

Halbjahresbericht
zum 31. Juli 2024.

**Deka STOXX[®] 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 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 Style Composite 40 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 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 2024

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 2024 bis zum 31. Juli 2024.

Der Trend nachlassenden Inflationsdrucks stabilisierte in den vergangenen sechs Monaten die Finanzmärkte und verlieh den Aktienbörsen weiterhin kräftigen Auftrieb. Zudem überzeugten die USA mit einer dynamischen Konjunktur und auch die Eurozone lieferte für das zweite Quartal einen BIP-Anstieg von 0,3 Prozent. In Deutschland blieb die wirtschaftliche Entwicklung hingegen spürbar verhaltener. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken ist weiterhin auf die Inflationsbekämpfung ausgerichtet. Ende 2023 hatten Signale hinsichtlich einer Entspannung an der Preisfront für sehr freundliche Rentenmärkte gesorgt. Die Erwartungen an rasche Leitzinssenkungen wurde im weiteren Verlauf jedoch ausgepreist. Im ersten Quartal 2024 sorgten die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und zwischenzeitlich wieder steigende Renditen. Die Fed behielt über die Berichtsperiode das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei. Die EZB senkte hingegen den Hauptrefinanzierungssatz im Juni von 4,50 Prozent auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger Euroland-Staatsanleihen lag Ende Juli bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,0 Prozent. Damit legten die Renditen auf Halbjahressicht leicht zu.

Die globalen Zinssenkungserwartungen waren ein Antriebsfaktor für die Kurse der weltweiten Aktienmärkte, die sich in der Breite in einer freundlichen Verfassung zeigten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten zwischenzeitlich jeweils auf ein Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Die großen US-Technologiewerte mit Bezug zum Trendthema Künstliche Intelligenz verzeichneten dabei die stärksten Zuwächse, ehe im letzten Monat eine Korrektur einsetzte.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Juli 2024	8
Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2024	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	13

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 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[®] Europe Strong Style Composite 40 Index nachzubilden. Dieser Index bildet sowohl 20 Growth- als auch 20 Value-Unternehmen in Europa ab. Die Value/Growth- 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).

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

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

Wichtige Kennzahlen

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Performance*	6 Monate
	5,78%
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

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[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
IT0005508921	Bca Monte dei Paschi di Siena Azioni nom. o.N.	5,44
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N.	4,60
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	3,65
NL0012969182	Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	3,43
PTBCP0AM0015	Banco Com. Português SA (BCP) Açç. Nom. + Port. Reg. o.N.	3,37
DE0005140008	Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.	3,22
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	3,18
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC Registered Shares LS -,10	3,12
SE0015811963	Investor AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	3,12
NL0011585146	Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	3,01
DK0062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	2,99
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE Namens-Aktien o.N.	2,80
DK0015998017	Bavarian Nordic Navne-Aktier DK 10	2,77
SE0000379190	Castellum AB Namn-Aktier o.N.	2,73
CH0311864901	VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	2,71
GB0031215220	Carnival PLC Registered Shares DL 1,66	2,68
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,054141	2,67
NL0012866412	BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01	2,54
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC Registered Shares LS-,27285714	2,53
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	2,46
DK0060448595	Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1	2,39
SE0016828511	Embracer Group AB Namn-Aktier AK Class B o.N.	2,26
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The Registered Shares LS-,01051948	2,25
CH0418792922	Sika AG Namens-Aktien SF 0,01	2,24
CH0024608827	Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	2,12
PLDINPL00011	Dino Polska S.A. Inhaber-Aktien ZY -,10	2,08
IT0004056880	Amplifon S.p.A. Azioni nom. EO -,02	2,06
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	2,05
FI0009000681	Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	1,98
GB00B033F229	Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395	1,89
SE0012673267	Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	1,86
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A. Acciones Port. EO -,25	1,86
CH1175448666	Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01	1,82
LU1598757687	ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN	1,78
DK0010272202	GENMAB AS Navne Aktier DK 1	1,56
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE Namens-Aktien o.N.	1,53
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port. EO -,20	1,46
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE Namens-Aktien o.N.	1,31
FR0000121147	Forvia SE Actions Port. EO 7	1,26
SE0015988019	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.	1,21

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Juli 2024.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		40.649.330,60	100,06
1. Aktien		40.479.006,42	99,64
- Banken	6.993.161,27		17,21
- Bau und Baustoffe	3.231.276,33		7,95
- Bergbau	720.880,44		1,77
- Elektrik / Elektronik	2.842.450,15		7,00
- Energieversorger	766.107,38		1,89
- Holdinggesellschaften	1.262.796,86		3,11
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	3.591.721,74		8,84
- Pharmaindustrie / Biotech	6.920.021,63		17,03
- Real Estate	3.719.320,37		9,15
- Software	1.825.344,73		4,49
- Sonstige Dienstleistungen	2.473.892,33		6,09
- Sonstige industrielle Werte	1.095.492,10		2,70
- Telekommunikation	1.421.084,53		3,50
- Textilien und Kleidung	995.316,00		2,45
- Transportation	1.025.503,45		2,52
- Unterhaltungsindustrie	752.886,40		1,85
- Verbrauchsgüter	841.750,71		2,07
2. Forderungen		23.293,77	0,06
3. Bankguthaben		147.030,41	0,36
II. Verbindlichkeiten		-22.602,87	-0,06
III. Fondsvermögen		40.626.727,73	100,00

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

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Juli 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE		STK	24.511	0	1.708	EUR 21,600	529.437,60	1,30
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE		STK	30.044	0	2.093	EUR 20,610	619.206,84	1,52
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	90.293	0	6.292	EUR 14,436	1.303.469,75	3,21
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	14.017	442	1.418	EUR 80,860	1.133.414,62	2,79
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	69.247	0	4.825	EUR 26,910	1.863.436,77	4,59
							EUR	5.448.965,58	13,41
Ausland									
NL0012969182	Adyen N.V.		STK	1.230	0	85	EUR 1.130,600	1.390.638,00	3,42
IT0004056880	Amplifon S.p.A.		STK	28.363	0	1.976	EUR 29,400	833.872,20	2,05
LU1598757687	ArcelorMittal S.A.		STK	34.426	0	2.399	EUR 20,940	720.880,44	1,77
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	1.511	0	106	EUR 850,500	1.285.105,50	3,16
PTBCPOAM0015	Banco Com. Português SA (BCP)		PTK	3.501.867	0	243.997	EUR 0,390	1.365.027,76	3,36
DK0015998017	Bavarian Nordic		STK	45.153	0	3.147	DKK 185,450	1.122.161,32	2,76
IT0005508921	Bca Monte dei Paschi di Siena		STK	436.924	0	30.443	EUR 5,040	2.202.096,96	5,42
NL0012866412	BE Semiconductor Inds N.V.		STK	8.627	0	601	EUR 119,150	1.027.907,05	2,53
GB00BLJNXL82	Berkeley Group Holdings PLC		STK	17.922	0	1.249	GBP 50,800	1.080.702,24	2,66
GB0031215220	Carnival PLC		STK	75.702	0	5.275	GBP 12,055	1.083.254,33	2,67
SE0000379190	Castellum AB		STK	95.771	0	6.673	SEK 134,000	1.106.558,65	2,72
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A.		STK	23.391	0	1.630	EUR 32,180	752.722,38	1,85
GB00B033F229	Centrica PLC		STK	486.916	0	33.927	GBP 1,326	766.107,38	1,89
DK0060448595	Coloplast AS		STK	8.036	0	560	DKK 896,600	965.562,76	2,38
PLDINPL00011	Dino Polska S.A.		STK	10.269	0	716	PLN 352,000	841.750,71	2,07
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC		STK	191.730	0	13.359	GBP 4,506	1.025.503,45	2,52
SE0016828511	Embracer Group AB		STK	386.965	0	26.963	SEK 27,390	913.901,39	2,25
SE0012673267	Evolution AB (publ)		STK	8.416	0	586	SEK 1.037,500	752.886,40	1,85
NL0011585146	Ferrari N.V.		STK	3.204	0	223	EUR 380,400	1.218.801,60	3,00
FR0000121147	Forvia SE		STK	47.022	0	3.276	EUR 10,835	509.483,37	1,25
DK0010272202	GENMAB AS		STK	2.412	0	168	DKK 1.955,000	631.925,54	1,56
FR0000052292	Hermes International S.C.A.		STK	492	0	34	EUR 2.023,000	995.316,00	2,45
SE0015811963	Investor AB		STK	48.207	0	3.359	SEK 303,800	1.262.796,86	3,11
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC		STK	1.786.290	0	124.463	GBP 0,596	1.263.305,34	3,11
FR0000120321	L'Oréal S.A.		STK	2.067	0	143	EUR 400,650	828.143,55	2,04
SE0015988019	NIBE Industrier AB		STK	120.973	0	8.429	SEK 47,010	490.359,19	1,21
FI0009000681	Nokia Oyj		STK	221.452	0	15.430	EUR 3,621	801.877,69	1,97
DK0062498333	Novo-Nordisk AS		STK	9.914	0	690	DKK 912,000	1.211.673,47	2,98
CH0024608827	Partners Group Holding AG		STK	691	0	48	CHF 1.184,500	859.261,46	2,12
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The		STK	70.704	0	4.926	GBP 10,860	911.443,34	2,24
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.		STK	3.198	0	223	EUR 184,950	591.470,10	1,46
CH0418792922	Sika AG		STK	3.240	0	226	CHF 266,800	907.492,52	2,23
CH1175448666	Straumann Holding AG		STK	6.173	0	430	CHF 113,450	735.212,69	1,81
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE		STK	21.347	0	1.488	EUR 69,300	1.479.347,10	3,64
CH0311864901	VAT Group AG		STK	2.370	0	166	CHF 440,300	1.095.492,10	2,70
							EUR	35.030.040,84	86,22
Summe Wertpapiervermögen							EUR	40.479.006,42	99,64
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	147.030,41	0,36
EUR-Guthaben bei:									
DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR		131.338,40			% 100,000	131.338,40	0,32
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK		28.997,39			% 100,000	3.885,98	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK		23.567,91			% 100,000	1.991,84	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK		62.153,71			% 100,000	5.359,23	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP		5.944,60			% 100,000	7.056,32	0,02
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenansprüche		EUR		1.952,21			EUR	23.293,77	0,06
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR		20.907,24				1.952,21	0,00
Zinsansprüche		EUR		434,32				20.907,24	0,05
								434,32	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen							EUR	-2.601,36	-0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale		PLN		-7.247,96			% 100,000	-1.687,83	-0,00
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF		-870,18			% 100,000	-913,53	-0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR		-22.585,93			EUR	-22.602,87	-0,06
Zinsverbindlichkeiten		EUR		-16,94				-22.585,93	-0,06
								-16,94	-0,00
Fondsvermögen							EUR	40.626.727,73	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	36,18	

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Umlaufende Anteile						STK	1.122.962,00	

¹⁾ 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 31.07.2024

Devisenkurse (in Mengennotiz)		31.07.2024
Britisches Pfund	(GBP)	0,84245 = 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	(DKK)	7,46205 = 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	11,83225 = 1 Euro (EUR)
Polnischer Zloty	(PLN)	4,29425 = 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	11,59750 = 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,95255 = 1 Euro (EUR)

Deka STOXX[®] Europe Strong Style Composite 40 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.02.2024 bis zum 31.07.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		49.649,44	0,044
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		479.999,38	0,427
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		1.608,73	0,001
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-7.538,66	-0,007
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-42.250,86	-0,038
6. Sonstige Erträge		1,38	0,000
davon: Sonstiges	1,38		0,000
Summe der Erträge		481.469,41	0,429
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-491,38	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-132.916,38	-0,118
3. Sonstige Aufwendungen		-136,47	0,000
davon: Bankgebühren	-136,29		0,000
davon: Sonstiges	-0,18		0,000
Summe der Aufwendungen		-133.544,23	-0,119
III. Ordentlicher Nettoertrag		347.925,18	0,310
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		466.766,02	0,416
2. Realisierte Verluste		-203.500,77	-0,181
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		263.265,25	0,234
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		611.190,43	0,544
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		2.311.470,99	2,058
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-664.314,32	-0,592
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.647.156,67	1,467
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.258.347,10	2,011
Entwicklung des Sondervermögens		2024 / 2025	
	EUR	EUR	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		41.409.350,86	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-45.718,48	
2. Zwischenausschüttungen		-137.155,44	
3. Mittelzufluss (netto)		-2.864.769,19	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	0,00		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-2.864.769,19		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		6.672,88	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.258.347,10	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	2.311.470,99		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-664.314,32		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		40.626.727,73	

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

Deka STOXX[®] 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	36,18
Umlaufende Anteile	STK	1.122.962,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,64

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 31.07.2024 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 31.07.2024 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)

0,13

Der im Geschäftsjahr 2016/2017 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind Domizilierungsgebühren in Höhe von EUR -136,29 enthalten.

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 1. August 2024
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 2023

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 112,7 Mio.

Alleingeschafterin

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

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Peter Scherkamp, München

Dr. Bernd Türk, Frankfurt am Main

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 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 2024

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

