

Halbjahresbericht  
zum 31. Juli 2021.

**Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select  
Dividend 30 UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der EURO STOXX® Select Dividend 30 Index ist das geistige Eigentum (inklusive registrierte Marken) der STOXX Ltd., Zug, Schweiz ("STOXX"), der Gruppe Deutsche Börse oder deren Lizenzgeber und wird unter einer Lizenz verwendet. Deka EURO STOXX® Select Dividend 30 UCITS ETF ist weder gefördert noch beworben, vertrieben oder in irgendeiner anderen Weise von STOXX, der Gruppe Deutsche Börse oder von deren Lizenzgebern, Forschungspartnern oder Datenlieferanten unterstützt und STOXX, die Gruppe Deutsche Börse und deren Lizenzgeber, Forschungspartner oder Datenlieferanten übernehmen keinerlei Gewährleistung und schliessen jegliche Haftung (aus fahrlässigem sowie aus anderem Verhalten) diesbezüglich generell aus und im speziellen in Bezug auf jegliche Fehler, Unterlassungen oder Störungen des EURO STOXX® Select Dividend 30 Index oder der darin enthaltenen Daten. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

# Bericht der Geschäftsführung.

31. Juli 2021

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

Der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka EURO STOXX® Select Dividend 30 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 EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 Index nachzubilden. Dieser Index umfasst die 30 Unternehmen des EURO STOXX<sup>®</sup> mit der höchsten Dividendenrendite. Die Bestandteile des Index werden der Nettodividende entsprechend gewichtet. Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrunde liegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt.

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

Zusatzerträge können durch Wertpapierdarlehensgeschäfte erzielt werden.

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren im Wesentlichen aus Transaktionen mit Aktien aufgrund von Indexanpassungen und Rücknahme von Anteilscheinen.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	19,6%	40,0%	1,4%

**ISIN** DE000ETFLO78

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

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	DE000BASF111	BASF SE Namens-Aktien o.N.
Löschung	FR0000121964	Klépierre S.A. Actions Port. EO 1,40
Löschung	FI4000440664	Neles Corp. Registered Shares o.N.
Löschung	FR0000120271	Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50
Neuaufnahme	BE0974264930	AGEAS SA/NV Actions Nominatives o.N.
Neuaufnahme	AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien o.N.
Neuaufnahme	IT0003796171	Poste Italiane S.p.A. Azioni nom. EO -,51
Neuaufnahme	FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. EO 2

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	5,07
BE0003810273	Proximus S.A. Actions au Porteur o.N.	4,93
FR0000133308	Orange S.A. Actions Port. EO 4	4,67
FR0000120628	AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	4,57
IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom. o.N.	4,57
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A. Azioni nom. EO -,51	3,94
FR0000064578	Covivio S.A. Actions Port. EO 3	3,86
FI0009000202	Kesko Oyj Registered Shares Cl. B o.N.	3,79
DE0008303504	TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien o.N.	3,76
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	3,74
FI0009007132	Fortum Oyj Registered Shares EO 3,40	3,74
FR0010040865	Gecina S.A. Actions Nom. EO 7,50	3,64
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A. Azioni Port.Risp.Non Cnv. o.N.	3,49
BE0974264930	AGEAS SA/NV Actions Nominatives o.N.	3,37
FI0009003305	Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N.	3,28
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	3,27
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	3,26
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	3,16
FI0009005318	Nokian Renkaat Oyj Registered Shares EO 0,2	3,05
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	2,96
DE000EVNK013	Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N.	2,79
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	2,75
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	2,58
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	2,58
PTEDPOAM0009	EDP - Energias de Portugal SA Acções Nom. EO 1	2,52
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	2,41
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. EO 1	2,25
NL0000303709	AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)EO-,12	2,09
DE0007664039	Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	2,08
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien o.N.	1,82

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. Juli 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>203.978.281,26</b>	<b>100,03</b>
1. Aktien		199.285.692,37	97,73
- Chemische Industrie	5.559.675,00		2,73
- Energieversorger	28.108.553,20		13,79
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	20.833.270,18		10,22
- Pharmaindustrie / Biotech	6.291.849,60		3,09
- Real Estate	22.448.809,15		11,01
- Sonstige industrielle Werte	3.626.871,12		1,78
- Telekommunikation	26.095.839,60		12,80
- Transportation	12.995.999,21		6,37
- Unterhaltungsindustrie	5.904.705,78		2,90
- Verbrauchsgüter	15.018.357,39		7,37
- Versicherungen	52.401.762,14		25,70
2. Forderungen		724.936,54	0,36
3. Bankguthaben		3.967.652,35	1,95
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-70.855,55</b>	<b>-0,03</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>203.907.425,71</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 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										
DE0008404005	Allianz SE	STK		30.964	10.368	1.460	EUR 210,000	6.502.440,00	3,19	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		61.353	5.644	34.154	EUR 83,880	5.146.289,64	2,52	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		90.127	10.421	101.328	EUR 57,110	5.147.152,97	2,52	
DE000EVNK013	Evonik Industries AG	STK		189.750	13.518	11.115	EUR 29,300	5.559.675,00	2,73	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		21.063	5.754	994	EUR 227,900	4.800.257,70	2,35	
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE <sup>2)</sup>	STK		59.947	6.468	56.251	EUR 91,280	5.471.962,16	2,68	
DE0007236101	Siemens AG	STK		27.564	2.494	14.357	EUR 131,580	3.626.871,12	1,78	
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK		268.035	77.478	12.644	EUR 27,980	7.499.619,30	3,68	
DE0007664039	Volkswagen AG	STK		20.153	1.983	14.325	EUR 205,500	4.141.441,50	2,03	
							EUR	47.895.709,39	23,49	
Ausland										
NL0000303709	AEGON N.V. <sup>2)</sup>	STK		1.158.477	218.043	3.320.113	EUR 3,594	4.163.566,34	2,04	
BE0974264930	AGEAS SA/NV	STK		150.732	157.842	7.110	EUR 44,560	6.716.617,92	3,29	
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK		284.873	153.320	13.438	EUR 26,195	7.462.248,24	3,66	
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK		265.599	20.963	64.623	EUR 16,850	4.475.343,15	2,19	
FR0000120628	AXA S.A.	STK		416.483	144.144	19.646	EUR 21,880	9.112.648,04	4,47	
FR000064578	Covivio S.A.	STK		97.055	7.822	27.493	EUR 79,240	7.690.638,20	3,77	
PTEDPOAM0009	EDP - Energias de Portugal SA	STK		1.145.998	314.603	54.060	EUR 4,377	5.016.033,25	2,46	
FI0009007132	Fortum Oyj	STK		321.010	77.105	15.142	EUR 23,240	7.460.272,40	3,66	
FR0010040865	Gecina S.A. <sup>2)</sup>	STK		54.229	22.113	2.558	EUR 133,850	7.258.551,65	3,56	
FI0009000202	Kesko Oyj <sup>2)</sup>	STK		209.021	25.884	9.860	EUR 36,150	7.556.109,15	3,71	
NL0010773842	NN Group N.V.	STK		240.809	17.498	22.371	EUR 41,930	10.097.121,37	4,95	
FI0009005318	Nokian Renkaat Oyj <sup>2)</sup>	STK		170.798	13.781	48.759	EUR 35,560	6.073.576,88	2,98	
AT0000743059	OMV AG	STK		143.373	150.136	6.763	EUR 45,520	6.526.338,96	3,20	
FR0000133308	Orange S.A.	STK		990.080	653.635	46.706	EUR 9,395	9.301.801,60	4,56	
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.	STK		702.672	735.820	33.148	EUR 11,170	7.848.846,24	3,85	
BE0003810273	Proximus S.A.	STK		567.449	353.111	26.769	EUR 17,325	9.831.053,93	4,82	
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK		110.949	14.286	63.498	EUR 53,220	5.904.705,78	2,90	
FI0009003305	Sampo OYJ	STK		160.851	28.689	7.588	EUR 40,620	6.533.767,62	3,20	
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK		72.420	75.836	3.416	EUR 86,880	6.291.849,60	3,09	
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK		1.784.073	798.771	84.160	EUR 5,104	9.105.908,59	4,47	
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A. <sup>2)</sup>	STK		17.695.004	1.324.438	2.571.021	EUR 0,394	6.962.984,07	3,41	
							EUR	151.389.982,98	74,24	
							EUR	199.285.692,37	97,73	
Summe Wertpapiervermögen										
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds										
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle		EUR		3.967.652,35			%	100,000	3.967.652,35	1,95
Sonstige Vermögensgegenstände										
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR		724.604,71			EUR	724.936,54	0,36	
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR		331,83			EUR	724.604,71	0,36	
								331,83	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten										
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR		-70.855,55			EUR	-70.855,55	-0,03	
								-70.855,55	-0,03	
Fondsvermögen										
Anteilwert		EUR					EUR	203.907.425,71	100,00 <sup>1)</sup>	
Umlaufende Anteile		STK					STK	19,25		
								10.591.810,00		

<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
			Wertpapierdarlehen Kurswert in EUR befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen					
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:					
NL0000303709	AEGON N.V.	STK	972.260		3.494.302,44
FR0010040865	Gecina S.A.	STK	622		83.254,70
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	3.505		126.705,75
FI0009005318	Nokian Renkaat Oyj	STK	1		35,56
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE	STK	7.174		654.842,72
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A.	STK	68.544		26.972,06
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen					4.386.113,23
					<b>4.386.113,23</b>

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 30.07.2021

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE000BASF111	BASF SE	STK	4.332	103.975	
<b>Ausland</b>					
FR0000121964	Klépierre S.A.	STK	13.452	322.832	
FI4000440664	Neles Corp.	STK	6.481	155.539	
FR0014003307	Publicis Groupe S.A. - Anrechte	STK	110.949	110.949	
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	7.270	174.465	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
	unbefristet	EUR			79.963

(Basiswerte: AEGON N.V. (NL0000303709); AGEAS SA/NV (BE0974264930); Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. (NL0011794037); Assicurazioni Generali S.p.A. (IT0000062072); BASF SE (DE000BASF111); Bayerische Motoren Werke AG (DE0005190003); Covivio S.A. (FR0000064578); Deutsche Post AG (DE0005552004); Gecina S.A. (FR0010040865); Klépierre S.A. (FR0000121964); Porsche Automobil Holding SE (DE000PAH0038); Sampo OYJ (FI0009003305); Snam S.p.A. (IT0003153415))

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 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)		1.380.144,84	0,130
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		5.757.698,45	0,544
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		4.767,01	0,000
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-207.021,74	-0,020
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-523.298,11	-0,049
6. Sonstige Erträge		45.405,84	0,004
davon: Kompensationszahlungen	45.405,84		0,004
Summe der Erträge		6.457.696,29	0,610
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-295.148,08	-0,028
2. Sonstige Aufwendungen		-3.407,78	0,000
davon: Negative Einlagezinsen	-3.407,78		0,000
Summe der Aufwendungen		-298.555,86	-0,028
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		6.159.140,43	0,582
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		12.620.871,28	1,192
2. Realisierte Verluste		-2.679.137,13	-0,253
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		9.941.734,15	0,939
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		16.100.874,58	1,520
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		13.813.566,57	1,304
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		3.585.277,78	0,338
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		17.398.844,35	1,643
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		33.499.718,93	3,163
<b>Entwicklung des Sondervermögens</b>		2021 / 2022	
	EUR	EUR	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		168.983.926,19	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-620.958,90	
2. Zwischenausschüttungen		-2.331.849,30	
3. Mittelzufluss (netto)		4.184.553,43	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	13.788.380,00		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-9.603.826,57		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		192.035,36	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		33.499.718,93	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	13.813.566,57		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	3.585.277,78		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		203.907.425,71	

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

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 UCITS ETF

## Anhang.

**Angaben nach der Derivateverordnung**  
**Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR **4.386.113,23**

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

**Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten** EUR **4.575.979,15**

**Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR **4.722,36**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 4.722,36. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.

**Erträge aus Kompensationszahlungen in Folge von Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR **45.527,67**

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

### Sonstige Angaben

Anteilwert EUR 19,25  
 Umlaufende Anteile STK 10.591.810,00

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)** **97,73**  
**Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)** **0,00**

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.07.2021 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände zum Nennwert  
 Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert) 0,32

### 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 Erträge aus Kompensationszahlungen in Höhe von 45.527,67 EUR enthalten.

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

In den sonstigen Aufwendungen sind Negative Einlagezinsen in Höhe von EUR 3.422,26 enthalten.

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

Verwendete Vermögensgegenstände	Wertpapierleihe	
	EUR	
	absolut	4.386.113,23
	in % des Fondsvermögens	2,15

### 10 größte Gegenparteien

Name	Bruttovolumen offene Geschäfte	Sitzstaat
Clearstream Banking AG	4.386.113,23	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	4.386.113,23

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 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)	4.575.979,15
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	4.722,36
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

2,20

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	Bankia S.A.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	433.062,26
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	215.590,66
3. Name	Agence Française de Développement
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	208.941,62
4. Name	FMS Wertmanagement
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	183.667,72
5. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	179.561,09
6. Name	Landesbank Baden-Württemberg
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	158.887,69
7. Name	Investitionsbank Berlin
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	148.923,08
8. Name	Siemens AG
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	100.084,77
9. Name	NRW.BANK
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	99.514,53
10. Name	HSBC France S.A.
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	99.422,95

## 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	4.575.979,15

# Deka EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 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 Munning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

Thomas Schneider  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A., Luxemburg;  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;  
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. Juli 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)