

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2026.

**Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong  
Style Composite 40 UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der STOXX® Europe Strong Style Composite 40 Index ist das geistige Eigentum (inklusive registrierter Marken) der ISS STOXX Index GmbH ("ISS STOXX") oder der STOXX Ltd., Zug, Schweiz ("STOXX") oder deren Lizenzgeber und wird unter einer Lizenz verwendet. Deka STOXX® Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF ist weder gefördert noch beworben, vertrieben oder in irgendeiner anderen Weise von ISS STOXX, STOXX, der Gruppe Deutsche Börse oder von deren Lizenzgebern, Forschungspartnern oder Datenlieferanten unterstützt und ISS STOXX, 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 Style Composite 40 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 2026

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka STOXX® Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. Februar 2026 bis zum 31. Juli 2026.

Die Kapitalmärkte durchliefen im Berichtszeitraum eine volatile Phase, welche insbesondere ab Ende Februar durch den Iran-USA-Krieg geprägt wurde. Vor allem die Auswirkungen auf wichtige Handelsrouten, Rohstoffversorgungen und die Inflation waren hierbei von Bedeutung. Mit der Zeit überwog jedoch die Hoffnung auf ein Abklingen der Kampfhandlungen und auf vorsichtige Schritte hin zu einer diplomatischen Lösung. Insgesamt befand sich die weltwirtschaftliche Entwicklung auf einem robusten Pfad, wobei die Konjunkturdynamik in den USA, angetrieben durch das Megathema Künstliche Intelligenz (KI), deutlich stärker als in Europa ausgeprägt war.

Hinsichtlich der Geldpolitik von Europäischer Zentralbank (EZB) und US-Notenbank (Fed) veränderte sich im Laufe des Berichtszeitraums die Sicht der Anleger auf die weitere Entwicklung. So erhöhte die EZB angesichts des anhaltenden Inflationsdrucks im Juni den Leitzins zum ersten Mal seit September 2023 um 25 Basispunkte, was sich auch an den Rentenmärkten in Form steigender Zinserwartungen widerspiegelte. Die US-Notenbank Fed hingegen beließ die Fed Funds Target Range während des Berichtszeitraums unverändert bei 3,50 bis 3,75 Prozent. US-Treasuries mit einer Laufzeit von 10 Jahren rentierten zuletzt mit 4,7 Prozent, während vergleichbare Staatsanleihen aus dem Euroraum zum Stichtag eine Verzinsung von 3,2 Prozent aufwiesen.

Zahlreiche Aktienindizes tendierten zu Beginn des Berichtszeitraums freundlich. Mit Kriegsbeginn gerieten die Kurse im März jedoch unter deutlichen Abgabedruck, von dem sich die meisten Börsen bis zum Stichtag aber wieder erholen konnten und teilweise neue Allzeithochs erklommen. Dies wurde vor allem durch starke Quartalsberichte, insbesondere aus dem Technologiesektor, gestützt. Der Goldpreis setzte zunächst noch seinen historischen Höhenflug fort, die Notierungen sanken dann aber wieder in den Bereich von 4.000 US-Dollar je Feinunze. Stark im Fokus stand im Berichtszeitraum der Ölpreis, welcher im Zuge des Iran-USA-Konflikts zeitweise bis auf 118 US-Dollar je Barrel (Brent Future) emporschnellte. Im weiteren Verlauf ging der Preis wieder etwas zurück, doch bewegte er sich weiterhin deutlich über dem Ausgangswert und blieb stark von der jeweiligen Nachrichtenlage abhängig. Am Devisenmarkt tendierte der Euro gegenüber dem US-Dollar per saldo etwas schwächer und notierte zum Stichtag bei 1,15 US-Dollar.

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



Denis Friess



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

|                                             |    |
|---------------------------------------------|----|
| Anlagepolitik                               | 5  |
| Vermögensübersicht zum 31. Juli 2026        | 7  |
| Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2026      | 8  |
| Anhang                                      | 11 |
| Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe | 12 |

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF ist ein passiv gemanagter börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF). Ziel des Fondsmanagements ist die exakte Abbildung der Wertentwicklung des STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 (Preisindex) und damit einen langfristigen Kapitalzuwachs durch die Teilhabe an den Kurssteigerungen und Dividendenzahlungen der im Index enthaltenen Aktien zu erwirtschaften. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Der Index wird mit den jeweiligen im Index befindlichen Wertpapieren abgebildet (physische Replikation). Es wird versucht die Wertentwicklung des Index so genau wie möglich abzubilden. Hierzu investiert der Fonds in 40 Aktien europäischer Unternehmen, die nach fundamentalen Kennzahlen analysiert und als besonders werthaltig bzw. wachstumsstark ermittelt werden.

Der Fonds kann dennoch von diesem Index abweichen (positiv oder negativ). Angaben zum prognostizierten Tracking Error sind im Verkaufsprospekt und unter [www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de) zu finden.

Es können Derivate zu Investitionszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

| Performance* | 6 Monate     |
|--------------|--------------|
|              | -2,7%        |
| ISIN         | DE000ETFLO52 |

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

# Deka STOXX® Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) |                                                            |      |
|-------------------------------|------------------------------------------------------------|------|
| CH0311864901                  | VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10                         | 5,06 |
| NL0010273215                  | ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09                 | 4,53 |
| DE000BAY0017                  | Bayer AG Namens-Aktien o.N.                                | 4,38 |
| NL0012866412                  | BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01         | 4,32 |
| DE000ENER6Y0                  | Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N.                       | 3,67 |
| DE0006969603                  | PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.                                | 3,51 |
| DE000KSAG888                  | K+S Aktiengesellschaft Namens-Aktien o.N.                  | 3,30 |
| GB0003718474                  | Games Workshop Group PLC Registered Shares LS -,05         | 3,21 |
| SE0020050417                  | Boliden AB Namn-Aktier o.N.                                | 3,17 |
| DK0060094928                  | Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10                          | 3,12 |
| SE0000379190                  | Castellum AB Namn-Aktier o.N.                              | 2,92 |
| DE0008232125                  | Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N.              | 2,72 |
| FR0013326246                  | Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05         | 2,69 |
| SE0021921269                  | Saab AB Namn-Aktier B o.N.                                 | 2,58 |
| NO0013536151                  | Kongsberg Gruppen AS Navne-Aksjer NK 0,19                  | 2,55 |
| GB00B1VNSX38                  | Drax Group PLC Registered Shares LS -,1155172              | 2,54 |
| ES0177542018                  | Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom. EO -,10       | 2,49 |
| SE0014781795                  | Addtech AB Namn-Aktier B SK -,1875                         | 2,47 |
| PLOTTTC00011                  | CD Projekt S.A. Inhaber-Aktien C ZY 1                      | 2,35 |
| GB00B033F229                  | Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395                    | 2,29 |
| FR001400J770                  | Air France-KLM S.A. Actions Port. EO 1                     | 2,28 |
| CH1101098163                  | BELIMO Holding AG Namens-Aktien SF -,05                    | 2,27 |
| GB00BP0RGD03                  | Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,056110 | 2,25 |
| GB00BM8Q5M07                  | JD Sports Fashion PLC Registered Shares LS -,0005          | 2,19 |
| SE0012853455                  | EQT AB Namn-Aktier o.N.                                    | 2,17 |
| NL0012044747                  | Redcare Pharmacy N.V. Aandelen aan toonder EO -,02         | 2,08 |
| DE000HAG0005                  | HENSOLDT AG Inhaber-Aktien o.N.                            | 2,07 |
| IT0004764699                  | Brunello Cucinelli S.P.A. Azioni nom. o. N.                | 2,05 |
| NL0011585146                  | Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01                      | 1,87 |
| DE000LEG1110                  | LEG Immobilien SE Namens-Aktien o.N.                       | 1,76 |
| DK0015998017                  | Bavarian Nordic Navne-Aktier DK 10                         | 1,73 |
| NL0010391025                  | Pharming Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,01           | 1,71 |
| DK0060257814                  | Zealand Pharma A/S Navne-Aktier DK 1                       | 1,71 |
| FR0000052292                  | Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.        | 1,68 |
| DE000RENNK730                 | RENNK Group AG Inhaber-Aktien o.N.                         | 1,57 |
| NL0012969182                  | Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01                         | 1,51 |
| DE0007030009                  | Rheinmetall AG Inhaber-Aktien o.N.                         | 1,47 |
| CH0024608827                  | Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01            | 1,34 |
| DE0006452907                  | Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N.                          | 1,29 |
| FR00140182K6                  | Worldline S.A. Actions Port. EO -,80                       | 1,13 |

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2026.

|                                | Kurswert<br>in EUR | Kurswert<br>in EUR   | % des Fonds-<br>vermögens <sup>1)</sup> |
|--------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b> |                    | <b>39.284.577,57</b> | <b>100,06</b>                           |
| 1. Aktien                      |                    | 39.034.955,41        | 99,42                                   |
| - Aeronautik und Weltraum      | 3.996.423,31       |                      | 10,18                                   |
| - Banken                       | 1.371.197,11       |                      | 3,49                                    |
| - Bau und Baustoffe            | 1.761.492,02       |                      | 4,49                                    |
| - Bergbau                      | 1.235.759,61       |                      | 3,15                                    |
| - Chemische Industrie          | 1.287.031,20       |                      | 3,28                                    |
| - Einzelhandel                 | 4.685.825,21       |                      | 11,93                                   |
| - Elektrik / Elektronik        | 3.455.079,60       |                      | 8,80                                    |
| - Energieversorger             | 3.103.220,83       |                      | 7,90                                    |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 2.165.749,20       |                      | 5,52                                    |
| - Pharmaindustrie / Biotech    | 3.719.791,44       |                      | 9,47                                    |
| - Real Estate                  | 2.877.298,75       |                      | 7,33                                    |
| - Software                     | 1.417.600,85       |                      | 3,61                                    |
| - Sonstige Dienstleistungen    | 1.031.822,44       |                      | 2,63                                    |
| - Sonstige industrielle Werte  | 1.977.025,30       |                      | 5,04                                    |
| - Textilien und Kleidung       | 2.028.053,50       |                      | 5,17                                    |
| - Transportation               | 2.921.585,04       |                      | 7,44                                    |
| 2. Forderungen                 |                    | 51.554,75            | 0,13                                    |
| 3. Bankguthaben                |                    | 198.067,41           | 0,50                                    |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>   |                    | <b>-22.294,56</b>    | <b>-0,06</b>                            |
| <b>III. Fondsvermögen</b>      |                    | <b>39.262.283,01</b> | <b>100,00</b>                           |

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

# Deka STOXX® Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2026.

| ISIN                                                                  | Gattungsbezeichnung            | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in<br>1.000 | Bestand<br>31.07.2026 | Käufe/<br>Zugänge<br>Im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs          | Kurswert<br>in EUR | % des<br>Fondsver-<br>mögens |
|-----------------------------------------------------------------------|--------------------------------|-------|------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|---------------|--------------------|------------------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere                                          |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| Aktien                                                                |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| Inland                                                                |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| DE000BAY0017                                                          | Bayer AG                       | STK   |                                                | 35.573                | 0                                        | 1.260                | EUR 48,050    | 1.709.282,65       | 4,35                         |
| DE0008232125                                                          | Deutsche Lufthansa AG          | STK   |                                                | 117.401               | 0                                        | 4.157                | EUR 9,036     | 1.060.835,44       | 2,70                         |
| DE000HAG0005                                                          | HENSOLDT AG                    | STK   |                                                | 10.122                | 0                                        | 358                  | EUR 79,760    | 807.330,72         | 2,06                         |
| DE000KSAG888                                                          | K+S Aktiengesellschaft         | STK   |                                                | 88.395                | 0                                        | 3.131                | EUR 14,560    | 1.287.031,20       | 3,28                         |
| DE000LEG1110                                                          | LEG Immobilien SE              | STK   |                                                | 13.211                | 781                                      | 1.249                | EUR 52,050    | 687.632,55         | 1,75                         |
| DE0006452907                                                          | Nemetschek SE                  | STK   |                                                | 8.650                 | 0                                        | 306                  | EUR 58,050    | 502.132,50         | 1,28                         |
| DE0006969603                                                          | PUMA SE                        | STK   |                                                | 49.856                | 0                                        | 1.766                | EUR 27,500    | 1.371.040,00       | 3,49                         |
| DE000RENK730                                                          | RENK Group AG                  | STK   |                                                | 12.779                | 0                                        | 452                  | EUR 47,850    | 611.475,15         | 1,56                         |
| DE0007030009                                                          | Rheinmetall AG                 | STK   |                                                | 504                   | 0                                        | 17                   | EUR 1.140,000 | 574.560,00         | 1,46                         |
| DE000ENER6Y0                                                          | Siemens Energy AG              | STK   |                                                | 9.725                 | 0                                        | 345                  | EUR 147,440   | 1.433.854,00       | 3,65                         |
|                                                                       |                                |       |                                                |                       |                                          |                      | EUR           | 10.045.174,21      | 25,58                        |
| Ausland                                                               |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| SE0014781795                                                          | Addtech AB                     | STK   |                                                | 30.549                | 0                                        | 1.082                | SEK 346,600   | 964.653,99         | 2,46                         |
| NL0012969182                                                          | Adyen N.V.                     | STK   |                                                | 673                   | 0                                        | 24                   | EUR 876,900   | 590.153,70         | 1,50                         |
| FR001400J770                                                          | Air France-KLM S.A.            | STK   |                                                | 74.027                | 0                                        | 2.622                | EUR 12,010    | 889.064,27         | 2,26                         |
| NL0010273215                                                          | ASML Holding N.V.              | STK   |                                                | 1.233                 | 0                                        | 44                   | EUR 1.434,200 | 1.768.368,60       | 4,50                         |
| DK0015998017                                                          | Bavarian Nordic                | STK   |                                                | 28.296                | 0                                        | 1.002                | DKK 177,900   | 673.443,89         | 1,72                         |
| NL0012866412                                                          | BE Semiconductor Inds N.V.     | STK   |                                                | 8.508                 | 0                                        | 301                  | EUR 198,250   | 1.686.711,00       | 4,30                         |
| CH1101098163                                                          | BELIMO Holding AG              | STK   |                                                | 980                   | 0                                        | 35                   | CHF 840,000   | 884.353,01         | 2,25                         |
| GB00BP0RGD03                                                          | Berkeley Group Holdings PLC    | STK   |                                                | 21.426                | 0                                        | 758                  | GBP 35,000    | 877.139,01         | 2,23                         |
| SE0020050417                                                          | Boliden AB                     | STK   |                                                | 28.448                | 0                                        | 1.008                | SEK 476,800   | 1.235.759,61       | 3,15                         |
| IT0004764699                                                          | Brunello Cucinelli S.P.A.      | STK   |                                                | 9.117                 | 0                                        | 323                  | EUR 87,920    | 801.566,64         | 2,04                         |
| SE0000379190                                                          | Castellum AB                   | STK   |                                                | 93.384                | 0                                        | 3.307                | SEK 133,850   | 1.138.772,20       | 2,90                         |
| PLOPTTC00011                                                          | CD Projekt S.A.                | STK   |                                                | 15.778                | 0                                        | 559                  | PLN 249,900   | 915.468,35         | 2,33                         |
| GB00B033F229                                                          | Centrica PLC                   | STK   |                                                | 493.301               | 0                                        | 17.469               | GBP 1,550     | 894.340,66         | 2,28                         |
| GB00B1VNSX38                                                          | Drax Group PLC                 | STK   |                                                | 114.725               | 0                                        | 4.063                | GBP 7,375     | 989.644,87         | 2,52                         |
| SE0012853455                                                          | EQT AB                         | STK   |                                                | 28.699                | 0                                        | 1.016                | SEK 323,700   | 846.360,67         | 2,16                         |
| NL0011585146                                                          | Ferrari N.V.                   | STK   |                                                | 2.152                 | 0                                        | 76                   | EUR 340,100   | 731.895,20         | 1,86                         |
| GB0003718474                                                          | Games Workshop Group PLC       | STK   |                                                | 5.597                 | 0                                        | 199                  | GBP 191,200   | 1.251.706,42       | 3,19                         |
| FR0000052292                                                          | Hermes International S.C.A.    | STK   |                                                | 429                   | 0                                        | 15                   | EUR 1.531,500 | 657.013,50         | 1,67                         |
| ES0177542018                                                          | Internat. Cons. Airl. Group SA | STK   |                                                | 192.346               | 0                                        | 6.812                | GBP 4,319     | 971.685,33         | 2,47                         |
| GB00BM8Q5M07                                                          | JD Sports Fashion PLC          | STK   |                                                | 817.245               | 0                                        | 28.941               | GBP 0,895     | 855.146,36         | 2,18                         |
| NO0013536151                                                          | Kongsberg Gruppen AS           | STK   |                                                | 36.720                | 0                                        | 1.301                | NOK 296,200   | 996.738,83         | 2,54                         |
| DK00060094928                                                         | Orsted A/S                     | STK   |                                                | 62.852                | 0                                        | 2.225                | DKK 145,000   | 1.219.235,30       | 3,11                         |
| CH0024608827                                                          | Partners Group Holding AG      | STK   |                                                | 727                   | 0                                        | 26                   | CHF 672,000   | 524.836,44         | 1,34                         |
| NL0010391025                                                          | Pharming Group N.V.            | STK   |                                                | 761.669               | 0                                        | 26.972               | EUR 0,878     | 668.897,72         | 1,70                         |
| NL0012044747                                                          | Redcare Pharmacy N.V.          | STK   |                                                | 13.237                | 0                                        | 468                  | EUR 61,400    | 812.751,80         | 2,07                         |
| SE0021921269                                                          | Saab AB                        | STK   |                                                | 18.474                | 0                                        | 654                  | SEK 597,900   | 1.006.318,61       | 2,56                         |
| FR0013326246                                                          | Unibail-Rodamco-Westfield SE   | STK   |                                                | 9.980                 | 0                                        | 354                  | EUR 105,300   | 1.050.894,00       | 2,68                         |
| CH0311864901                                                          | VAT Group AG                   | STK   |                                                | 3.057                 | 0                                        | 108                  | CHF 602,000   | 1.977.025,30       | 5,04                         |
| FR00140182K6                                                          | Worldline S.A.                 | STK   |                                                | 36.238                | 36.238                                   | 0                    | EUR 12,188    | 441.668,74         | 1,12                         |
| DK0060257814                                                          | Zealand Pharma A/S             | STK   |                                                | 16.429                | 0                                        | 581                  | DKK 304,000   | 668.167,18         | 1,70                         |
|                                                                       |                                |       |                                                |                       |                                          |                      | EUR           | 28.989.781,20      | 73,84                        |
|                                                                       |                                |       |                                                |                       |                                          |                      | EUR           | 39.034.955,41      | 99,42                        |
| Summe Wertpapiervermögen                                              |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds |                                |       |                                                |                       |                                          |                      | EUR           | 198.067,41         | 0,50                         |
| EUR-Guthaben bei:                                                     |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                        |                                | EUR   |                                                | 180.035,40            |                                          |                      | % 100,000     | 180.035,40         | 0,46                         |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen                                |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                        |                                | DKK   |                                                | 63.136,90             |                                          |                      | % 100,000     | 8.446,63           | 0,02                         |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                        |                                | PLN   |                                                | 16.368,34             |                                          |                      | % 100,000     | 3.800,40           | 0,01                         |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                        |                                | SEK   |                                                | 294,27                |                                          |                      | % 100,000     | 26,81              | 0,00                         |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen                                    |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                        |                                | GBP   |                                                | 13.323,38             |                                          |                      | % 100,000     | 15.583,81          | 0,04                         |
| Sonstige Vermögensgegenstände                                         |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| Dividendenansprüche                                                   |                                | EUR   |                                                | 27.043,25             |                                          |                      | EUR           | 51.554,75          | 0,13                         |
| Quellensteuererstattungsansprüche                                     |                                | EUR   |                                                | 24.131,42             |                                          |                      |               | 27.043,25          | 0,07                         |
| Zinsansprüche                                                         |                                | EUR   |                                                | 380,08                |                                          |                      |               | 24.131,42          | 0,06                         |
|                                                                       |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               | 380,08             | 0,00                         |
| Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme                                  |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen                                 |                                |       |                                                |                       |                                          |                      | EUR           | -9.825,64          | -0,03                        |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                        |                                | NOK   |                                                | -107.212,62           |                                          |                      | % 100,000     | -9.825,16          | -0,03                        |
| Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen                                     |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| DekaBank Deutsche Girozentrale                                        |                                | CHF   |                                                | -0,45                 |                                          |                      | % 100,000     | -0,48              | -0,00                        |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                            |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung                                |                                | EUR   |                                                | -22.226,88            |                                          |                      | EUR           | -22.294,56         | -0,06                        |
| Zinsverbindlichkeiten                                                 |                                | EUR   |                                                | -67,68                |                                          |                      |               | -22.226,88         | -0,06                        |
|                                                                       |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               | -67,68             | -0,00                        |
| Fondsvermögen                                                         |                                |       |                                                |                       |                                          |                      |               |                    |                              |
| Anteilwert                                                            |                                |       |                                                |                       |                                          |                      | EUR           | 39.262.283,01      | 100,00 <sup>1)</sup>         |
|                                                                       |                                |       |                                                |                       |                                          |                      | EUR           | 43,43              |                              |

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

| ISIN               | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.07.2026 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--------------------|---------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|---------------------------------------|------|-----------------|----------------------|
| Umlaufende Anteile |                     |       |                                       |                    |                                    |                                       | STK  | 903.962,00      |                      |

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

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
Alle Vermögenswerte Kurse per 31.07.2026

|                               |       |                         |
|-------------------------------|-------|-------------------------|
| Devisenkurse (in Mengennotiz) |       | 31.07.2026              |
| Britisches Pfund              | (GBP) | 0,85495 = 1 Euro (EUR)  |
| Dänische Krone                | (DKK) | 7,47480 = 1 Euro (EUR)  |
| Norwegische Krone             | (NOK) | 10,91205 = 1 Euro (EUR) |
| Polnischer Zloty              | (PLN) | 4,30700 = 1 Euro (EUR)  |
| Schwedische Krone             | (SEK) | 10,97625 = 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken             | (CHF) | 0,93085 = 1 Euro (EUR)  |

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:**  
**- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):**

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung          | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-------------------------------------|------------------------------|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| <b>ISIN</b>                         |                              |                                       |                |                   |                  |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |                              |                                       |                |                   |                  |
| <b>Aktien</b>                       |                              |                                       |                |                   |                  |
| <b>Inland</b>                       |                              |                                       |                |                   |                  |
| DE000LEG1300                        | LEG Immobilien SE - Anrechte | STK                                   | 13.211         | 13.211            |                  |
| <b>Ausland</b>                      |                              |                                       |                |                   |                  |
| FR0011981968                        | Worldline S.A.               | STK                                   | 1.751.175      | 2.138.887         |                  |
| FR0014015MS9                        | Worldline S.A. - Anrechte    | STK                                   | 379.496        | 129.351           |                  |
| NO0013697029                        | Kongsberg Maritime A.S.A     | STK                                   | 36.720         | 36.720            |                  |

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich für den Zeitraum vom 01.02.2026 bis zum 31.07.2026

|                                                                  | insgesamt<br>EUR | insgesamt<br>EUR     | je Anteil<br>EUR |
|------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|------------------|
| <b>I. Erträge</b>                                                |                  |                      |                  |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)   |                  | 74.740,83            | 0,083            |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)       |                  | 251.532,74           | 0,278            |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland                       |                  | 1.576,96             | 0,002            |
| 4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer                         |                  | -11.211,12           | -0,012           |
| 5. Abzug ausländischer Quellensteuer                             |                  | -27.994,40           | -0,031           |
| 6. Sonstige Erträge                                              |                  | 0,08                 | 0,000            |
| davon: Sonstiges                                                 | 0,08             |                      | 0,000            |
| <b>Summe der Erträge</b>                                         |                  | <b>288.645,09</b>    | <b>0,319</b>     |
| <b>II. Aufwendungen</b>                                          |                  |                      |                  |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme                                     |                  | -249,40              | 0,000            |
| 2. Verwaltungsvergütung                                          |                  | -129.102,68          | -0,143           |
| 3. Sonstige Aufwendungen                                         |                  | -749,58              | -0,001           |
| davon: Bankgebühren                                              | -144,45          |                      | 0,000            |
| davon: Genehmigungskosten BaFin                                  | -514,00          |                      | -0,001           |
| davon: Sonstiges                                                 | -91,13           |                      | 0,000            |
| <b>Summe der Aufwendungen</b>                                    |                  | <b>-130.101,66</b>   | <b>-0,144</b>    |
| III. Ordentlicher Nettoertrag                                    |                  | 158.543,43           | 0,175            |
| <b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>                                 |                  |                      |                  |
| 1. Realisierte Gewinne                                           |                  | 357.252,55           | 0,395            |
| 2. Realisierte Verluste                                          |                  | -594.052,63          | -0,657           |
| <b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>                       |                  | <b>-236.800,08</b>   | <b>-0,262</b>    |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres                     |                  | -78.256,65           | -0,087           |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne               |                  | 238.729,07           | 0,264            |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste              |                  | -1.358.947,46        | -1,503           |
| <b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>       |                  | <b>-1.120.218,39</b> | <b>-1,239</b>    |
| <b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>                         |                  | <b>-1.198.475,04</b> | <b>-1,326</b>    |
| <b>Entwicklung des Sondervermögens</b>                           |                  | <b>2026 / 2027</b>   |                  |
|                                                                  | EUR              | EUR                  |                  |
| <b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b> |                  | <b>42.018.421,50</b> |                  |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr                   |                  | 0,00                 |                  |
| 2. Zwischenausschüttungen                                        |                  | -225.990,50          |                  |
| 3. Mittelzufluss (netto)                                         |                  | -1.315.998,21        |                  |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen                     | 0,00             |                      |                  |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen                    | -1.315.998,21    |                      |                  |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich                            |                  | -15.674,74           |                  |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres                                  |                  | -1.198.475,04        |                  |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne            | 238.729,07       |                      |                  |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste           | -1.358.947,46    |                      |                  |
| <b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>  |                  | <b>39.262.283,01</b> |                  |

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

# Deka STOXX<sup>®</sup> Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

## Anhang.

### Angaben nach der Derivateverordnung

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

#### Sonstige Angaben

|                    |     |            |
|--------------------|-----|------------|
| Anteilwert         | EUR | 43,43      |
| Umlaufende Anteile | STK | 903.962,00 |

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,42

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 31.07.2026 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 31.07.2026 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)

0,30

#### 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.

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

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

---

Frankfurt am Main, den 3. August 2026  
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 2025

|                                        |                |
|----------------------------------------|----------------|
| gezeichnetes und eingezahltes Kapital: | EUR 10,2 Mio.  |
| Eigenmittel:                           | EUR 112,8 Mio. |

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Große Gallusstraße 14  
60315 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzende

Birgit Dietl-Benzin  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Vorsitzende des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

### Stellvertretende Vorsitzende

Marion Spielmann  
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der  
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,  
Wiesbaden;  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Mitglied des Verwaltungsrates der  
Deka Verwaltungsgesellschaft Luxembourg S.A., Luxemburg

### Mitglieder

Andreas Lau, Frankfurt am Main

Prof. Dr. Thorsten Neumann  
Lehrstuhl für Volkswirtschaftslehre, Statistik und Asset  
Management der Hochschule Neu-Ulm, Kronberg

Andreas Thomae, Frankfurt am Main

Dr. Bernd Türk, Frankfurt am Main

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Denis Friess

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Große Gallusstraße 14  
60315 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 2026

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)

