Energieversorger	3.483.577,49		5,98
- Freizeit/Tourismus	2.077.980,21		3,57
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	3.108.597,75		5,34
- Software	2.636.613,00		4,53
- Sonstige industrielle Werte	5.209.132,15		8,94
- Textilien und Kleidung	4.178.496,30		7,17
- Unterhaltungsindustrie	2.514.084,00		4,32
- Versicherungen	2.221.045,66		3,81
2. Forderungen		78.554,72	0,13
3. Bankguthaben		118.444,92	0,20
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-31.218,32</b>	<b>-0,05</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>58.237.690,35</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 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									
DE0005909006	Bilfinger SE	STK		109.369	39.790	2.333	EUR 25,940	2.837.031,86	4,87
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG	STK		80.822	29.403	1.723	EUR 50,540	4.084.743,88	7,01
DE0006202005	Salzgitter AG	STK		125.201	45.549	2.669	EUR 32,780	4.104.088,78	7,05
							EUR	11.025.864,52	18,93
Ausland									
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.	STK		19.920	7.246	424	EUR 102,200	2.035.824,00	3,50
NO0010716582	Aker Solutions ASA	STK		2.422.764	881.424	51.666	NOK 16,810	3.887.467,34	6,68
PLALIOR00045	Alior Bank S.A.	STK		567.113	206.321	12.094	PLN 36,920	4.586.345,10	7,88
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	STK		122.814	44.681	2.619	EUR 15,300	1.879.054,20	3,23
CH0023405456	Dufry AG	STK		61.718	22.454	1.317	CHF 48,030	2.758.272,58	4,74
FR0000121121	Eurazeo SE	STK		37.148	13.515	792	EUR 81,700	3.034.991,60	5,21
SE0008374250	Fingerprint Cards AB	STK		1.018.499	370.539	21.720	SEK 30,650	3.059.664,73	5,25
BMG4593F1389	Hiscox Ltd.	STK		216.149	78.637	4.609	GBP 8,764	2.221.045,66	3,81
FR0000077919	JCDecaux S.A.	STK		109.308	39.767	2.331	EUR 23,000	2.514.084,00	4,32
CH0010702154	Komax Holding AG	STK		12.550	4.565	267	CHF 266,200	3.108.597,75	5,34
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International PLC	STK		559.952	203.715	11.941	GBP 4,016	2.636.613,00	4,53
GB00B0H2K534	Petrofac Ltd. <sup>2)</sup>	STK		1.184.434	430.908	25.258	GBP 1,033	1.434.541,35	2,46
IT0000433307	Saras S.p.A. Raffinerie Sarde <sup>2)</sup>	STK		3.304.897	1.202.352	70.478	EUR 0,620	2.049.036,14	3,52
SE0007640156	Scandic Hotels Group AB	STK		604.537	219.936	12.892	SEK 35,070	2.077.980,21	3,57
LU0156801721	Tenaris S.A. <sup>2)</sup>	STK		388.302	141.267	8.280	EUR 8,576	3.330.077,95	5,72
IT0003007728	Tod's S.p.A.	STK		78.914	28.710	1.683	EUR 52,950	4.178.496,30	7,17
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK		222.987	81.124	4.755	EUR 10,108	2.253.952,60	3,87
							EUR	47.046.044,51	80,78
							EUR	58.071.909,03	99,72
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	118.444,92	0,20
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle			EUR	118.444,92	%	100,000	EUR	118.444,92	0,20
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenansprüche			EUR	42.441,04			EUR	78.554,72	0,13
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	35.070,23				42.441,04	0,07
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	1.043,45				35.070,23	0,06
								1.043,45	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-31.218,32			EUR	-31.218,32	-0,05
								-31.218,32	-0,05
Fondsvermögen									
Anteilwert							EUR	58.237.690,35	100,00 <sup>1)</sup>
Umlaufende Anteile							EUR	24,84	
							STK	2.344.636,00	

<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.

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:							
GB00B0H2K534	Petrofac Ltd.	STK	500.000			605.580,96	
IT0000433307	Saras S.p.A. Raffinerie Sarde	STK	380.000			235.600,00	
LU0156801721	Tenaris S.A.	STK	388.302			3.330.077,95	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen						4.171.258,91	<b>4.171.258,91</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
Britisches Pfund	(GBP)	0,85290 = 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,07470 = 1 Euro (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,56525 = 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	10,20275 = 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	10,47640 = 1 Euro (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	25,47650 = 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,18580 = 1 Euro (EUR)

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 UCITS ETF

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
	Norwegische Krone (NOK)	10,4764 = 1 EUR			
	Tschechische Kronen (CZK)	25,4765 = 1 EUR			
	US-Dollar (USD)	1,1858 = 1 EUR			
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
	unbefristet	EUR			19.291

(Basiswerte: Bilfinger SE (DE0005909006); Dufry AG (CH0023405456); Salzgitter AG (DE0006202005); Tenaris S.A. (LU0156801721); Tod's S.p.A. (IT0003007728); UniCredit S.p.A. (IT0005239360))

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 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)		210.053,08	0,090
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		234.119,79	0,100
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		4.667,71	0,002
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-31.506,64	-0,013
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		68,92	0,000
6. Sonstige Erträge		0,25	0,000
Summe der Erträge		417.403,11	0,178
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-176.198,14	-0,075
2. Sonstige Aufwendungen		-91.560,40	-0,039
davon: Domizilierungsgebühren	-62,33		0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-687,81		0,000
Summe der Aufwendungen		-267.758,54	-0,114
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		149.644,57	0,064
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		287.248,47	0,123
2. Realisierte Verluste		-11.223,32	-0,005
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		276.025,15	0,118
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		425.669,72	0,182
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		9.632.812,52	4,108
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-163.877,85	-0,070
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		9.468.934,67	4,039
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		9.894.604,39	4,220
<b>Entwicklung des Sondervermögens</b>		2021 / 2022	
	EUR	EUR	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		29.745.391,46	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00	
2. Zwischenausschüttungen		-183.570,88	
3. Mittelzufluss (netto)		18.812.343,65	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	20.039.061,90		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.226.718,25		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-31.078,27	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		9.894.604,39	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	9.632.812,52		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-163.877,85		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		58.237.690,35	

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

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 UCITS ETF

## Anhang.

**Angaben nach der Derivateverordnung**  
**Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR **4.171.258,91**

### Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

**Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten** EUR **4.413.454,95**

**Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR **4.075,09**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 4.075,09. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.

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

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	24,84
Umlaufende Anteile	STK	2.344.636,00

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>99,72</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>0,00</b>

### 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) 0,24

### 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 0,25 EUR Rundungsdifferenzen enthalten.

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

In den sonstigen Aufwendungen ist ein Betrag in Höhe von EUR 89.824,25 enthalten, der aus der Veräußerungsgewinnbesteuerung tschechischer Wertpapiere aus vergangenen Geschäftsjahren resultiert.

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

#### Wertpapierleihe

#### EUR

<b>Verwendete Vermögensgegenstände</b>	absolut	4.171.258,91
	in % des Fondsvermögens	7,16

### 10 größte Gegenparteien

Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	4.171.258,91
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	4.171.258,91

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 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](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)	4.413.454,95
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	4.075,09
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.

7,18

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Bankia S.A.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	417.689,16
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	207.938,11
3. Name	Agence Française de Développement
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	201.524,51
4. Name	FMS Wertmanagement
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	177.147,26
5. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	173.187,69
6. Name	Landesbank Baden-Württemberg
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	153.247,63
7. Name	Investitionsbank Berlin
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	143.636,12
8. Name	Siemens AG
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	96.488,91
9. Name	NRW.BANK
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	95.981,63
10. Name	HSBC France S.A.
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	95.893,99

## 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	1.204.558,60

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Value 20 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 Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

Thomas Schneider  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A., Luxemburg;  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;  
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](http://www.deka-etf.de)