

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2022.

**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 2022

## 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 2022 bis zum 31. Juli 2022.

Beherrscht 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](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 2022	8
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2022	9
Anhang	11
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

**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>	-12,3%	-17,6%	3,1%

**ISIN** 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 (%)		
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3	8,02
FR0013506730	Vallourec S.A. Actions Port. EO 0,02	7,33
NO0010081235	NEL ASA Navne-Aksjer NK -,20	7,06
CH0319416936	Flughafen Zürich AG Namens-Aktien SF 10	7,03
GB00BN0SMB92	Capricorn Energy PLC Registered Shs LS-,016153846	7,01
SE0007640156	Scandic Hotels Group AB Namn-Aktier EO -,25	6,79
GB00BGBN7C04	SSP Group PLC Registered Shares LS -,01085	5,86
BE0003818359	Galapagos N.V. Actions Nom. o.N.	5,79
PLJSW0000015	Jastrzebska Spolka Weglowa S.A Inhaber-Aktien ZY 5	5,48
FR0000120404	ACCOR S.A. Actions Port. EO 3	5,17
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG Inhaber-Aktien o.N.	4,88
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC Registered Shares LS 0.20	4,80
FR0000077919	JCDecaux S.A. Actions au Porteur o.N.	3,86
IT0003007728	Tods S.p.A. Azioni nom. EO 2	3,85
FR0010557264	AB Science S.A. Actions au Port. EO -,01	3,68
PLMBION00016	Mabion SA Inhaber-Aktien ZY -,10	3,24
GB00B0YG1K06	Restaurant Group PLC, The Registered Shares LS -,28125	3,23
FR0011950732	Elior Group SA Actions au Port. EO -,01	3,18
AT0000A18XM4	ams-OSRAM AG Inhaber-Aktien o.N.	2,94
LU2010095458	Global Fashion Group S.A. Bearer Shares EO -,01	0,78

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

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>37.301.671,05</b>	<b>100,05</b>
1. Aktien		37.489.792,93	100,55
- Aeronautik und Weltraum	1.800.340,12		4,83
- Bau und Baustoffe	7.471.597,73		20,04
- Bergbau	2.053.196,67		5,51
- Einzelhandel	1.212.335,77		3,25
- Elektrik / Elektronik	1.101.093,05		2,95
- Energieversorger	5.274.029,64		14,15
- Freizeit/Tourismus	4.484.452,37		12,03
- Pharmaindustrie / Biotech	4.767.522,51		12,79
- Sonstige industrielle Werte	2.748.000,78		7,37
- Telekommunikation	293.979,03		0,79
- Textilien und Kleidung	1.444.972,68		3,88
- Unterhaltungsindustrie	1.447.270,11		3,88
- Verbrauchsgüter	3.391.002,47		9,10
2. Forderungen		32.095,42	0,09
3. Bankguthaben		-220.217,30	-0,59
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-18.447,05</b>	<b>-0,05</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>37.283.224,00</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 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									
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG <sup>2)</sup>	STK		41.146	0	7.949	EUR 44,490	1.830.585,54	4,88
							EUR	1.830.585,54	4,88
Ausland									
FR0010557264	AB Science S.A.	STK		184.758	0	35.695	EUR 7,475	1.381.066,05	3,68
FR0000120404	ACCOR S.A.	STK		76.732	0	14.825	EUR 25,280	1.939.784,96	5,17
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.	STK		22.334	0	4.314	EUR 134,600	3.006.156,40	8,01
AT0000A18XM4	ams AG	STK		137.058	0	26.479	CHF 7,802	1.101.093,05	2,94
GB00BNOSMB92	Capricorn Energy PLC	STK		1.001.414	0	193.469	GBP 2,198	2.626.933,97	7,00
FR0011950732	Elior Group SCA	STK		376.847	0	72.805	EUR 3,164	1.192.343,91	3,18
CH0319416936	Flughafen Zürich AG	STK		16.226	0	3.135	CHF 157,700	2.634.855,79	7,02
BE0003818359	Galapagos N.V. <sup>2)</sup>	STK		43.813	0	8.465	EUR 49,580	2.172.248,54	5,79
LU2010095458	Global Fashion Group S.A. <sup>2)</sup>	STK		203.305	0	39.278	EUR 1,446	293.979,03	0,78
PLJSW0000015	Jastrzebska Spolka Weglowa S.A.	STK		192.533	0	37.197	PLN 50,420	2.053.196,67	5,47
FR0000077919	JCDecaux S.A.	STK		92.007	0	17.775	EUR 15,730	1.447.270,11	3,86
PLMBION00016	Mabion SA	STK		168.896	0	32.630	PLN 33,990	1.214.207,92	3,24
NO0010081235	NEL ASA - Anrechte	STK		1.578.569	0	304.973	NOK 16,530	2.647.095,67	7,06
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC <sup>2)</sup>	STK		1.689.823	0	326.466	GBP 0,893	1.800.340,12	4,80
SE0007640156	Scandic Hotels Group AB	STK		638.655	0	123.386	SEK 41,420	2.544.667,41	6,78
GB00BGBN7C04	SSP Group PLC	STK		724.442	0	139.959	GBP 2,543	2.198.658,56	5,86
GB00BOYGY1K06	The Restaurant Group PLC	STK		2.005.560	0	387.465	GBP 0,507	1.212.335,77	3,23
IT0003007728	Tod's S.p.A.	STK		41.859	0	8.087	EUR 34,520	1.444.972,68	3,85
FR0013506730	Vallourec S.A.	STK		305.130	0	58.949	EUR 9,006	2.748.000,78	7,33
							EUR	35.659.207,39	95,07
							EUR	37.489.792,93	99,95
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	3.694,85	0,01
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			PLN	12.041,43			% 100,000	2.546,83	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			GBP	961,93			% 100,000	1.148,02	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände									
Forderungen aus Quellensteuerrückstattung			EUR	31.590,18			EUR	32.095,42	0,09
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	505,24			EUR	31.590,18	0,08
							EUR	505,24	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
EUR-Kredite bei:									
Verwahrstelle			EUR	-218.251,51			% 100,000	-218.251,51	-0,58
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			CHF	-1.643,15			% 100,000	-1.691,96	-0,00
Verwahrstelle			NOK	-17.816,35			% 100,000	-1.807,39	-0,00
Verwahrstelle			SEK	-22.467,70			% 100,000	-2.161,29	-0,01
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-18.447,05			EUR	-18.447,05	-0,05
Fondsvermögen									
Anteilwert							EUR	37.507.136,15	100,00 <sup>1)</sup>
Umlaufende Anteile							EUR	20,58	
							STK	1.811.636,00	

<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		gesamt
			Kurswert in EUR befristet	Kurswert in EUR unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen					
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:					
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG	STK	41.146	1.830.585,54	
BE0003818359	Galapagos N.V.	STK	8.000	396.640,00	
LU2010095458	Global Fashion Group S.A.	STK	138.978	200.962,19	
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC	STK	17.554	18.702,06	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				2.446.889,79	<b>2.446.889,79</b>

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

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurse per 29.07.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)		29.07.2022	
Britisches Pfund	(GBP)	0,83790	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	9,85750	= 1 Euro (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,72800	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	10,39550	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,97115	= 1 Euro (EUR)

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
ISIN					
	<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>				
	unbefristet	EUR			14.190

(Basiswerte: ACCOR S.A. (FR0000120404); Aéroports de Paris S.A. (FR0010340141); Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG (DE0005773303); Galapagos N.V. (BE0003818359); Global Fashion Group S.A. (LU2010095458); Rolls Royce Holdings PLC (GB00B63H8491))

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

## Anhang.

### Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 2.446.889,79

### 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		2.412.556,21

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	EUR	2.047,20
--	-----	----------

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 2.047,20. 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	20,58
Umlaufende Anteile	STK	1.811.636,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 99,95

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
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert) 0,12

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

Verwendete Vermögensgegenstände	absolut	2.446.889,79
	in % des Fondsvermögens	6,52

### 10 größte Gegenparteien

Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	2.446.889,79
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	2.446.889,79

### 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>.

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

## Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

## Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	2.412.556,21
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	0,00

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

## Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	2.047,20
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

6,53

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	Spanien, Königreich
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	518.689,61
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	474.547,43
3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	111.906,97
4. Name	Portugal, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	106.325,09
5. Name	ENI S.p.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	103.691,50
6. Name	Spanien, Königreich
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	92.544,00
7. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	87.520,17
8. Name	Europäische Union
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	66.011,34
9. Name	Royal Bank of Canada
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	61.675,53
10. Name	Deutschland, Bundesrepublik
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	61.324,84

## 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	2.412.556,21

## 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

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

---

Frankfurt am Main, den 1. August 2022  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 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 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 2022

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



**Deka Investment GmbH**

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

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
[www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de)

