

Amundi Luxembourg S.A.
(vormals: Lyxor Funds Solutions S.A.)
Luxemburg

Testatsexemplar
OGAW
Umbrella-Konstruktion Lyxor 1
Jahresbericht zum 30. Juni 2022

Ernst & Young GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft



Inhaltsverzeichnis

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

Jahresbericht

Auftragsbedingungen, Haftung und Verwendungsvorbehalt

Allgemeine Auftragsbedingungen

Hinweis:

Den nachfolgenden Vermerk haben wir, unter Beachtung der gesetzlichen und berufsständischen Bestimmungen, nach Maßgabe der in der Anlage "Auftragsbedingungen, Haftung und Verwendungsvorbehalt" beschriebenen Bedingungen erteilt.



Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die Amundi Luxembourg S.A.

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresberichte der Teilsondervermögen Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF, Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF, Lyxor 1 EUROSTOXX 50 (DR) UCITS ETF, Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF, Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF, Lyxor 1 STOXX (DR) Europe 600 UCITS ETF und Lyxor 1 DAX (DR) 50 ESG UCITS ETF der Umbrella-Konstruktion Lyxor 1- bestehend aus den Tätigkeitsberichten für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2021 bis zum 30. Juni 2022, den Vermögensübersichten und den Vermögensaufstellungen zum 30. Juni 2022, den Ertrags- und Aufwandsrechnungen, der Verwendungsrechnungen, der Entwicklungsrechnungen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2021 bis zum 30. Juni 2022, sowie den vergleichenden Übersichten über die letzten drei Geschäftsjahre, den Aufstellungen der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und den Anhängen – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entsprechen die beigefügten Jahresberichte in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglichen es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung der Jahresberichte in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresberichte“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Amundi Luxembourg S.A. unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu den Jahresberichten zu dienen.

Hervorhebung eines Sachverhalts

Wir verweisen auf die Angabe der gesetzlichen Vertreter im Tätigkeitsbericht des Jahresberichts im Zusammenhang mit der Fortführung der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF, in der beschrieben ist, dass die Auflösung der Teilsondervermögen durch Kündigung zum 13. September 2022 erfolgt ist. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht ist diesbezüglich nicht modifiziert.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für die Jahresberichte

Die gesetzlichen Vertreter der Amundi Luxembourg S.A. sind verantwortlich für die Aufstellung der Jahresberichte, die den deutschen Vorschriften des KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entsprechen und dafür, dass die Jahresberichte es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglichen, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung der Jahresberichte zu ermöglichen, die frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen sind.

Bei der Aufstellung der Jahresberichte sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung der Investmentvermögen wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung der Jahresberichte die Fortführung des Sondervermögens durch die Amundi Luxembourg S.A. zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Ereignisse oder Gegebenheiten im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens - sofern einschlägig - anzugeben.

Die gesetzlichen Vertreter sind auch verantwortlich für die Angaben nach der EU-Offenlegungsverordnung ((EU) 2019/2088) und der EU-Taxonomieverordnung ((EU) 2020/852) in Übereinstimmung mit den von der Kapitalverwaltungsgesellschaft für Kapitalverwaltungsgesellschaft für die bei den Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF des Investmentvermögen angewandten konkretisierenden Kriterien. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die Vorkehrungen und Maßnahmen (Systeme), die sie als notwendig erachtet haben, um die Angaben nach der EU-Offenlegungsverordnung und der EU-Taxonomieverordnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (Manipulation der Nachhaltigkeitsberichterstattung) oder Irrtümern sind.

Die einschlägigen europäischen Vorschriften enthalten Formulierungen und Begriffe, die erheblichen Auslegungsunsicherheiten unterliegen und für die noch keine maßgebenden umfassenden Interpretationen veröffentlicht wurden. Demzufolge haben die gesetzlichen Vertreter im Anhang der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF ihre Auslegungen solcher Formulierungen und Begriffe angegeben. Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Vertretbarkeit dieser Auslegungen. Da solche Formulierungen und Begriffe unterschiedlich durch Regulatoren oder Gerichte ausgelegt werden können, ist die Gesetzmäßigkeit dieser Auslegungen unsicher. Wie im Anhang der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF dargelegt, unterliegt auch die Taxonomie-Quote inhärenten Unsicherheiten, da zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresberichts nur unzureichend zuverlässige und überprüfbare Daten vorlagen, auf deren Basis die Investitionen bezüglich der technischen Screeningkriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten bewertet werden konnten.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresberichte

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresberichte als Ganzes frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen sind, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zu den Jahresberichten beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieser Jahresberichte getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – falscher Darstellungen in den Jahresberichten planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unsere Prüfungsurteile zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung der Jahresberichte relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Amundi Luxembourg S.A. abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Amundi Luxembourg S.A. bei der Aufstellung der Jahresberichte angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Amundi Luxembourg S.A. aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben in den Jahresberichten aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Amundi Luxembourg S.A. nicht fortgeführt werden.
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt der Jahresberichte, einschließlich der Angaben sowie ob die Jahresberichte die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellen, dass die Jahresberichte es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglichen, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

- beurteilen wir die Eignung der von den gesetzlichen Vertretern zu den Angaben nach der EU-Offenlegungsverordnung und der EU-Taxonomieverordnung im Anhang der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF angewendeten Kriterien insgesamt. Wie in der Beschreibung der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter dargelegt, haben die gesetzlichen Vertreter die in den einschlägigen europäischen Vorschriften enthaltenen Formulierungen und Begriffe ausgelegt; die Gesetzmäßigkeit dieser Auslegungen ist mit den in der Beschreibung genannten inhärenten Unsicherheiten behaftet. Des Weiteren unterliegen die in dieser Beschreibung genannten Quoten den dort genannten inhärenten Unsicherheiten bei deren Messung bzw. Beurteilung. Diese inhärenten Unsicherheiten bei der Auslegung und bei der Messung bzw. Beurteilung gelten entsprechend auch für unsere Prüfung.

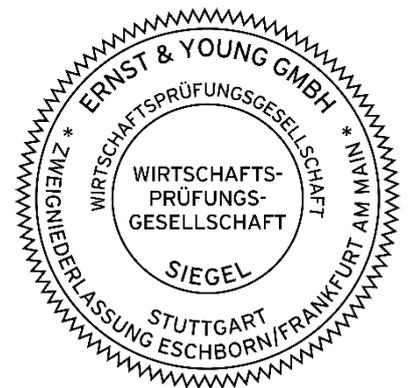
Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Eschborn/Frankfurt am Main, 31. Oktober 2022

Ernst & Young GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Heist
Wirtschaftsprüfer

Arlt
Wirtschaftsprüfer



Lyxor 1

Zusammengefasster Tätigkeitsbericht für die Teilsondervermögen

**Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF,
Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF,
Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF,
Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF,
Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF,
Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF und
Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF**

Anlageziele und -politik:

Das Anlageziel des jeweiligen Teilfonds besteht darin, den Anlegern einen Ertrag zukommen zu lassen, der an die Wertentwicklung des jeweiligen "Index" dieses Teilfonds anknüpft.

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF - Wertentwicklung des MDAX® (Performance-Index)

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF - Wertentwicklung des DivDAX® Index (Preis-Index)

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF - Wertentwicklung des TecDAX® (Performance-Index)

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF - Wertentwicklung des SDAX® (Performance-Index)

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF - Wertentwicklung des EURO STOXX 50® (Net-Return-Index)

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF - Wertentwicklung des STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net-Return-Index

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF - Wertentwicklung des DAX 50 ESG (Performance-Index)

Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass das Anlageziel des Teilfonds tatsächlich erreicht wird.

Bei der Anknüpfung an die Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index kann es zu einem voraussichtlichen Tracking Error kommen.

Eine detaillierte Darstellung der Anlageziele und –politik kann dem Verkaufsprospekt entnommen werden.

Wesentliche Tendenzen im Berichtszeitraum:

Das Berichtsjahr des Fonds (1. Juli 2021 bis 30. Juni 2022) war insbesondere durch 2 Ereignisse geopolitischer Dimension geprägt. Der weitere Verlauf der COVID-19-Pandemie mit dem Fortschreiten der globalen Impfkampagne, dem Auftreten neuer Virusvarianten und dem Verhängen harter Lock-Downs in einigen chinesischen Großstädten (z.B. Shanghai) sowie die Invasion russischer Truppen in die Ukraine gefolgt von internationalen Sanktionen durch westliche Regierungen gegen Russland hatten erheblichen Einfluss auf die globale Wirtschaft und die Finanzmärkte. Die weltweiten Aktienmärkte setzten im Berichtszeitraum zunächst ihren Aufwärtstrend fort und erreichten zu Beginn des Jahres 2022 neue Rekorde. Danach folgte aufgrund der oben genannten Ereignisse ein scharfer Abschwung.

Wertentwicklung bekannter Aktienindizes:

| | |
|------------------------------------|----------|
| MSCI World Preis-Index (in USD): | -15,61 % |
| EuroStoxx 50 Preis-Index (in EUR): | -14,99 % |
| DAX Performance-Index (in EUR): | -17,69 % |
| Topix Preis-Index (in JPY): | - 3,74 % |
| S&P 500 Preis-Index (in USD): | -11,92 % |

An den Rohstoffmärkten führten Erwartungen an eine deutliche Verknappung des Angebots in Folge der Sanktionen gegen Russland zu weiter steigenden Notierungen im Energiesektor (Rohöl Ölderivate, Erdgas). Der Goldpreis erreichte kurz nach Beginn der russischen Invasion in die Ukraine mit Preisen von über USD 2050 per Feinunze seinen Höhepunkt, konsolidierte hingegen bis zum Ende der Berichtsperiode auf USD 1807.

Wertentwicklung wichtiger Rohstoffe in USD:

| | |
|----------------------|-----------|
| Rohöl (Sorte Brent): | + 52,82 % |
| Kupfer: | - 13,55 % |
| Gold: | + 2,10 % |

Der Euro hat im Berichtszeitraum gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren (-11,59 %), was umgekehrt bedeutet, dass Anlagen in US-Dollar um denselben Prozentsatz an Wert gewonnen haben. Andererseits hat der Euro gegenüber dem japanischen Yen weiter an Wert gewonnen (+7,98 %).

Zum 30. Juni 2022 notierte die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen bei -0,21 %. Im Verlauf des Betrachtungszeitraums stieg die Rendite dieser langlaufenden Schulden der Bundesrepublik Deutschland deutlich um 155 Basispunkte auf +1,34 % per 30. Juni 2022.

Wertentwicklung von ausgewählten Indizes mit Bezug zu den Teilfonds:

| | |
|-----------------------------------|----------|
| MDAX Performance-Index: | -24,16 % |
| DivDAX Performance-Index: | -15,41 % |
| TecDAX Performance-Index: | -19,04 % |
| SDAX Performance-Index: | -25,84 % |
| DAX50 ESG Performance-Index: | -18,33 % |
| Euro Stoxx 50 Preis-Index: | -14,99 % |
| Stoxx Europe 600 ESG Preis-Index: | -10,08 % |

Datenquelle: Bloomberg

Im Berichtszeitraum wurde der Lyxor 1 STOXX Europe 600 UCITS ETF in Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF umbenannt und der zugrundeliegende Index entsprechend auf den STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net-Return-Index umgestellt (per 03.Nov.2021). Es wurde kein neuer Teilfonds aufgelegt.

Wertentwicklung der einzelnen Teilsondervermögen:

| | |
|--|----------|
| Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF: | -25,46 % |
| Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF: | -18,80 % |
| Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF: | -19,57 % |
| Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF: | -27,40 % |
| Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF: | -14,11 % |
| Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF: | -9,80 % |
| Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF: | -20,54 % |

Wesentliche Risiken der Teilsondervermögen im Berichtszeitraum:

Neben den allgemeinen Risiken einer Fondsanlage zuzüglich der Risiken einer Anlage in Wertpapierindex-OGAWs (Indexrisiken), bestanden im Berichtszeitraum die folgenden wesentlichen Risiken für die Teilsondervermögen:

Wertveränderungsrisiken:

Die Vermögensgegenstände, in die die Gesellschaft für Rechnung des jeweiligen Teilfonds investiert, unterliegen Risiken. So können Wertverluste auftreten, indem der Marktwert der Vermögensgegenstände gegenüber dem Einstandspreis fällt oder Kassa- und Terminpreise sich unterschiedlich entwickeln.

Kapitalmarktrisiko:

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung insbesondere an einer Börse können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken. Schwankungen der Kurs- und Marktwerte können auch auf Veränderungen der Zinssätze, Wechselkurse oder der Bonität eines Emittenten zurückzuführen sein.

Adressenausfallrisiko / Gegenpartei-Risiken (außer zentrale Kontrahenten):

Durch den Ausfall eines Ausstellers (nachfolgend „Emittent“) oder eines Vertragspartners (Kontrahenten), gegen den der Fonds Ansprüche hat, können für den jeweiligen Teilfonds Verluste entstehen. Das Emittentenrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Emittenten, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Emittenten eintreten. Die Partei eines für Rechnung des jeweiligen Teilfonds geschlossenen Vertrags kann teilweise oder vollständig ausfallen (Kontrahentenrisiko). Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung des jeweiligen Teilfonds geschlossen werden.

Kursänderungsrisiko von Aktien:

Aktien unterliegen erfahrungsgemäß starken Kursschwankungen und somit auch dem Risiko von Kursrückgängen. Diese Kursschwankungen werden insbesondere durch die Entwicklung der Gewinne des emittierenden Unternehmens sowie die Entwicklungen der Branche und der gesamtwirtschaftlichen Entwicklung beeinflusst. Das Vertrauen der Marktteilnehmer in das jeweilige Unternehmen kann die Kursentwicklung ebenfalls beeinflussen. Dies gilt insbesondere bei Unternehmen, deren Aktien erst über einen kürzeren Zeitraum an der Börse oder einem anderen organisierten Markt zugelassen sind; bei diesen können bereits geringe Veränderungen von Prognosen zu starken Kursbewegungen führen. Ist bei einer Aktie der Anteil der frei handelbaren, im Besitz vieler Aktionäre befindlichen Aktien (sogenannter Streubesitz) niedrig, so können bereits kleinere Kauf- und Verkaufsaufträge eine starke Auswirkung auf den Marktpreis haben und damit zu höheren Kursschwankungen führen.

Risiko von negativen Habenzinsen:

Die Gesellschaft legt liquide Mittel des jeweiligen Teilfonds bei der Verwahrstelle oder anderen Banken für Rechnung des jeweiligen Teilfonds an. Für diese Bankguthaben ist teilweise ein Zinssatz vereinbart, der dem European Interbank Offered Rate (Euribor) abzüglich einer bestimmten Marge entspricht. Sinkt der Euribor unter die vereinbarte Marge, so führt dies zu negativen Zinsen auf dem entsprechenden Konto. Abhängig von der Entwicklung der Zinspolitik der Europäischen Zentralbank können sowohl kurz-, mittel- als auch langfristige Bankguthaben eine negative Verzinsung erzielen.

Nachhaltigkeitsrisiko:

„**Nachhaltigkeitsrisiko**“ bezeichnet ein Ereignis oder eine Bedingung im Bereich Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung (ESG), das, wenn es eintritt, eine tatsächliche oder potenzielle wesentliche negative Auswirkung auf den Wert der Investitionen des betreffenden Teilfonds haben könnte. Nachhaltigkeitsrisiken können entweder ein eigenes Risiko darstellen oder sich auf andere Risiken auswirken und diese erheblich verstärken, wie z. B. unter anderem, aber nicht ausschließlich Marktrisiken, operationelle Risiken, Liquiditätsrisiken oder Kontrahentenrisiken. Die Bewertung von Nachhaltigkeitsrisiken ist komplex und kann auf ESG-Daten beruhen, die schwer zu beschaffen, unvollständig, geschätzt, veraltet und/oder anderweitig in wesentlichen Punkten ungenau sind.

Selbst wenn diese Daten identifiziert werden, gibt es keine Garantie, dass sie korrekt bewertet werden.

Nachhaltigkeitsrisiken stehen unter anderem, aber nicht ausschließlich, im Zusammenhang mit klimabedingten Ereignissen, die aus dem Klimawandel resultieren (auch bekannt als physische Risiken) oder mit der Reaktion der Gesellschaft auf den Klimawandel (auch bekannt als Übergangsrisiken), was zu unerwarteten Verlusten führen kann, die sich auf die Investitionen und die finanzielle Lage des betreffenden Teilfonds auswirken können. Soziale Verhältnisse (z. B. Ungleichheit, Inklusion, Arbeitsverhältnisse, Investitionen in Humankapital, Unfallverhütung, verändertes Kundenverhalten usw.) oder Mängel in der Unternehmensführung (z. B. wiederholte erhebliche Verstöße gegen internationale Vereinbarungen, Bestechungsfälle, Produktqualität und -sicherheit, Verkaufspraktiken usw.) können sich ebenfalls in Nachhaltigkeitsrisiken niederschlagen.

Eine Darstellung aller mit dem Fonds verbundenen Risiken, kann dem Verkaufsprospekt entnommen werden.

Risikomanagement:

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisiko-potential wurde für dieses Teilsondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

COVID:

Seit dem Jahreswechsel 2019 / 2020 beobachten wir die globalen Entwicklungen der COVID-19-Pandemie. Die Auswirkungen von COVID-19 haben den weltweiten Reiseverkehr und die Lieferketten nachteilig geprägt sowie die globalen Handelsaktivitäten, die Transportindustrie und die Rohstoffpreise im Energiesektor negativ beeinflusst. Aufgrund der raschen Entwicklung und der Unbeständigkeit dieser Situation war eine Vorhersage der erwarteten Auswirkungen nicht möglich.

Die Auswirkungen von COVID-19 wurden in verschiedenen Branchen, Sektoren oder Regionen beobachtet und haben und können sich auch in Zukunft auf die operative Performance der Anlageportfolios unserer verwalteten Investmentpläne auswirken. Auch in Zukunft wird der Investmentmanager die Auswirkungen der Pandemie auf die Wirtschaft und die Ertragsaussichten sowie die politischen Maßnahmen der Zentralbanken und den Regierungen genau beobachten.

Die Verwaltungsgesellschaft verfolgt die laufenden Entwicklungen im Zusammenhang mit der COVID-19-Pandemie genau. Die fortgesetzte Leistungserbringung und Unterstützung unserer verwalteten Investmentfonds bleibt unsere höchste Priorität. Wir haben Maßnahmen getroffen, um sicherzustellen, dass wir unsere Dienstleistungen für die verwalteten Fonds weiterhin erbringen können.

So hat die Verwaltungsgesellschaft bereits bewährte Business Continuity-Maßnahmen aktiviert, die sicherstellen, dass kritische Prozesse weiterhin aufrechterhalten werden, sodass wir unseren verwalteten Investmentfonds kontinuierliche Dienstleistungen erbringen können.

Aus diesem Grund haben wir eine Reihe von Maßnahmen umgesetzt, darunter Heimarbeit und das Arbeiten an getrennten Standorten. Wir arbeiten zudem eng mit unseren Dienstleistern und Service-Providern zusammen, um sicherzustellen, dass auch diese weiter ihre Dienstleistungen erbringen können.

Zudem haben wir auch alle internationalen Geschäftsreisen eingeschränkt (mit Ausnahme besonderer Umstände aus Gründen der Geschäftskontinuität oder aus regulatorischen Gründen). Wir empfangen keine externen Gäste oder Kunden in unseren Büros. Zudem weisen wir auch unsere Mitarbeiter an, bei jeglichen zwischenmenschlichen Interaktionen einen Sicherheitsabstand zu wahren. Unsere Vorstellung ist es, eine vertrauenswürdige Verwaltungsgesellschaft für die von uns verwalteten Investmentfonds zu sein. Derzeit liefern wir alle Dienstleistungen und erfüllen unsere Qualitätsrichtlinien und werden dies auch fortlaufend tun. Falls Lyxor Funds Solutions S.A. dennoch der Ansicht ist, dass sich unsere Fähigkeit, einen normalen Service anzubieten, ändern könnte, werden wir uns umgehend mit Investoren und Aufsichtsbehörden in Verbindung setzen.

Ungeachtet dessen sollten Anleger jedoch Folgendes berücksichtigen:

COVID-19, die Ölpreisbewegungen und andere geopolitische Faktoren belasten weiterhin die Finanzmärkte. Obwohl die Impfkampagnen Ende 2020 / Anfang 2021 begonnen haben, besteht immer noch Unsicherheit über das endgültige Ausmaß und die Dauer der COVID-19-Pandemie, was eine Vorhersage der Liquidität deutlich erschwert. Investierte Portfolios können erheblich an Wert verlieren.

Liquiditätsprobleme könnten auftreten - diese könnten zum Beispiel dann auftreten, wenn Investmentfonds Bargeld brauchen, um die laufenden Rechnungen zu bezahlen, Margenanforderungen zu erfüllen und Rücknahmeerlöse auszuführen – diese Risiken werden höchstwahrscheinlich so lange bestehen, bis die Märkte wieder ohne Auswirkungen von aufkommenden Lock-Downs fungieren.

Aufgrund von COVID-19 können sich derzeit noch nicht vorhersehbare Risiken auf verwaltete Investmentfonds auswirken, z.B. könnte es zu erheblichen operativen Herausforderungen oder Bewertungsherausforderungen kommen. Es ist derzeit unvorhersehbar, welche Unternehmen die Auswirkungen von Lock-Downs überstehen werden und ab wann die Wirtschaft wieder ohne COVID-19-Effekte arbeiten kann. Niedriger bewertete und kleinere Unternehmen befinden sich in einer prekären Lage und haben weniger Spielraum, um durch die unsicheren Gewässer zu navigieren.

Aktuelle Risikohinweise, welche in den jeweiligen Verkaufsprospekten der verwalteten Investmentfonds beschrieben werden, warnen möglicherweise nicht ausreichend vor allen möglichen und derzeit nicht vorhersehbaren Folgen von COVID-19 und seinen Marktentwicklungen.

ARUG II:

Zum 01. Januar 2020 ist das ARUG II in Kraft getreten.

Die Angaben nach §134c Abs. 4 AktG, die nicht im Tätigkeitsbericht oder Anhang angegeben werden, können auf der Homepage der Amundi Luxembourg S.A. unter folgendem Link abgerufen werden:

<https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/Amundi>

Wesentliche Gewinne und Verluste

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Daimler AG).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Henkel AG).

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Airbus SE).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Daimler AG).

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position ASML Holding N.V.).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position Amadeus IT Group SA).

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position Zooplus AG).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Nordex SE).

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Siemens Healthineers AG).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position Nordex SE).

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Adyen NV).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Glencore PLC)

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Daimler Truck Holding AG).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Teamviewer AG.)

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A.

Die folgenden Teilsondervermögen wurden mit Wirkung zum 13. September 2022 aufgelöst:

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF

Ukraine / Russland Konflikt

Im Februar 2022 verhängten mehrere Länder (darunter die USA, das Vereinigte Königreich und die EU), aufgrund der offiziellen Anerkennung der Volksrepubliken Donezk und Lugansk durch die Russische Föderation, Sanktionen gegenüber bestimmten Organisationen, Gesellschaften und Personen in Russland. Nach den von Russland am 24. Februar 2022 eingeleiteten Militäroperationen gegen die Ukraine wurden mögliche weitere Sanktionen angekündigt.

Diese Situation hat zusammen mit den zunehmenden Turbulenzen aufgrund von Schwankungen der Rohstoffpreise und der Wechselkurse und dem Potenzial sich negativ auf die Weltwirtschaft auszuwirken zu einem starken Anstieg der Volatilität an den Märkten geführt. Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft erachtet diese Ereignisse für den Fonds als wertbegründend und sieht demnach keine Anpassung des Jahresabschlusses vor.

Im Berichtszeitraum wurden keine direkten Investitionen in Unternehmen in Russland oder der Ukraine getätigt.

Der Verwaltungsrat

Luxemburg, den 31. Oktober 2022

Anmerkung: Die Informationen in diesem Bericht beziehen sich auf historische Daten und haben keine Aussagekraft für die künftige Entwicklung der Gesellschaft.

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Teilsonderver- mögens |
|--------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 42.903.523,31 | 100,07 |
| 1. Aktien | | 42.847.646,06 | 99,94 |
| - Bau und Baustoffe | 697.455,60 | | 1,63 |
| - Chemische Industrie | 4.699.852,61 | | 10,96 |
| - Energieversorger | 4.337.963,34 | | 10,12 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 6.389.718,88 | | 14,90 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 4.054.912,80 | | 9,46 |
| - Real Estate | 2.265.475,80 | | 5,28 |
| - Sonstige industrielle Werte | 4.189.918,95 | | 9,77 |
| - Telekommunikation | 4.681.746,06 | | 10,92 |
| - Transportation | 3.716.852,78 | | 8,67 |
| - Versicherungen | 7.813.749,24 | | 18,22 |
| 2. Bankguthaben | | 55.877,25 | 0,13 |
| II. Verbindlichkeiten | | -28.718,01 | -0,07 |
| III. Teilsondervermögen | | 42.874.805,30 | 100,00¹⁾ |

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Teilsondervermögens |
|---|------------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|-------------|----------------------|---------------------------|
| | | | | | im Berichtszeitraum | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | |
| DE0008404005 | Allianz SE | STK | 24.377 | 24.377 | 7.223 | 4.330 | EUR 182,120 | 4.439.539,24 | 10,35 |
| DE000BASF111 | BASF SE | STK | 96.922 | 96.922 | 29.888 | 5.279 | EUR 41,525 | 4.024.686,05 | 9,39 |
| DE000BAY0017 | Bayer AG | STK | 71.490 | 71.490 | 22.222 | 32.458 | EUR 56,720 | 4.054.912,80 | 9,46 |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke AG | STK | 34.424 | 34.424 | 10.818 | 3.051 | EUR 73,460 | 2.528.787,04 | 5,90 |
| DE0006062144 | Covestro AG | STK | 20.472 | 20.472 | 6.322 | 1.919 | EUR 32,980 | 675.166,56 | 1,57 |
| DE0005552004 | Deutsche Post AG | STK | 103.997 | 103.997 | 32.019 | 9.760 | EUR 35,740 | 3.716.852,78 | 8,67 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | STK | 247.110 | 247.110 | 63.740 | 81.949 | EUR 18,946 | 4.681.746,06 | 10,92 |
| DE000ENAG999 | E.ON SE | STK | 223.478 | 223.478 | 70.548 | 19.973 | EUR 8,008 | 1.789.611,82 | 4,17 |
| DE0006047004 | HeidelbergCement AG | STK | 15.215 | 15.215 | 16.568 | 1.353 | EUR 45,840 | 697.455,60 | 1,63 |
| DE0008430026 | Münchener Rückvers.-Ges. AG | STK | 15.050 | 15.050 | 4.739 | 1.344 | EUR 224,200 | 3.374.210,00 | 7,87 |
| DE000PAH0038 | Porsche Automobil Holding SE | STK | 16.450 | 16.450 | 17.636 | 1.186 | EUR 63,120 | 1.038.324,00 | 2,42 |
| DE0007037129 | RWE AG | STK | 72.644 | 72.644 | 22.800 | 6.409 | EUR 35,080 | 2.548.351,52 | 5,94 |
| DE0007236101 | Siemens AG | STK | 43.155 | 43.155 | 14.865 | 6.628 | EUR 97,090 | 4.189.918,95 | 9,77 |
| DE0007664039 | Volkswagen AG | STK | 22.152 | 22.152 | 23.518 | 1.366 | EUR 127,420 | 2.822.607,84 | 6,58 |
| DE000A1ML7J1 | Vonovia SE | STK | 77.057 | 77.057 | 34.899 | 2.739 | EUR 29,400 | 2.265.475,80 | 5,28 |
| | | | | | | | EUR | 42.847.646,06 | 99,94 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 42.847.646,06 | 99,94 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 55.877,25 | 0,13 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | EUR | 55.877,25 | | % 100,000 | 55.877,25 | 0,13 | |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -28.718,01 | -0,07 |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | | | EUR | -28.718,01 | | | -28.718,01 | -0,07 | |
| Wert des Teilsondervermögens | | | | | | | EUR | 42.874.805,30 | 100,00 ¹⁾ |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 159,59 | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | | STK | 268.650 | |

Fußnoten:

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 30.06.2022

Keine Fremdwährungskurse

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 |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE0007100000 | Daimler AG | STK | 0 | 60.568 | |
| DE000A0HN5C6 | Deutsche Wohnen SE | STK | 0 | 24.889 | |
| DE0006048432 | Henkel AG & Co. KGaA | STK | 0 | 14.514 | |
| DE000A3MQB30 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 0 | 38.217 | |
| DE000A3MQQ33 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 70.645 | 70.645 | |

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2021 bis zum 30.06.2022

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|-----------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 2.207.073,22 | 8,215 |
| 2. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -284.128,61 | -1,058 |
| 3. Sonstige Erträge | | 173,00 | 0,001 |
| Summe der Erträge | | 1.923.117,61 | 7,158 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Verwaltungsvergütung | | -124.104,00 | -0,462 |
| 2. Sonstige Aufwendungen | | -326,25 | -0,001 |
| davon: Verwahrtgelt | -326,25 | -0,001 | -0,001 |
| Summe der Aufwendungen | | -124.430,25 | -0,463 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 1.798.687,36 | 6,695 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 2.411.412,32 | 8,976 |
| 2. Realisierte Verluste | | -494.418,80 | -1,840 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 1.916.993,52 | 7,136 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 3.715.680,88 | 13,831 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -5.421.363,58 | -20,180 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -5.903.625,37 | -21,975 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -11.324.988,95 | -42,155 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -7.609.308,07 | -28,324 |

Entwicklung des Teisondervermögens

| | 2021 / 2022 |
|---|----------------------|
| | EUR |
| I. Wert des Teisondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | 46.522.692,09 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | -1.182.712,00 |
| 2. Mittelzufluss (netto) | 5.392.768,75 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 5.392.768,75 |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | 0,00 |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | -248.635,47 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | -7.609.308,07 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | -5.421.363,58 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -5.903.625,37 |
| II. Wert des Teisondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | 42.874.805,30 |

Verwendung der Erträge des Teisondervermögens

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 10.269.816,53 | 38,227 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 6.554.135,65 | 24,397 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 3.715.680,88 | 13,831 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 8.582.694,53 | 31,947 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 2.151.473,74 | 8,008 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 6.431.220,79 | 23,939 |
| III. Gesamtausschüttung | | 1.687.122,00 | 6,280 |
| 1. Endausschüttung | | 1.687.122,00 | 6,280 |

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Teisondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|--|-------------------|
| 2021/2022 | 42.874.805,30 | 159,59 |
| 2020/2021 | 46.522.692,09 | 195,1 |
| 2019/2020 | 34.557.898,72 | 155,81 |
| 2018/2019 | 31.172.569,36 | 166,25 |

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

| | | | |
|-----------------------------|---|------------|-----------------|
| | | EUR | DE000ETF9033 |
| Anteilwert | | | 159,59 |
| Umlaufende Anteile | | STK | 268.650 |
| Anleger | | | Private Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | % | | 5,00 |
| Aktueller Rücknahmeabschlag | % | | 5,00 |
| Verwaltungsvergütung p. a. | % | | 0,25 |
| Ertragsverwendung | | | ausschüttend |

Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)

99,94

Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

| | |
|--|------------------------|
| Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände | zum Nennwert |
| Verbindlichkeiten | zum Rückzahlungsbetrag |

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

CSDR Erträge 168,49

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagezinsen 307,94

Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB

0,25

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsondervermögens aus.

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwandsersatzungen, mit denen das jeweilige Teilsondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

| | | |
|--|-----|------------|
| Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF | | |
| Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut, vor Ertragsausgleich) | EUR | 113.847,37 |
| Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft | % | 35,05 |
| Davon für die Verwahrstelle | % | 23,25 |
| Davon für Dritte | % | 41,70 |

Transaktionskosten

EUR

2.585,45

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Lyxor Funds Solutions S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 76,02 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 34.899.608,88 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

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 für Indexfonds gem. §16 (2) KARBV

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilsondervermögens und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilsondervermögen erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilsondervermögens.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Der ETF hat eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums
Höhe der Annual Tracking Difference

0,48%
-0,66%

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Klassifizierung nach SFDR-Verordnung (EU 2019/2088)

Der Fonds ist ein Produkt im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene

Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor).

Erklärung gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852 vom 18. Juni 2020 (Taxonomie):

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Angaben zur Vergütung gemäß KAGB § 101 (4) 1.-5.:

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“) hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2022 überprüft.

Zum 1. Juli 2022 wurde die LFS auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Da dieser Bericht den Zeitraum zwischen dem 1. Januar 2022 und dem 30. Juni 2022 abdeckt, hat dies keine Auswirkungen auf diesen Jahresbericht.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA;
- im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.313 TEUR (92,40%) und der variable Teil 108 TEUR (7,60%). Die Gesamtvergütung betrug 1.421 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 17,07
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 36,40
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,30
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.742 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (36). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 275,24

Gemäß Kapitel 7 der ESMA Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31.03.2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an. Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- folgende Risk-Taker benannt hat: Mathias Turra, Martine Capus, Dr. Qi Chen und Martin Rausch (bis zum 29.04.2022)
- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW Instrumenten vornimmt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht anwendet.

Eine Änderung der Vergütungspolitik ist bis dato nicht erfolgt. Eine Überprüfung der Vergütungspolitik nach Art. 14b Abs. 1 Buchstabe c und d sowie ggf. eine Änderung derselben, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2022.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der EU-Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website <https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor> eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag:

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A..

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF I

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Teilsonderver- mögens |
|------------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 102.698.206,79 | 100,29 |
| 1. Aktien | | 97.780.372,34 | 95,49 |
| - Aeronautik und Weltraum | 2.316.674,80 | | 2,26 |
| - Audiovisuelle Industrie | 2.138.864,60 | | 2,09 |
| - Banken | 5.109.802,24 | | 4,99 |
| - Bau und Baustoffe | 2.870.898,80 | | 2,80 |
| - Bergbau | 3.338.406,78 | | 3,26 |
| - Büroausstattung | 3.157.402,89 | | 3,08 |
| - Chemische Industrie | 11.077.127,91 | | 10,82 |
| - Einzelhandel | 4.160.568,70 | | 4,06 |
| - Elektrik / Elektronik | 3.876.050,28 | | 3,79 |
| - Energieversorger | 2.345.639,26 | | 2,29 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 11.782.314,58 | | 11,51 |
| - Papier- und Verpackungsindustrie | 1.213.216,00 | | 1,18 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 5.463.356,60 | | 5,34 |
| - Real Estate | 9.024.811,28 | | 8,81 |
| - Software | 4.515.030,40 | | 4,41 |
| - Sonstige industrielle Werte | 2.601.221,58 | | 2,54 |
| - Sonstiges | 2.096.895,90 | | 2,05 |
| - Telekommunikation | 12.444.251,00 | | 12,15 |
| - Transportation | 3.647.029,52 | | 3,56 |
| - Unterhaltungsindustrie | 3.201.000,10 | | 3,13 |
| - Versicherungen | 1.399.809,12 | | 1,37 |
| 2. Forderungen | | 2.561.894,69 | 2,50 |
| 3. Bankguthaben | | 2.355.939,76 | 2,30 |
| II. Verbindlichkeiten | | -301.673,26 | -0,29 |
| III. Teilsondervermögen | | 102.396.533,53 | 100,00 ¹⁾ |

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF I

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Teilsonder- ver- mögens |
|---|--------------------------------|-------|--|-----------------------|-------------------|----------------------|-------------|----------------------|--|
| | | | | im Berichtszeitraum | | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | |
| DE000A0WMPJ6 | AIXTRON SE | | STK | 81.132 | 53.140 | 48.163 | EUR 24,180 | 1.961.771,76 | 1,92 |
| DE0006766504 | Aurubis AG | | STK | 21.818 | 13.542 | 13.774 | EUR 64,760 | 1.412.933,68 | 1,38 |
| DE0005158703 | Bechtle AG | | STK | 59.199 | 74.815 | 34.179 | EUR 39,010 | 2.309.352,99 | 2,26 |
| DE0005419105 | CANCOM SE | | STK | 26.419 | 17.693 | 17.878 | EUR 32,100 | 848.049,90 | 0,83 |
| DE0005313704 | Carl Zeiss Meditec AG | | STK | 26.424 | 17.332 | 15.765 | EUR 113,900 | 3.009.693,60 | 2,94 |
| DE000CBK1001 | Commerzbank AG | | STK | 764.254 | 520.782 | 432.790 | EUR 6,686 | 5.109.802,24 | 4,99 |
| DE0005470306 | CTS Eventim AG & Co. KGaA | | STK | 42.425 | 27.764 | 25.275 | EUR 50,000 | 2.121.250,00 | 2,07 |
| DE000A2E4K43 | Delivery Hero SE | | STK | 120.059 | 120.344 | 285 | EUR 35,770 | 4.294.510,43 | 4,19 |
| DE0008232125 | Deutsche Lufthansa AG | | STK | 655.469 | 642.212 | 328.058 | EUR 5,564 | 3.647.029,52 | 3,56 |
| DE000A0HN5C6 | Deutsche Wohnen SE | | STK | 35.571 | 41.647 | 6.076 | EUR 21,940 | 780.427,74 | 0,76 |
| DE0005565204 | Dürr AG | | STK | 35.191 | 22.769 | 21.016 | EUR 21,960 | 772.794,36 | 0,75 |
| DE0006095003 | ENCAVIS AG | | STK | 86.939 | 89.538 | 71.139 | EUR 17,475 | 1.519.259,03 | 1,48 |
| DE000EVNK013 | Evonik Industries AG | | STK | 148.254 | 101.941 | 83.926 | EUR 20,360 | 3.018.451,44 | 2,95 |
| DE0005664809 | Evotec SE | | STK | 106.681 | 72.572 | 58.526 | EUR 23,000 | 2.453.663,00 | 2,40 |
| DE0005773303 | Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG | | STK | 26.376 | 17.053 | 15.734 | EUR 41,500 | 1.094.604,00 | 1,07 |
| DE000A02ZZZ5 | freenet AG | | STK | 85.936 | 53.086 | 57.989 | EUR 23,670 | 2.034.105,12 | 1,99 |
| DE000A3E5D64 | Fuchs Petrolub SE | | STK | 50.252 | 78.648 | 28.396 | EUR 26,600 | 1.336.703,20 | 1,31 |
| DE0006602006 | GEA Group AG | | STK | 108.893 | 70.780 | 62.690 | EUR 32,890 | 3.581.490,77 | 3,50 |
| DE000A0LD6E6 | Gerresheimer AG | | STK | 19.568 | 12.882 | 12.525 | EUR 62,000 | 1.213.216,00 | 1,18 |
| DE000A1PHFF7 | HUGO BOSS AG | | STK | 42.020 | 27.788 | 22.854 | EUR 50,360 | 2.116.127,20 | 2,07 |
| DE0006219934 | Jungheinrich AG | | STK | 34.706 | 42.261 | 7.555 | EUR 20,800 | 721.884,80 | 0,70 |
| DE000KSAG888 | K+S Aktiengesellschaft | | STK | 138.391 | 90.653 | 82.447 | EUR 23,190 | 3.209.287,29 | 3,13 |
| DE000KGX8881 | KION GROUP AG | | STK | 51.871 | 33.952 | 30.876 | EUR 39,590 | 2.053.572,89 | 2,01 |
| DE000KBX1006 | Knorr-Bremse AG | | STK | 47.799 | 31.262 | 28.428 | EUR 54,420 | 2.601.221,58 | 2,54 |
| DE0005470405 | LANXESS AG | | STK | 59.111 | 38.645 | 35.142 | EUR 34,180 | 2.020.413,98 | 1,97 |
| DE000LEG1110 | LEG Immobilien SE | | STK | 52.667 | 34.899 | 31.270 | EUR 79,120 | 4.167.013,04 | 4,07 |
| DE0006452907 | Nemetschek SE | | STK | 40.445 | 30.516 | 28.118 | EUR 57,760 | 2.336.103,20 | 2,28 |
| DE000PSM7770 | ProSiebenSat.1 Media SE | | STK | 122.764 | 91.355 | 102.856 | EUR 8,810 | 1.081.550,84 | 1,06 |
| DE0007018003 | RATIONAL AG | | STK | 3.687 | 2.410 | 2.192 | EUR 554,500 | 2.044.441,50 | 2,00 |
| DE0007030009 | Rheinmetall AG | | STK | 10.516 | 20.561 | 39.427 | EUR 220,300 | 2.316.674,80 | 2,26 |
| DE000A12DM80 | Scout24 AG | | STK | 53.402 | 37.597 | 41.464 | EUR 48,990 | 2.616.163,98 | 2,55 |
| DE000ENER6Y0 | Siemens Energy AG | | STK | 332.683 | 364.951 | 32.268 | EUR 13,985 | 4.652.571,76 | 4,54 |
| DE000WAF3001 | Siltronic AG | | STK | 12.039 | 13.142 | 1.103 | EUR 70,900 | 853.565,10 | 0,83 |
| DE0007231326 | Sixt SE | | STK | 9.158 | 10.013 | 855 | EUR 97,850 | 896.110,30 | 0,88 |
| DE000A2GS401 | Software AG | | STK | 36.871 | 24.013 | 21.826 | EUR 31,620 | 1.165.861,02 | 1,14 |
| DE0007493991 | Ströer SE & Co. KGaA | | STK | 25.169 | 19.285 | 12.860 | EUR 42,900 | 1.079.750,10 | 1,05 |
| DE0008303504 | TAG Immobilien AG | | STK | 105.926 | 70.729 | 64.448 | EUR 10,890 | 1.153.534,14 | 1,13 |
| DE000TLX1005 | Talanx AG | | STK | 38.541 | 45.625 | 7.084 | EUR 36,320 | 1.399.809,12 | 1,37 |
| DE000A2YN900 | TeamViewer AG | | STK | 106.661 | 70.615 | 73.406 | EUR 9,498 | 1.013.066,18 | 0,99 |
| DE000A1J5RX9 | Telefónica Deutschland Hldg AG | | STK | 646.944 | 448.535 | 424.337 | EUR 2,740 | 1.772.626,56 | 1,73 |
| DE0007500001 | thyssenkrupp AG | | STK | 355.910 | 233.077 | 211.973 | EUR 5,410 | 1.925.473,10 | 1,88 |
| DE000UNSE018 | Uniper SE | | STK | 58.319 | 37.654 | 41.539 | EUR 14,170 | 826.380,23 | 0,81 |
| DE0005089031 | United Internet AG | | STK | 63.417 | 42.232 | 43.195 | EUR 27,230 | 1.726.844,91 | 1,69 |
| DE000A3H3LL2 | Vantage Towers AG | | STK | 66.778 | 83.918 | 17.140 | EUR 26,600 | 1.776.294,80 | 1,73 |
| DE000A0TGJ55 | VARTA AG | | STK | 13.403 | 8.810 | 7.644 | EUR 79,140 | 1.060.713,42 | 1,04 |
| DE000WCH8881 | Wacker Chemie AG | | STK | 10.845 | 7.208 | 6.565 | EUR 137,600 | 1.492.272,00 | 1,46 |
| | | | | | | | EUR | 92.598.436,62 | 90,43 |
| Ausland | | | | | | | | | |
| LU1673108939 | Aroundtown SA | | STK | 713.674 | 491.591 | 441.566 | EUR 3,033 | 2.164.573,24 | 2,11 |
| LU1704650164 | BEFESA S.A. | | STK | 25.879 | 31.515 | 5.636 | EUR 46,400 | 1.200.785,60 | 1,17 |
| LU0775917882 | Grand City Properties S.A. | | STK | 58.949 | 44.810 | 49.827 | EUR 12,880 | 759.263,12 | 0,74 |
| LU0061462528 | RTL Group S.A. | | STK | 26.539 | 30.835 | 4.296 | EUR 39,840 | 1.057.313,76 | 1,03 |
| | | | | | | | EUR | 5.181.935,72 | 5,06 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 97.780.372,34 | 95,49 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 2.355.939,76 | 2,30 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | EUR | 2.355.939,76 | | % | 100,000 | 2.355.939,76 | 2,30 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 2.561.894,69 | 2,50 |
| Forderungen Aktien | | | EUR | 2.330.554,78 | | | | 2.330.554,78 | 2,28 |
| Dividendenforderungen | | | EUR | 230.606,06 | | | | 230.606,06 | 0,23 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | | EUR | 733,85 | | | | 733,85 | 0,00 |

| | | | | | |
|--|-----|-------------|--|-----|----------------------|
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften | EUR | -213.623,16 | | EUR | -301.673,26 |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | EUR | -88.050,10 | | | -0,29 |
| | | | | | -0,21 |
| | | | | | -0,09 |
| Wert des Teilsondervermögens | | | | | |
| Anteilwert | | | | EUR | 102.396.533,53 |
| Umlaufende Anteile | | | | EUR | 135,48 |
| | | | | STK | 755.800 |
| | | | | | 100,00 ¹⁾ |

Fußnoten:

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 30.06.2022

Keine Fremdwährungskurse

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

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheinanleihen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-------------------------------------|---------------------------------------|---|-------------------|----------------------|---------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE000A0LD2U1 | alstria office REIT-AG | STK | 68.536 | 183.442 | |
| LU2353086064 | Aroundtown SA - Anrechte | STK | 0 | 0 | |
| DE000A2LQ884 | AUTO1 Group SE | STK | 43.344 | 114.643 | |
| DE0005200000 | Beiersdorf AG | STK | 110.021 | 176.577 | |
| DE000A1DAHH0 | Brenntag SE | STK | 3.708 | 108.795 | |
| DE000A288904 | CompuGroup Medical SE & Co.KGaA | STK | 10.822 | 28.420 | |
| DE000DTR0CK8 | Daimler Truck Holding AG | STK | 317.109 | 317.109 | |
| DE000A3E5B58 | Deutsche Lufthansa AG - Anrechte | STK | 214.372 | 214.372 | |
| DE000A3E5AN9 | ENCAVIS AG - Anrechte | STK | 0 | 69.651 | |
| DE0005790430 | FUCHS PETROLUB SE | STK | 0 | 47.272 | |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | STK | 25.115 | 65.948 | |
| DE000A13SX22 | HELLA GmbH & Co. KGaA | STK | 18.490 | 48.720 | |
| DE000A161408 | HelloFresh SE | STK | 4.165 | 122.210 | |
| DE0006070006 | HOCHTIEF AG | STK | 512 | 15.029 | |
| DE0005493365 | Hypoport SE | STK | 3.432 | 3.432 | |
| DE0006632003 | MorphoSys AG | STK | 788 | 23.088 | |
| DE000A0D6554 | Nordex SE | STK | 5.566 | 58.964 | |
| DE000A3E5CX4 | Nordex SE - Anrechte | STK | 43.616 | 43.616 | |
| DE000PAH0038 | Porsche Automobil Holding SE | STK | 6.240 | 110.392 | |
| DE0006969603 | PUMA SE | STK | 2.199 | 64.531 | |
| DE0007165631 | Sartorius AG | STK | 591 | 17.325 | |
| DE000SHL1006 | Siemens Healthineers AG | STK | 6.674 | 195.798 | |
| DE000SYM9999 | Symrise AG | STK | 2.917 | 85.598 | |
| DE000ZAL1111 | Zalando SE | STK | 4.239 | 124.386 | |
| DE0005111702 | zooplus AG | STK | 5.159 | 5.159 | |
| Ausland | | | | | |
| NL0000235190 | Airbus SE | STK | 7.119 | 208.884 | |
| LU2356307962 | Grand City Properties S.A. - Anrechte | STK | 66.365 | 66.365 | |
| DE000LEG1243 | LEG Immobilien SE - Anrechte | STK | 52.394 | 52.394 | |
| NL0012169213 | Qiagen N.V. | STK | 5.487 | 160.984 | |
| NL0012044747 | Shop Apotheke Europe N.V. | STK | 320 | 9.403 | |

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2021 bis zum 30.06.2022

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|-----------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 2.289.041,59 | 3,029 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 387.657,35 | 0,513 |
| 3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -249.097,81 | -0,330 |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -76.916,46 | -0,102 |
| 5. Sonstige Erträge | | 122,13 | 0,000 |
| Summe der Erträge | | 2.350.806,80 | 3,110 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme | | -45,46 | 0,000 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -394.287,39 | -0,522 |
| 3. Sonstige Aufwendungen | | -783,51 | -0,001 |
| davon: Verwahrtgelt | -783,51 | | -0,001 |
| Summe der Aufwendungen | | -395.116,36 | -0,523 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 1.955.690,44 | 2,588 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 38.320.735,55 | 50,702 |
| 2. Realisierte Verluste | | -13.124.815,89 | -17,365 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 25.195.919,66 | 33,337 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 27.151.610,10 | 35,924 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -31.955.334,62 | -42,280 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -28.969.778,35 | -38,330 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -60.925.112,97 | -80,610 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -33.773.502,87 | -44,686 |

Entwicklung des Teisondervermögens

| | 2021 / 2022 |
|---|-----------------------|
| | EUR |
| I. Wert des Teisondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | 227.873.639,99 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | -1.437.711,00 |
| 2. Mittelzufluss (netto) | -93.804.582,87 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 13.736.224,42 |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -107.540.807,29 |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | 3.538.690,28 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | -33.773.502,87 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | -31.955.334,62 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -28.969.778,35 |
| II. Wert des Teisondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | 102.396.533,53 |

Verwendung der Erträge des Teisondervermögens

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 33.815.238,51 | 44,741 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 6.663.628,41 | 8,817 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 27.151.610,10 | 35,924 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 32.092.014,51 | 42,461 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 16.732.534,49 | 22,139 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 15.359.480,02 | 20,322 |
| III. Gesamtausschüttung | | 1.723.224,00 | 2,280 |
| 1. Endausschüttung | | 1.723.224,00 | 2,280 |

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Teisonder- vermögens am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|--|-------------------|
| 2021/2022 | 102.396.533,53 | 135,48 |
| 2020/2021 | 227.873.639,99 | 180,69 |
| 2019/2020 | 107.645.218,05 | 139,02 |
| 2018/2019 | 91.953.133,11 | 140,89 |

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF I

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9074

Anteilwert

EUR

135,48

Umlaufende Anteile

STK

755.800

Anleger

Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

5,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

5,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

0,30

Ertragsverwendung

ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)

95,49

Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände

zum Nennwert

Verbindlichkeiten

zum Rückzahlungsbetrag

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

CSDR Erträge

121,04

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagezinsen

863,80

Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB

0,30

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsondervermögens aus.

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendererstattungen, mit denen das jeweilige Teilsondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl.

Ertragsausgleich

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut, vor Ertragsausgleich)

EUR

465.519,04

Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft

%

46,85

Davon für die Verwahrstelle

%

18,12

Davon für Dritte

%

35,03

Transaktionskosten

EUR

23.116,43

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Lyxor Funds Solutions S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 85,35 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 376.104.865,33 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

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 für Indexfonds gem. §16 (2) KARBV

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilsondervermögen und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilsondervermögen erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilsondervermögens.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Der ETF hat eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums
Höhe der Annual Tracking Difference

0,33%
0,30%

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Klassifizierung nach SFDR-Verordnung (EU 2019/2088)

Der Fonds ist ein Produkt im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene

Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor).

Erklärung gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852 vom 18. Juni 2020 (Taxonomie):

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Angaben zur Vergütung gemäß KAGB § 101 (4) 1.-5.:

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“) hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2022 überprüft.

Zum 1. Juli 2022 wurde die LFS auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Da dieser Bericht den Zeitraum zwischen dem 1. Januar 2022 und dem 30. Juni 2022 abdeckt, hat dies keine Auswirkungen auf diesen Jahresbericht.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA;
- im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.313 TEUR (92,40%) und der variable Teil 108 TEUR (7,60%). Die Gesamtvergütung betrug 1.421 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 17,07
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 36,40
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,30
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.742 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (36). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 275,24

Gemäß Kapitel 7 der ESMA Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31.03.2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an. Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- folgende Risk-Taker benannt hat: Mathias Turra, Martine Capus, Dr. Qi Chen und Martin Rausch (bis zum 29.04.2022)
- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW Instrumenten vornimmt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht anwendet.

Eine Änderung der Vergütungspolitik ist bis dato nicht erfolgt. Eine Überprüfung der Vergütungspolitik nach Art. 14b Abs. 1 Buchstabe c und d sowie ggf. eine Änderung derselbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2022.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der EU-Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website <https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor> eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag:

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A..

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Teilsonderver- mögens |
|-----------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 22.565.079,17 | 100,05 |
| 1. Aktien | | 22.499.785,40 | 99,76 |
| - Aeronautik und Weltraum | 781.747,89 | | 3,47 |
| - Banken | 1.687.105,72 | | 7,48 |
| - Bau und Baustoffe | 638.483,16 | | 2,83 |
| - Chemische Industrie | 2.109.154,33 | | 9,35 |
| - Einzelhandel | 209.012,79 | | 0,93 |
| - Elektrik / Elektronik | 2.436.707,79 | | 10,80 |
| - Energieversorger | 2.252.887,47 | | 9,99 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 1.178.017,59 | | 5,22 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 2.677.080,64 | | 11,87 |
| - Real Estate | 183.691,20 | | 0,81 |
| - Software | 825.574,21 | | 3,66 |
| - Sonstige Finanzdienstleistungen | 264.138,00 | | 1,17 |
| - Sonstige industrielle Werte | 634.871,51 | | 2,81 |
| - Sonstiges | 345.612,00 | | 1,53 |
| - Telekommunikation | 1.058.502,24 | | 4,69 |
| - Textilien und Kleidung | 2.233.311,74 | | 9,90 |
| - Transportation | 306.720,68 | | 1,36 |
| - Unterhaltungsindustrie | 147.710,88 | | 0,65 |
| - Verbrauchsgüter | 1.235.331,62 | | 5,48 |
| - Versicherungen | 1.294.123,94 | | 5,74 |
| 2. Forderungen | | 27.902,75 | 0,12 |
| 3. Bankguthaben | | 37.391,02 | 0,17 |
| II. Verbindlichkeiten | | -10.325,08 | -0,05 |
| III. Teilsondervermögen | | 22.554.754,09 | 100,00 ¹⁾ |

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Teilsonder ver- mögens |
|---|--------------------------------|-------|----------------------------|-----------------------|---------------------|----------------------|---------------|----------------------|---------------------------------------|
| | | | Whg. in 1.000 | | im Berichtszeitraum | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | |
| DE000A1EWWW0 | adidas AG | | STK | 1.554 | 52 | 725 | EUR 168,760 | 262.253,04 | 1,16 |
| DE0008404005 | Allianz SE | | STK | 3.558 | 125 | 1.485 | EUR 182,120 | 647.982,96 | 2,87 |
| DE000BASF111 | BASF SE | | STK | 8.001 | 282 | 3.237 | EUR 41,525 | 332.241,53 | 1,47 |
| DE000BAY0017 | Bayer AG | | STK | 8.558 | 303 | 3.463 | EUR 56,720 | 485.409,76 | 2,15 |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke AG | | STK | 2.791 | 94 | 1.125 | EUR 73,460 | 205.026,86 | 0,91 |
| DE0007100000 | Daimler AG | | STK | 6.849 | 226 | 3.390 | EUR 55,220 | 378.201,78 | 1,68 |
| DE0005810055 | Deutsche Börse AG | | STK | 1.655 | 61 | 672 | EUR 159,600 | 264.138,00 | 1,17 |
| DE0005552004 | Deutsche Post AG | | STK | 8.582 | 305 | 3.474 | EUR 35,740 | 306.720,68 | 1,36 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | | STK | 30.206 | 3.048 | 11.519 | EUR 18,946 | 572.282,88 | 2,54 |
| DE0006231004 | Infineon Technologies AG | | STK | 11.376 | 407 | 4.608 | EUR 23,090 | 262.671,84 | 1,16 |
| DE0008430026 | Münchener Rückvers.-Ges. AG | | STK | 1.220 | 43 | 494 | EUR 224,200 | 273.524,00 | 1,21 |
| DE0007164600 | SAP SE | | STK | 9.497 | 314 | 3.845 | EUR 86,930 | 825.574,21 | 3,66 |
| DE0007236101 | Siemens AG | | STK | 6.539 | 228 | 2.612 | EUR 97,090 | 634.871,51 | 2,81 |
| DE0007664039 | Volkswagen AG | | STK | 1.595 | 60 | 649 | EUR 127,420 | 203.234,90 | 0,90 |
| DE000A1ML7J1 | Vonovia SE | | STK | 6.248 | 2.389 | 2.579 | EUR 29,400 | 183.691,20 | 0,81 |
| | | | | | | | EUR | 5.837.825,15 | 25,88 |
| Ausland | | | | | | | | | |
| NL0012969182 | Adyen N.V. | | STK | 249 | 14 | 99 | EUR 1.388,000 | 345.612,00 | 1,53 |
| NL0011794037 | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. | | STK | 9.109 | 341 | 3.705 | EUR 24,860 | 226.449,74 | 1,00 |
| FR0000120073 | Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. | | STK | 4.555 | 573 | 1.669 | EUR 128,120 | 583.586,60 | 2,59 |
| NL0000235190 | Airbus SE | | STK | 5.089 | 187 | 2.042 | EUR 92,450 | 470.478,05 | 2,09 |
| BE0974293251 | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. | | STK | 7.769 | 642 | 2.975 | EUR 51,360 | 399.015,84 | 1,77 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. | | STK | 3.541 | 110 | 1.573 | EUR 455,850 | 1.614.164,85 | 7,16 |
| FR0000120628 | AXA S.A. | | STK | 17.203 | 548 | 7.886 | EUR 21,660 | 372.616,98 | 1,65 |
| ES0113211835 | Banco Bilbao Vizcaya Argent. | | STK | 53.977 | 80.647 | 26.670 | EUR 4,331 | 233.747,40 | 1,04 |
| ES0113900J37 | Banco Santander S.A. | | STK | 148.788 | 4.409 | 62.458 | EUR 2,688 | 399.942,14 | 1,77 |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. | | STK | 9.911 | 287 | 4.131 | EUR 45,365 | 449.612,52 | 1,99 |
| IE0001827041 | CRH PLC | | STK | 6.743 | 202 | 2.943 | EUR 33,000 | 222.519,00 | 0,99 |
| FR0000120644 | Danone S.A. | | STK | 5.569 | 169 | 2.351 | EUR 53,260 | 296.604,94 | 1,32 |
| IT0003128367 | ENEL S.p.A. | | STK | 67.669 | 2.386 | 27.377 | EUR 5,220 | 353.232,18 | 1,57 |
| IT0003132476 | ENI S.p.A. | | STK | 21.882 | 769 | 8.850 | EUR 11,328 | 247.879,30 | 1,10 |
| FR0000121667 | EssilorLuxottica S.A. | | STK | 2.617 | 120 | 1.060 | EUR 142,900 | 373.969,30 | 1,66 |
| IE00BWT6H894 | Flutter Entertainment PLC | | STK | 1.531 | 130 | 601 | EUR 96,480 | 147.710,88 | 0,65 |
| FR0000052292 | Hermes International S.C.A. | | STK | 307 | 398 | 91 | EUR 1.067,000 | 327.569,00 | 1,45 |
| ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. | | STK | 51.204 | 5.215 | 23.913 | EUR 9,896 | 506.714,78 | 2,25 |
| ES0148396007 | Industria de Diseño Textil SA | | STK | 9.681 | 324 | 3.900 | EUR 21,590 | 209.012,79 | 0,93 |
| NL0011821202 | ING Groep N.V. | | STK | 34.033 | 1.282 | 13.797 | EUR 9,431 | 320.965,22 | 1,42 |
| IT0000072618 | Intesa Sanpaolo S.p.A. | | STK | 158.898 | 5.573 | 64.255 | EUR 1,780 | 282.838,44 | 1,25 |
| FR0000121485 | Kering S.A. | | STK | 633 | 19 | 260 | EUR 490,100 | 310.233,30 | 1,38 |
| FI0009013403 | KONE Oyj | | STK | 3.502 | 106 | 1.427 | EUR 45,360 | 158.850,72 | 0,70 |
| NL0000009538 | Koninklijke Philips N.V. | | STK | 7.700 | 240 | 3.407 | EUR 20,555 | 158.273,50 | 0,70 |
| IE00BZ12WP82 | Linde PLC | | STK | 4.356 | 119 | 1.958 | EUR 273,950 | 1.193.326,20 | 5,29 |
| FR0000121014 | LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE | | STK | 2.292 | 75 | 945 | EUR 581,700 | 1.333.256,40 | 5,91 |
| FR0000120321 | Oréal S.A., L' | | STK | 2.116 | 76 | 883 | EUR 329,300 | 696.798,80 | 3,09 |
| FR0000120693 | Pernod-Ricard S.A. | | STK | 1.787 | 59 | 719 | EUR 175,300 | 313.261,10 | 1,39 |
| NL0013654783 | Prosus N.V. | | STK | 7.782 | 5.824 | 3.346 | EUR 62,480 | 486.219,36 | 2,16 |
| FR0000073272 | SAFRAN | | STK | 3.304 | 113 | 1.333 | EUR 94,210 | 311.269,84 | 1,38 |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. | | STK | 9.992 | 366 | 4.002 | EUR 96,340 | 962.629,28 | 4,27 |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE | | STK | 4.959 | 172 | 1.977 | EUR 112,900 | 559.871,10 | 2,48 |
| NL00150001Q9 | Stellantis N.V. | | STK | 19.734 | 27.032 | 7.298 | EUR 11,792 | 232.703,33 | 1,03 |
| FR0000120271 | TotalEnergies SE | | STK | 22.733 | 706 | 9.341 | EUR 50,370 | 1.145.061,21 | 5,08 |
| FR0000125486 | VINCI S.A. | | STK | 4.896 | 147 | 2.307 | EUR 84,960 | 415.964,16 | 1,84 |
| | | | | | | | EUR | 16.661.960,25 | 73,87 |
| | | | | | | | EUR | 22.499.785,40 | 99,76 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | | |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | | |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | | | | | | | |
| | | | EUR | 37.391,02 | | | % 100,000 | 37.391,02 | 0,17 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | |
| Dividendenforderungen | | | | | | | | | |
| | | | EUR | 15.003,78 | | | | 15.003,78 | 0,07 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | | | | | | | | |
| | | | EUR | 12.898,97 | | | | 12.898,97 | 0,06 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | | | | | | | | | |
| | | | EUR | -10.325,08 | | | | -10.325,08 | -0,05 |
| Wert des Teilsondervermögens | | | | | | | | | |
| Anteilwert | | | | | | | | | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | | | | |
| | | | | | | | EUR | 22.554.754,09 | 100,00 ¹⁾ |
| | | | | | | | EUR | 35,93 | |
| | | | | | | | STK | 627,800 | |

Fußnoten:

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 30.06.2022

Keine Fremdwährungskurse

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

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------|----------------------|---------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE000DTR0CK8 | Daimler Truck Holding AG | STK | 4.682 | 4.682 | |
| DE000A3MQB30 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 0 | 0 | |
| DE000A3MQQ33 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 6.908 | 6.908 | |
| Ausland | | | | | |
| ES0109067019 | Amadeus IT Group S.A. | STK | 0 | 5.373 | |
| FR0010208488 | Engie S.A. | STK | 0 | 22.181 | |
| FR0014002ZS9 | EssilorLuxottica S.A. - Anrechte | STK | 0 | 3.249 | |
| FR0014009LO3 | EssilorLuxottica S.A. - Anrechte | STK | 2.621 | 2.621 | |
| FR0014008VX5 | EuroAPI SAS | STK | 494 | 494 | |
| ES06445809N8 | Iberdrola S.A - Anrechte | STK | 0 | 0 | |
| ES0144583244 | Iberdrola S.A. | STK | 0 | 0 | |
| ES0144583251 | Iberdrola S.A. | STK | 0 | 0 | |
| ES06445809M0 | Iberdrola S.A. - Anrechte | STK | 0 | 0 | |
| NL0015000VF4 | Koninklijke Philips N.V. - Anrechte | STK | 8.791 | 8.791 | |
| NL0015000LD0 | Prosus N.V. - Anrechte | STK | 10.573 | 10.573 | |
| NL0015000IY2 | Universal Music Group N.V. | STK | 9.270 | 9.270 | |
| FR0000127771 | Vivendi S.A. | STK | 191 | 9.270 | |

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2021 bis zum 30.06.2022

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 271.644,97 | 0,433 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 536.948,97 | 0,855 |
| 3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -36.435,20 | -0,058 |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -24.194,75 | -0,039 |
| 5. Sonstige Erträge | | 15,94 | 0,000 |
| Summe der Erträge | | 747.979,93 | 1,191 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme | | -39,93 | 0,000 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -38.604,83 | -0,061 |
| 3. Sonstige Aufwendungen | | -127,83 | 0,000 |
| davon: Verwahrentgelt | -127,83 | | 0,000 |
| Summe der Aufwendungen | | -38.772,59 | -0,062 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 709.207,34 | 1,130 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 2.237.068,47 | 3,563 |
| 2. Realisierte Verluste | | -688.388,87 | -1,097 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 1.548.679,60 | 2,467 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 2.257.886,94 | 3,597 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -4.782.036,04 | -7,617 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -1.235.421,05 | -1,968 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -6.017.457,09 | -9,585 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -3.759.570,15 | -5,988 |

Entwicklung des Teisondervermögens

| | 2021 / 2022 |
|---|----------------------|
| | EUR |
| I. Wert des Teisondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | 35.594.600,16 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | -607.250,00 |
| 2. Mittelzufluss (netto) | -9.094.478,03 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 1.027.928,62 |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -10.122.406,65 |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | 421.452,11 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | -3.759.570,15 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | -4.782.036,04 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -1.235.421,05 |
| II. Wert des Teisondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | 22.554.754,09 |

Verwendung der Erträge des Teisondervermögens

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|---------------------|--------------------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 5.061.183,86 | 8,062 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 2.803.296,92 | 4,465 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 2.257.886,94 | 3,597 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 4.439.661,86 | 7,072 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 1.056.448,75 | 1,683 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 3.383.213,11 | 5,389 |
| III. Gesamtausschüttung | | 621.522,00 | 0,990 |
| 1. Endausschüttung | | 621.522,00 | 0,990 |

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Teisonder- vermögens am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|--|-------------------|
| 2021/2022 | 22.554.754,09 | 35,93 |
| 2020/2021 | 35.594.600,16 | 41,68 |
| 2019/2020 | 36.328.112,78 | 33,17 |
| 2018/2019 | 35.367.583,36 | 35,91 |

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9504

| | | |
|-----------------------------|------------|-----------------|
| Anteilwert | EUR | 35,93 |
| Umlaufende Anteile | STK | 627.800 |
| Anleger | | Private Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | % | 5,00 |
| Aktueller Rücknahmeabschlag | % | 5,00 |
| Verwaltungsvergütung p. a. | % | 0,15 |
| Ertragsverwendung | | ausschüttend |

| | |
|---|--------------|
| Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %) | 99,76 |
| Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %) | 0,00 |

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

| | |
|--|------------------------|
| Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände | zum Nennwert |
| Verbindlichkeiten | zum Rückzahlungsbetrag |

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

| | |
|--------------|-------|
| CSDR Erträge | 16,27 |
|--------------|-------|

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

| | |
|------------------------|--------|
| Negative Einlagezinsen | 155,94 |
|------------------------|--------|

| | |
|---|-------------|
| Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB | 0,15 |
|---|-------------|

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsondervermögens aus.

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwandsersatzungen, mit denen das jeweilige Teilsondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

| | | |
|--|-----|-----------|
| Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF | | |
| Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut, vor Ertragsausgleich) | EUR | 50.091,55 |
| Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft | % | -21,46 |
| Davon für die Verwahrstelle | % | 51,72 |
| Davon für Dritte | % | 69,74 |

| | | |
|---------------------------|------------|-----------------|
| Transaktionskosten | EUR | 5.446,23 |
|---------------------------|------------|-----------------|

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Lyxor Funds Solutions S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 45,18 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 14.487.186,27 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

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 für Indexfonds gem. §16 (2) KARBV

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilsondervermögens und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilsondervermögen erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilsondervermögens.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Der ETF hat eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums
Höhe der Annual Tracking Difference

0,22%
0,46%

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Angaben zur Vergütung gemäß KAGB § 101 (4) 1.-5.:

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“) hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2022 überprüft.

Zum 1. Juli 2022 wurde die LFS auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Da dieser Bericht den Zeitraum zwischen dem 1. Januar 2022 und dem 30. Juni 2022 abdeckt, hat dies keine Auswirkungen auf diesen Jahresbericht.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA;
- im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.313 TEUR (92,40%) und der variable Teil 108 TEUR (7,60%). Die Gesamtvergütung betrug 1.421 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 17,07
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 36,40
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,30
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.742 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (36). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 275,24

Gemäß Kapitel 7 der ESMA Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31.03.2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an. Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- folgende Risk-Taker benannt hat: Mathias Turra, Martine Capus, Dr. Qi Chen und Martin Rausch (bis zum 29.04.2022)
- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW Instrumenten vornimmt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht anwendet.

Eine Änderung der Vergütungspolitik ist bis dato nicht erfolgt. Eine Überprüfung der Vergütungspolitik nach Art. 14b Abs. 1 Buchstabe c und d sowie ggf. eine Änderung derselben, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2022.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der EU-Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website <https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor> eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag:

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A.. Das Teilsondervermögen wird mit Wirkung zum 13. September 2022 aufgelöst.

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Teilsonderver- mögens |
|-----------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 13.621.689,09 | 100,21 |
| 1. Aktien | | 13.593.407,20 | 100,00 |
| - Banken | 339.553,50 | | 2,50 |
| - Bau und Baustoffe | 699.082,09 | | 5,14 |
| - Bergbau | 317.514,49 | | 2,34 |
| - Büroausstattung | 1.012.558,40 | | 7,45 |
| - Chemische Industrie | 165.714,50 | | 1,22 |
| - Einzelhandel | 1.246.442,36 | | 9,17 |
| - Elektrik / Elektronik | 685.753,14 | | 5,04 |
| - Energieversorger | 406.034,24 | | 2,99 |
| - Landwirtschaft und Fischerei | 161.036,10 | | 1,18 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 2.478.353,83 | | 18,23 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 1.243.303,91 | | 9,15 |
| - Real Estate | 995.162,82 | | 7,32 |
| - Software | 884.720,71 | | 6,51 |
| - Sonstige Finanzdienstleistungen | 544.740,22 | | 4,01 |
| - Sonstige industrielle Werte | 334.417,50 | | 2,46 |
| - Sonstiges | 414.302,60 | | 3,05 |
| - Telekommunikation | 930.188,09 | | 6,84 |
| - Unterhaltungsindustrie | 159.937,50 | | 1,18 |
| - Verbrauchsgüter | 574.591,20 | | 4,23 |
| 2. Forderungen | | 11.145,33 | 0,08 |
| 3. Bankguthaben | | 17.136,56 | 0,13 |
| II. Verbindlichkeiten | | -28.733,56 | -0,21 |
| III. Teilsondervermögen | | 13.592.955,53 | 100,00 ¹⁾ |

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Teilsonder ver- mögens |
|-------------------------------------|----------------------------------|-------|----------------------------|-----------------------|---------------------|----------------------|-------------|----------------------|---------------------------------------|
| | | | Whg. in 1.000 | | im Berichtszeitraum | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | |
| DE0005545503 | 1&1 AG | | STK | 11.143 | 2.524 | 3.803 | EUR 18,000 | 200.574,00 | 1,48 |
| DE0005408116 | Aareal Bank AG | | STK | 4.471 | 3.227 | 14.945 | EUR 28,580 | 127.781,18 | 0,94 |
| DE000A3CNK42 | ABOUT YOU Holding SE | | STK | 10.874 | 13.829 | 2.955 | EUR 6,820 | 74.160,68 | 0,55 |
| DE000A0Z23Q5 | adesso SE | | STK | 921 | 1.035 | 114 | EUR 146,400 | 134.834,40 | 0,99 |
| DE000A3MQBT1 | ADVA Optical Networking SE | | STK | 9.994 | 13.852 | 3.858 | EUR 13,000 | 129.922,00 | 0,96 |
| DE0005093108 | AMADEUS FIRE AG | | STK | 1.581 | 394 | 346 | EUR 119,000 | 188.139,00 | 1,38 |
| DE0005104400 | ATOSS Software AG | | STK | 1.142 | 1.387 | 245 | EUR 121,000 | 138.182,00 | 1,02 |
| DE000A2LQ884 | AUTO1 Group SE | | STK | 30.938 | 35.168 | 4.230 | EUR 6,985 | 216.101,93 | 1,59 |
| DE0005102008 | Basler AG | | STK | 1.150 | 1.394 | 244 | EUR 76,500 | 87.975,00 | 0,65 |
| DE0005194062 | BayWa AG | | STK | 3.807 | 946 | 968 | EUR 42,300 | 161.036,10 | 1,18 |
| DE0005909006 | Bilfinger SE | | STK | 7.313 | 5.874 | 5.365 | EUR 27,880 | 203.886,44 | 1,50 |
| DE0007257503 | CECONOMY AG | | STK | 53.520 | 17.267 | 11.801 | EUR 2,660 | 142.363,20 | 1,05 |
| DE0005403901 | CEWE Stiftung & Co. KGaA | | STK | 1.518 | 336 | 336 | EUR 80,500 | 122.199,00 | 0,90 |
| DE000A288904 | CompuGroup Medical SE & Co. KGaA | | STK | 7.467 | 8.414 | 947 | EUR 40,640 | 303.458,88 | 2,23 |
| DE000A2GS5D8 | Dermapharm Holding SE | | STK | 5.538 | 1.367 | 1.270 | EUR 47,500 | 263.055,00 | 1,94 |
| DE0007480204 | Deutsche EuroShop AG | | STK | 14.540 | 3.692 | 3.283 | EUR 22,200 | 322.788,00 | 2,37 |
| DE0008019001 | Deutsche Pfandbriefbank AG | | STK | 39.575 | 13.946 | 12.757 | EUR 8,580 | 339.553,50 | 2,50 |
| DE0006305006 | DEUTZ AG | | STK | 33.790 | 8.395 | 9.105 | EUR 3,682 | 124.414,78 | 0,92 |
| DE000A1X3XX4 | DIC Asset AG | | STK | 11.266 | 3.130 | 2.470 | EUR 10,540 | 118.743,64 | 0,87 |
| DE0005550636 | Drägerwerk AG & Co. KGaA | | STK | 2.531 | 617 | 541 | EUR 49,650 | 125.664,15 | 0,92 |
| DE000DWS1007 | DWS Group GmbH & Co. KGaA | | STK | 9.129 | 2.585 | 2.311 | EUR 24,960 | 227.859,84 | 1,68 |
| DE0005659700 | Eckert & Ziegler Str.-u.Med.AG | | STK | 4.180 | 1.053 | 914 | EUR 36,420 | 152.235,60 | 1,12 |
| DE0005772206 | Fielmann AG | | STK | 7.011 | 1.755 | 1.539 | EUR 47,500 | 333.022,50 | 2,45 |
| DE000FTG1111 | flatexDEGIRO AG | | STK | 21.746 | 21.962 | 4.376 | EUR 9,080 | 197.453,68 | 1,45 |
| DE0005800601 | GFT Technologies SE | | STK | 4.969 | 5.689 | 720 | EUR 37,850 | 188.076,65 | 1,38 |
| DE000A161N30 | GRENKE AG | | STK | 8.095 | 2.053 | 1.810 | EUR 23,360 | 189.099,20 | 1,39 |
| DE000A3H2333 | HAMBORNER REIT AG | | STK | 20.870 | 5.142 | 5.123 | EUR 8,540 | 178.229,80 | 1,31 |
| DE0007314007 | Heidelberger Druckmaschinen AG | | STK | 75.161 | 85.539 | 10.378 | EUR 1,425 | 107.104,43 | 0,79 |
| DE000A13SX22 | HELLA GmbH & Co. KGaA | | STK | 6.324 | 7.164 | 840 | EUR 64,350 | 406.949,40 | 2,99 |
| DE000HAG0005 | HENSOLDT AG | | STK | 15.388 | 15.824 | 10.015 | EUR 24,100 | 370.850,80 | 2,73 |
| DE0006070006 | HOCHTIEF AG | | STK | 8.341 | 9.749 | 1.408 | EUR 46,450 | 387.439,45 | 2,85 |
| DE0006083405 | Hornbach Holding AG&Co.KGaA | | STK | 2.469 | 623 | 645 | EUR 78,400 | 193.569,60 | 1,42 |
| DE0005493365 | Hypoport SE | | STK | 1.196 | 1.196 | 1.159 | EUR 189,100 | 226.163,60 | 1,66 |
| DE0006200108 | INDUS Holding AG | | STK | 6.067 | 1.496 | 1.347 | EUR 22,200 | 134.687,40 | 0,99 |
| DE000A2NBX80 | Instone Real Estate Group AG | | STK | 13.641 | 3.726 | 3.498 | EUR 11,320 | 154.416,12 | 1,14 |
| DE000A2NB601 | JENOPTIK AG | | STK | 14.992 | 3.790 | 3.339 | EUR 21,280 | 319.029,76 | 2,35 |
| DE000JST4000 | JOST Werke AG | | STK | 3.726 | 967 | 1.046 | EUR 35,600 | 132.645,60 | 0,98 |
| DE000KC01000 | Klöckner & Co SE | | STK | 21.943 | 6.836 | 6.177 | EUR 7,270 | 159.525,61 | 1,17 |
| DE0006335003 | KRONES AG | | STK | 3.909 | 985 | 861 | EUR 72,800 | 284.575,20 | 2,09 |
| DE0007074007 | KWS SAAT SE & Co. KGaA | | STK | 2.933 | 683 | 683 | EUR 56,500 | 165.714,50 | 1,22 |
| DE000A1MMCC8 | Medios AG | | STK | 4.362 | 4.362 | 3.295 | EUR 26,200 | 114.284,40 | 0,84 |
| DE000BFB0019 | METRO AG | | STK | 37.580 | 9.416 | 9.192 | EUR 8,050 | 302.519,00 | 2,23 |
| DE0006632003 | MorphoSys AG | | STK | 10.051 | 12.277 | 2.226 | EUR 18,775 | 188.707,53 | 1,39 |
| DE000A3H2200 | Nagarro SE | | STK | 2.308 | 887 | 472 | EUR 108,400 | 250.187,20 | 1,84 |
| DE000NWRK013 | New Work SE | | STK | 827 | 216 | 187 | EUR 135,400 | 111.975,80 | 0,82 |
| DE000A1H8BV3 | NORMA Group SE | | STK | 9.377 | 2.424 | 2.142 | EUR 21,300 | 199.730,10 | 1,47 |
| DE000PAT1AG3 | PATRIZIA AG | | STK | 11.966 | 2.905 | 2.823 | EUR 11,280 | 134.976,48 | 0,99 |
| DE0006916604 | Pfeiffer Vacuum Technology AG | | STK | 1.076 | 235 | 279 | EUR 150,000 | 161.400,00 | 1,19 |
| DE000A0JBP2 | PNE AG | | STK | 9.658 | 9.658 | 0 | EUR 13,280 | 128.258,24 | 0,94 |
| DE0007461006 | PVA TePla AG | | STK | 5.505 | 6.678 | 1.173 | EUR 18,280 | 100.631,40 | 0,74 |
| DE000SAFH001 | SAF-HOLLAND SE | | STK | 13.359 | 3.402 | 3.001 | EUR 6,320 | 84.428,88 | 0,62 |
| DE0006202005 | Salzgitter AG | | STK | 6.804 | 1.743 | 4.117 | EUR 23,220 | 157.988,88 | 1,16 |
| DE000SHA0159 | Schaeffler AG | | STK | 36.639 | 11.586 | 10.485 | EUR 5,400 | 197.850,60 | 1,46 |
| DE0007276503 | secunet Security Networks AG | | STK | 467 | 571 | 104 | EUR 282,500 | 131.927,50 | 0,97 |
| DE000A0DJ6J9 | SMA Solar Technology AG | | STK | 5.531 | 1.385 | 1.219 | EUR 38,740 | 214.270,94 | 1,58 |
| DE0007274136 | Sto SE & Co. KGaA | | STK | 773 | 932 | 159 | EUR 139,400 | 107.756,20 | 0,79 |
| DE000STRA555 | STRATEC SE | | STK | 2.122 | 534 | 465 | EUR 87,200 | 185.038,40 | 1,36 |
| DE0007297004 | Südzucker AG | | STK | 17.690 | 4.215 | 4.342 | EUR 15,380 | 272.072,20 | 2,00 |
| DE000A2TSL71 | SYNLAB AG | | STK | 12.903 | 17.655 | 4.752 | EUR 16,610 | 214.318,83 | 1,58 |
| DE0007446007 | TAKKT AG | | STK | 7.830 | 1.684 | 3.171 | EUR 15,000 | 117.450,00 | 0,86 |
| DE000TRAT0N7 | TRATON SE | | STK | 15.126 | 3.703 | 3.249 | EUR 13,960 | 211.158,96 | 1,55 |
| DE000A0JL9W6 | VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG | | STK | 5.787 | 1.972 | 1.284 | EUR 48,000 | 277.776,00 | 2,04 |
| DE000VTSC017 | Vitesco Technologies Group AG | | STK | 5.768 | 6.587 | 819 | EUR 36,900 | 212.839,20 | 1,57 |
| DE000WACK012 | Wacker Neuson SE | | STK | 7.757 | 1.871 | 2.317 | EUR 16,490 | 127.912,93 | 0,94 |
| DE000ZEAL241 | Zeal Network SE | | STK | 4.265 | 992 | 944 | EUR 37,500 | 159.937,50 | 1,18 |
| | | | | | | | EUR | 12.398.878,79 | 91,22 |
| Ausland | | | | | | | | | |
| LU1250154413 | ADLER Group S.A. | | STK | 22.814 | 4.751 | 7.077 | EUR 3,770 | 86.008,78 | 0,63 |
| AT0000A0E9W5 | S&T AG | | STK | 12.559 | 3.041 | 3.715 | EUR 14,060 | 176.579,54 | 1,30 |
| NL0012044747 | Shop Apotheke Europe N.V. | | STK | 3.983 | 4.856 | 873 | EUR 84,820 | 337.838,06 | 2,49 |
| LU1066226637 | Stabilus S.A. | | STK | 7.269 | 1.853 | 1.635 | EUR 46,650 | 339.098,85 | 2,49 |
| LU2333210958 | SUSE S.A. | | STK | 11.773 | 14.163 | 2.390 | EUR 21,660 | 255.003,18 | 1,88 |
| | | | | | | | EUR | 1.194.528,41 | 8,79 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 13.593.407,20 | 100,00 |

| | | | | | | |
|---|-----|------------|------------|----------------------|----------------------------|-------|
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | EUR | 17.136,56 | 0,13 | |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | |
| Verwahrstelle | EUR | 17.136,56 | % | 100,000 | 17.136,56 | 0,13 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | EUR | 11.145,33 | 0,08 | |
| Dividendenforderungen | EUR | 11.145,33 | | | 11.145,33 | 0,08 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | EUR | -28.733,56 | -0,21 | |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | EUR | -28.733,56 | | | -28.733,56 | -0,21 |
| Wert des Teilsondervermögens | | | EUR | 13.592.955,53 | 100,00¹⁾ | |
| Anteilwert | | | EUR | 54,07 | | |
| Umlaufende Anteile | | | STK | 251.400 | | |

Fußnoten:

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 30.06.2022

Keine Fremdwährungskurse

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 |
|-------------------------------------|--|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE0005103006 | ADVA Optical Networking SE | STK | 2.050 | 14.369 | |
| DE0005493092 | Borussia Dortmund GmbH&Co.KGaA | STK | 0 | 18.338 | |
| DE000A3MQDR1 | DIC Asset AG - Anrechte | STK | 12.229 | 12.229 | |
| DE0007856023 | ElringKlinger AG | STK | 0 | 8.674 | |
| DE0006095003 | ENCAVIS AG | STK | 41.468 | 41.468 | |
| DE000A3MQR73 | ENCAVIS AG - Anrechte | STK | 33.957 | 33.957 | |
| DE000A0S8488 | Hamburger Hafen u. Logistik AG | STK | 0 | 6.349 | |
| DE000A3E5AY6 | Hamburger Hafen und Logistik AG - Anrechte | STK | 0 | 6.464 | |
| DE000A14KEB5 | home24 SE | STK | 420 | 8.177 | |
| DE0006219934 | Jungheinrich AG | STK | 0 | 13.701 | |
| DE0006450000 | LPKF Laser & Electronics AG | STK | 1.518 | 8.510 | |
| DE000A0D6554 | Nordex SE | STK | 37.159 | 37.159 | |
| DE000LED4000 | OSRAM Licht AG | STK | 0 | 6.911 | |
| DE0007235301 | SGL CARBON SE | STK | 3.569 | 19.535 | |
| DE000WAF3001 | Siltronic AG | STK | 2.729 | 5.275 | |
| DE0007231326 | Sixt SE | STK | 580 | 4.196 | |
| DE000A1K0235 | SÜSS MicroTec SE | STK | 0 | 4.637 | |
| DE000TLX1005 | Talanx AG | STK | 349 | 15.474 | |
| DE000A3H3LL2 | Vantage Towers AG | STK | 526 | 27.885 | |
| DE0007667107 | Vossloh AG | STK | 0 | 2.502 | |
| DE000A2N4H07 | Westwing Group AG | STK | 594 | 4.267 | |
| DE0005111702 | zooplus AG | STK | 0 | 1.838 | |
| Ausland | | | | | |
| LU1704650164 | BEFESA S.A. | STK | 179 | 9.903 | |
| LU2010095458 | Global Fashion Group S.A. | STK | 4.080 | 28.339 | |
| LU0061462528 | RTL Group S.A. | STK | 1.844 | 11.986 | |

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2021 bis zum 30.06.2022

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 389.065,42 | 1,548 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 23.817,04 | 0,095 |
| 3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -39.020,35 | -0,155 |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -4.817,11 | -0,019 |
| 5. Sonstige Erträge | | 362,35 | 0,001 |
| Summe der Erträge | | 369.407,35 | 1,469 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme | | -0,20 | 0,000 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -124.176,38 | -0,494 |
| 3. Sonstige Aufwendungen | | -176,52 | -0,001 |
| davon: Verwahrentgelt | -176,52 | | -0,001 |
| Summe der Aufwendungen | | -124.353,10 | -0,495 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 245.054,25 | 0,975 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 2.307.672,91 | 9,179 |
| 2. Realisierte Verluste | | -1.431.228,19 | -5,693 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 876.444,72 | 3,486 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 1.121.498,97 | 4,461 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -2.657.995,14 | -10,573 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -3.811.453,84 | -15,161 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -6.469.448,98 | -25,734 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -5.347.950,01 | -21,273 |

Entwicklung des Teisondervermögens

| | EUR | EUR |
|---|---------------|----------------------|
| I. Wert des Teisondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 19.763.312,64 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -82.599,50 |
| 2. Mittelzufluss (netto) | | -827.316,05 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 2.296.184,24 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -3.123.500,29 | |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | 87.508,45 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -5.347.950,01 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | -2.657.995,14 | |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -3.811.453,84 | |
| II. Wert des Teisondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | 13.592.955,53 |

Verwendung der Erträge des Teisondervermögens

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|---------------------|--------------------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 3.376.432,11 | 13,431 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 2.254.933,14 | 8,970 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 1.121.498,97 | 4,461 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 3.147.658,11 | 12,521 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 1.108.714,79 | 4,410 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 2.038.943,32 | 8,110 |
| III. Gesamtausschüttung | | 228.774,00 | 0,910 |
| 1. Endausschüttung | | 228.774,00 | 0,910 |

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Teisondervermöge am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|---|-------------------|
| 2021/2022 | 13.592.955,53 | 54,07 |
| 2020/2021 | 19.763.312,64 | 73,94 |
| 2019/2020 | 10.547.357,72 | 54,16 |
| 2018/2019 | 9.213.184,65 | 54,53 |

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9058

| | | |
|-----------------------------|------------|-----------------|
| Anteilwert | EUR | 54,07 |
| Umlaufende Anteile | STK | 251.400 |
| Anleger | | Private Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | % | 5,00 |
| Aktueller Rücknahmeabschlag | % | 5,00 |
| Verwaltungsvergütung p. a. | % | 0,70 |
| Ertragsverwendung | | ausschüttend |

Bestand der Wertpapiere am Teilsongervermögen (in %) **100,00**

Bestand der Derivate am Teilsongervermögen (in %) **0,00**

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

| | |
|--|------------------------|
| Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände | zum Nennwert |
| Verbindlichkeiten | zum Rückzahlungsbetrag |

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

| | |
|---|--------|
| Adler ex-Tag 2.06.2021: Korrektur Dividende aus Vorjahr | 340,86 |
| CSDR Erträge | 40,80 |

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

| | |
|------------------------|--------|
| Negative Einlagezinsen | 186,68 |
|------------------------|--------|

Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB **0,70**

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsongervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsongervermögens aus.

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsongervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwandsersstattungen, mit denen das jeweilige Teilsongervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsongervermögens berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl.

Ertragsausgleich

Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF

| | | |
|--|-----|------------|
| Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut, vor Ertragsausgleich) | EUR | 132.211,82 |
| Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft | % | 77,12 |
| Davon für die Verwahrstelle | % | 7,96 |
| Davon für Dritte | % | 14,92 |

Transaktionskosten **EUR 2.434,40**

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Lyxor Funds Solutions S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsongervermögens angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsongervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 67,26 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 25.194.629,11 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsongervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

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 für Indexfonds gem. §16 (2) KARBV

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilsongervermögens und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilsongervermögens erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilsongervermögens.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Der ETF hat eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums
Höhe der Annual Tracking Difference

0,15%
-0,73%

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Angaben zur Vergütung gemäß KAGB § 101 (4) 1.-5.:

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“) hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2022 überprüft.

Zum 1. Juli 2022 wurde die LFS auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Da dieser Bericht den Zeitraum zwischen dem 1. Januar 2022 und dem 30. Juni 2022 abdeckt, hat dies keine Auswirkungen auf diesen Jahresbericht.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA;
- im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.313 TEUR (92,40%) und der variable Teil 108 TEUR (7,60%). Die Gesamtvergütung betrug 1.421 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 17,07
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 36,40
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,30
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.742 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (36). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 275,24

Gemäß Kapitel 7 der ESMA Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31.03.2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an. Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- folgende Risk-Taker benannt hat: Mathias Turra, Martine Capus, Dr. Qi Chen und Martin Rausch (bis zum 29.04.2022)
- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW Instrumenten vornimmt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht anwendet.

Eine Änderung der Vergütungspolitik ist bis dato nicht erfolgt. Eine Überprüfung der Vergütungspolitik nach Art. 14b Abs. 1 Buchstabe c und d sowie ggf. eine Änderung derselben, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2022.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der EU-Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website <https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor> eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag:

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A..

Das Teilsondervermögen wird mit Wirkung zum 12. September 2022 aufgelöst.

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Teilsonderver- mögens |
|--------------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 83.546.511,91 | 100,11 |
| 1. Aktien | | 83.451.878,68 | 99,99 |
| - Bau und Baustoffe | 2.030.936,60 | | 2,43 |
| - Büroausstattung | 5.705.177,94 | | 6,84 |
| - Elektrik / Elektronik | 20.799.890,91 | | 24,92 |
| - Energieversorger | 780.240,00 | | 0,93 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 23.990.951,71 | | 28,75 |
| - Software | 14.705.084,59 | | 17,62 |
| - Telekommunikation | 15.439.596,93 | | 18,50 |
| 2. Forderungen | | 25.675,95 | 0,03 |
| 3. Bankguthaben | | 68.957,28 | 0,08 |
| II. Verbindlichkeiten | | -88.554,12 | -0,11 |
| III. Teilsondervermögen | | 83.457.957,79 | 100,00 ¹⁾ |

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Teilsondervermögens | |
|---|---------------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|----------------------|----------------------------|--------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | | |
| DE0005545503 | 1&1 AG | STK | 31.302 | 5.748 | 7.577 | EUR | 18,000 | 563.436,00 | 0,68 | |
| DE000A0WMPJ6 | AIXTRON SE | STK | 92.763 | 17.681 | 10.154 | EUR | 24,180 | 2.243.009,34 | 2,69 | |
| DE0005158703 | Bechtle AG | STK | 67.686 | 53.754 | 6.845 | EUR | 39,010 | 2.640.430,86 | 3,16 | |
| DE0005419105 | CANCOM SE | STK | 30.207 | 5.145 | 4.715 | EUR | 32,100 | 969.644,70 | 1,16 | |
| DE0005313704 | Carl Zeiss Meditec AG | STK | 30.212 | 5.757 | 3.366 | EUR | 113,900 | 3.441.146,80 | 4,12 | |
| DE000A288904 | CompuGroup Medical SE & Co.KGaA | STK | 20.976 | 3.629 | 2.350 | EUR | 40,640 | 852.464,64 | 1,02 | |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | STK | 451.244 | 216.035 | 296.183 | EUR | 18,946 | 8.549.268,82 | 10,24 | |
| DE0005664809 | Evotec SE | STK | 121.975 | 35.920 | 17.627 | EUR | 23,000 | 2.805.425,00 | 3,36 | |
| DE000A0Z2ZZ5 | freenet AG | STK | 98.257 | 19.667 | 23.081 | EUR | 23,670 | 2.325.743,19 | 2,79 | |
| DE000HAG0005 | HENSOLDT AG | STK | 43.228 | 43.228 | 0 | EUR | 24,100 | 1.041.794,80 | 1,25 | |
| DE0006231004 | Infineon Technologies AG | STK | 344.037 | 104.545 | 48.744 | EUR | 23,090 | 7.943.814,33 | 9,52 | |
| DE000A2NB601 | JENOPTIK AG | STK | 42.114 | 7.970 | 4.637 | EUR | 21,280 | 896.185,92 | 1,07 | |
| DE0006632003 | MorphoSys AG | STK | 28.235 | 5.275 | 1.999 | EUR | 18,775 | 530.112,13 | 0,64 | |
| DE000A3H2200 | Nagarro SE | STK | 6.484 | 6.720 | 236 | EUR | 108,400 | 702.865,60 | 0,84 | |
| DE0006452907 | Nemetschek SE | STK | 46.243 | 12.693 | 9.034 | EUR | 57,760 | 2.670.995,68 | 3,20 | |
| DE0007164600 | SAP SE | STK | 91.729 | 23.430 | 10.807 | EUR | 86,930 | 7.974.001,97 | 9,55 | |
| DE0007165631 | Sartorius AG | STK | 20.338 | 3.879 | 2.270 | EUR | 333,400 | 6.780.689,20 | 8,12 | |
| DE000SHL1006 | Siemens Healthineers AG | STK | 181.662 | 40.091 | 45.474 | EUR | 48,490 | 8.808.790,38 | 10,55 | |
| DE000WAF3001 | Siltronic AG | STK | 13.765 | 7.909 | 934 | EUR | 70,900 | 975.938,50 | 1,17 | |
| DE000A0DJ6J9 | SMA Solar Technology AG | STK | 15.537 | 17.041 | 15.811 | EUR | 38,740 | 601.903,38 | 0,72 | |
| DE000A2GS401 | Software AG | STK | 42.157 | 7.995 | 4.658 | EUR | 31,620 | 1.333.004,34 | 1,60 | |
| DE000A2YN900 | TeamViewer AG | STK | 121.952 | 16.928 | 17.479 | EUR | 9,498 | 1.158.300,10 | 1,39 | |
| DE000A1J5RX9 | Telefónica Deutschland Hldg AG | STK | 739.692 | 162.235 | 119.549 | EUR | 2,740 | 2.026.756,08 | 2,43 | |
| DE0005089031 | United Internet AG | STK | 72.508 | 11.540 | 11.089 | EUR | 27,230 | 1.974.392,84 | 2,37 | |
| DE000A3H3LL2 | Vantage Towers AG | STK | 76.351 | 81.267 | 4.916 | EUR | 26,600 | 2.030.936,60 | 2,43 | |
| DE000A0TGJ55 | VARTA AG | STK | 15.324 | 3.404 | 1.777 | EUR | 79,140 | 1.212.741,36 | 1,45 | |
| DE000A0JL9W6 | VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG | STK | 16.255 | 16.752 | 497 | EUR | 48,000 | 780.240,00 | 0,93 | |
| | | | | | | | | EUR | 73.834.032,56 | 88,47 |
| Ausland | | | | | | | | | | |
| NL0012169213 | Qiagen N.V. | STK | 188.042 | 35.292 | 21.289 | EUR | 44,700 | 8.405.477,40 | 10,07 | |
| AT0000A0E9W5 | S&T AG | STK | 35.281 | 6.794 | 6.806 | EUR | 14,060 | 496.050,86 | 0,59 | |
| LU2333210958 | SUSE S.A. | STK | 33.071 | 34.623 | 1.552 | EUR | 21,660 | 716.317,86 | 0,86 | |
| | | | | | | | | EUR | 9.617.846,12 | 11,52 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | EUR | 83.451.878,68 | 99,99 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 68.957,28 | 0,08 | |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | EUR | 68.957,28 | % | 100,000 | | 68.957,28 | 0,08 | |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 25.675,95 | 0,03 | |
| Dividendenforderungen | | | EUR | 25.675,95 | | | | 25.675,95 | 0,03 | |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -88.554,12 | -0,11 | |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | | | EUR | -88.554,12 | | | | -88.554,12 | -0,11 | |
| Wert des Teilsondervermögens | | | | | | | EUR | 83.457.957,79 | 100,00¹⁾ | |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 22,18 | | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | | STK | 3.762.000 | | |

Fußnoten:

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 30.06.2022

Keine Fremdwährungskurse

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 |
|-------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE0005550636 | Drägerwerk AG & Co. KGaA | STK | 68 | 6.615 | |
| DE0005659700 | Eckert & Ziegler Str.-u.Med.AG | STK | 1.735 | 12.513 | |
| DE0006450000 | LPKF Laser & Electronics AG | STK | 194 | 18.843 | |
| DE000A0D6554 | Nordex SE | STK | 29.122 | 88.888 | |
| DE000A3E5CX4 | Nordex SE - Anrechte | STK | 48.821 | 48.821 | |
| DE0006916604 | Pfeiffer Vacuum Technology AG | STK | 141 | 3.129 | |

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2021 bis zum 30.06.2022

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|-----------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 1.471.403,58 | 0,391 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 12.116,34 | 0,003 |
| 3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -117.492,31 | -0,031 |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -3.761,64 | -0,001 |
| 5. Sonstige Erträge | | 84,69 | 0,000 |
| Summe der Erträge | | 1.362.350,66 | 0,362 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Verwaltungsvergütung | | -408.254,21 | -0,109 |
| 2. Sonstige Aufwendungen | | -647,86 | 0,000 |
| davon: Verwahrtgelt | -647,86 | | 0,000 |
| Summe der Aufwendungen | | -408.902,07 | -0,109 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 953.448,59 | 0,253 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 5.242.949,38 | 1,394 |
| 2. Realisierte Verluste | | -1.612.608,57 | -0,429 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 3.630.340,81 | 0,965 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 4.583.789,40 | 1,218 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -15.540.164,15 | -4,131 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -8.723.858,01 | -2,319 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -24.264.022,16 | -6,450 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -19.680.232,76 | -5,231 |

Entwicklung des Teilsndervermögens

| | EUR | 2021 / 2022 EUR |
|---|----------------|----------------------|
| I. Wert des Teilsndervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 95.674.210,48 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -520.185,00 |
| 2. Mittelzufluss (netto) | | 8.215.691,98 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 13.493.350,65 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -5.277.658,67 | |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -231.526,91 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -19.680.232,76 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | -15.540.164,15 | |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -8.723.858,01 | |
| II. Wert des Teilsndervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | 83.457.957,79 |

Verwendung der Erträge des Teilsndervermögens

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 18.952.856,47 | 5,038 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 6.023.271,29 | 1,601 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 4.583.789,40 | 1,218 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen ²⁾ | | 8.345.795,78 | 2,218 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 18.049.976,47 | 4,798 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 0,00 | 0,000 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 18.049.976,47 | 4,798 |
| III. Gesamtausschüttung | | 902.880,00 | 0,240 |
| 1. Endausschüttung | | 902.880,00 | 0,240 |

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

2) Die Zuführung aus dem Sondervermögen dient dem Ausgleich von im Geschäftsjahr realisierten Verluste, die damit bei der Berechnung der Ausschüttung unberücksichtigt bleiben; im Ergebnis kann sich damit für das laufende oder für künftige Geschäftsjahre eine Substanzausschüttung im investimentrechtlichen Sinne ergeben.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Teilsnder- vermögens am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|--|-------------------|
| 2021/2022 | 83.457.957,79 | 22,18 |
| 2020/2021 | 95.674.210,48 | 27,69 |
| 2019/2020 | 81.729.503,55 | 23,21 |
| 2018/2019 | 80.138.846,81 | 22,93 |

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9082

| | | |
|-----------------------------|------------|------------------|
| Anteilwert | EUR | 22,18 |
| Umlaufende Anteile | STK | 3.762.000 |
| Anleger | | Private Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | % | 5,00 |
| Aktueller Rücknahmeabschlag | % | 5,00 |
| Verwaltungsvergütung p. a. | % | 0,40 |
| Ertragsverwendung | | ausschüttend |

Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)

99,99

Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

| | |
|--|------------------------|
| Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände | zum Nennwert |
| Verbindlichkeiten | zum Rückzahlungsbetrag |

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

CSDR Erträge 83,58

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen 621,48

Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB

0,40

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsondervermögens aus.

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendungserstattungen, mit denen das jeweilige Teilsondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

| | | |
|--|-----|------------|
| Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF | | |
| Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut, vor Ertragsausgleich) | EUR | 388.826,88 |
| Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft | % | 60,51 |
| Davon für die Verwahrstelle | % | 13,41 |
| Davon für Dritte | % | 26,08 |

Transaktionskosten

EUR

2.745,07

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Lyxor Funds Solutions S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 84,46 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 53.285.298,11 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

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 für Indexfonds gem. §16 (2) KARBV

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilsondervermögens und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilsondervermögen erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilsondervermögens.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Der ETF hat eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums
Höhe der Annual Tracking Difference

0,07%
-0,01%

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Angaben zur Vergütung gemäß KAGB § 101 (4) 1.-5.:

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“) hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2022 überprüft.

Zum 1. Juli 2022 wurde die LFS auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Da dieser Bericht den Zeitraum zwischen dem 1. Januar 2022 und dem 30. Juni 2022 abdeckt, hat dies keine Auswirkungen auf diesen Jahresbericht.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA;
- im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.313 TEUR (92,40%) und der variable Teil 108 TEUR (7,60%). Die Gesamtvergütung betrug 1.421 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 17,07
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 36,40
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,30
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.742 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (36). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 275,24

Gemäß Kapitel 7 der ESMA Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31.03.2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an. Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- folgende Risk-Taker benannt hat: Mathias Turra, Martine Capus, Dr. Qi Chen und Martin Rausch (bis zum 29.04.2022)
- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW Instrumenten vornimmt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht anwendet.

Eine Änderung der Vergütungspolitik ist bis dato nicht erfolgt. Eine Überprüfung der Vergütungspolitik nach Art. 14b Abs. 1 Buchstabe c und d sowie ggf. eine Änderung derselben, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2022.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der EU-Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website <https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor> eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag:

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A..

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Teilsondervermögens |
|------------------------------------|--------------------|----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 49.590.263,20 | 100,05 |
| 1. Aktien | | 49.360.189,78 | 99,59 |
| - Audiovisuelle Industrie | 356.015,90 | | 0,72 |
| - Banken | 4.931.478,48 | | 9,95 |
| - Bau und Baustoffe | 1.949.265,43 | | 3,93 |
| - Bergbau | 713.652,51 | | 1,44 |
| - Büroausstattung | 418.510,41 | | 0,84 |
| - Chemische Industrie | 2.157.892,78 | | 4,35 |
| - Einzelhandel | 1.690.110,80 | | 3,41 |
| - Elektrik / Elektronik | 2.744.923,32 | | 5,54 |
| - Energieversorger | 3.932.024,97 | | 7,93 |
| - Freizeit/Tourismus | 130.782,32 | | 0,26 |
| - Holdinggesellschaften | 284.105,79 | | 0,57 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 2.357.286,15 | | 4,76 |
| - Papier- und andere Basisprodukte | 451.736,64 | | 0,91 |
| - Papier- und Verpackungsindustrie | 95.070,90 | | 0,19 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 10.175.857,33 | | 20,53 |
| - Real Estate | 791.273,39 | | 1,60 |
| - Software | 812.585,03 | | 1,64 |
| - Sonstige Finanzdienstleistungen | 627.367,27 | | 1,27 |
| - Sonstige industrielle Werte | 795.376,46 | | 1,60 |
| - Sonstiges | 1.412.401,94 | | 2,85 |
| - Telekommunikation | 2.189.556,37 | | 4,42 |
| - Textilien und Kleidung | 1.721.568,11 | | 3,47 |
| - Transportation | 711.621,67 | | 1,44 |
| - Unterhaltungsindustrie | 239.925,48 | | 0,48 |
| - Verbrauchsgüter | 4.897.606,78 | | 9,88 |
| - Versicherungen | 2.772.193,55 | | 5,59 |
| 2. Forderungen | | 194.145,14 | 0,39 |
| 3. Bankguthaben | | 35.928,28 | 0,07 |
| II. Verbindlichkeiten | | -25.010,65 | -0,05 |
| III. Teilsondervermögen | | 49.565.252,55 | 100,00 ¹⁾ |

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Teilsonder- ver- mögens |
|-------------------------------------|--------------------------------|-------|--|-----------------------|-------------------|----------------------|---------------|---------------------|--|
| | | | | im Berichtszeitraum | | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | |
| DE000A1EWWW0 | adidas AG | STK | 1.106 | 1.106 | 224 | 29 | EUR 168,760 | 186.648,56 | 0,38 |
| DE000A0WMPJ6 | AIXTRON SE | STK | 713 | 713 | 713 | 0 | EUR 24,180 | 17.240,34 | 0,03 |
| DE0008404005 | Allianz SE | STK | 2.596 | 2.596 | 617 | 32 | EUR 182,120 | 472.783,52 | 0,95 |
| DE0006766504 | Aurubis AG | STK | 511 | 511 | 511 | 0 | EUR 64,760 | 33.092,36 | 0,07 |
| DE000BASF111 | BASF SE | STK | 5.688 | 5.688 | 1.209 | 0 | EUR 41,525 | 236.194,20 | 0,48 |
| DE000BAY0017 | Bayer AG | STK | 6.261 | 6.261 | 1.470 | 0 | EUR 56,720 | 355.123,92 | 0,72 |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke AG | STK | 2.075 | 2.075 | 512 | 0 | EUR 73,460 | 152.429,50 | 0,31 |
| DE0005158703 | Bechtle AG | STK | 498 | 498 | 365 | 0 | EUR 39,010 | 19.426,98 | 0,04 |
| DE0005200000 | Beiersdorf AG | STK | 611 | 611 | 179 | 45 | EUR 97,480 | 59.560,28 | 0,12 |
| DE000A1DAH00 | Brenntag SE | STK | 939 | 939 | 186 | 0 | EUR 62,100 | 58.311,90 | 0,12 |
| DE0005313704 | Carl Zeiss Meditec AG | STK | 187 | 187 | 63 | 54 | EUR 113,900 | 21.299,30 | 0,04 |
| DE0000CBK1001 | Commerzbank AG | STK | 6.588 | 6.588 | 2.802 | 1.063 | EUR 6,686 | 44.047,37 | 0,09 |
| DE0005439004 | Continental AG | STK | 657 | 657 | 130 | 0 | EUR 66,500 | 43.690,50 | 0,09 |
| DE0006062144 | Covestro AG | STK | 1.175 | 1.175 | 233 | 0 | EUR 32,980 | 38.751,50 | 0,08 |
| DE0007100000 | Daimler AG | STK | 5.014 | 5.014 | 1.227 | 307 | EUR 55,220 | 276.873,08 | 0,56 |
| DE0005140008 | Deutsche Bank AG | STK | 12.881 | 12.881 | 2.802 | 0 | EUR 8,318 | 107.144,16 | 0,22 |
| DE0005810055 | Deutsche Börse AG | STK | 1.180 | 1.180 | 253 | 0 | EUR 159,600 | 188.328,00 | 0,38 |
| DE0008232125 | Deutsche Lufthansa AG | STK | 3.371 | 3.371 | 2.914 | 1.001 | EUR 5,564 | 18.756,24 | 0,04 |
| DE0005552004 | Deutsche Post AG | STK | 6.104 | 6.104 | 1.299 | 0 | EUR 35,740 | 218.156,96 | 0,44 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | STK | 22.039 | 22.039 | 6.225 | 0 | EUR 18,946 | 417.550,89 | 0,84 |
| DE0000EVNK013 | Evonik Industries AG | STK | 1.221 | 1.221 | 287 | 0 | EUR 20,360 | 24.859,56 | 0,05 |
| DE0005785802 | Fresenius Medical Care KGaA | STK | 1.208 | 1.208 | 240 | 0 | EUR 47,630 | 57.537,04 | 0,12 |
| DE0005785604 | Fresenius SE & Co. KGaA | STK | 2.581 | 2.581 | 588 | 13 | EUR 28,900 | 74.590,90 | 0,15 |
| DE0006602006 | GEA Group AG | STK | 981 | 981 | 258 | 0 | EUR 32,890 | 32.265,09 | 0,07 |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | STK | 365 | 365 | 72 | 0 | EUR 138,500 | 50.552,50 | 0,10 |
| DE0006047004 | HeidelbergCement AG | STK | 905 | 905 | 184 | 0 | EUR 45,840 | 41.485,20 | 0,08 |
| DE000A161408 | HelloFresh SE | STK | 915 | 915 | 915 | 848 | EUR 30,850 | 28.227,75 | 0,06 |
| DE0006048432 | Henkel AG & Co. KGaA | STK | 1.083 | 1.083 | 214 | 0 | EUR 58,780 | 63.658,74 | 0,13 |
| DE000A1PHFF7 | HUGO BOSS AG | STK | 272 | 272 | 407 | 135 | EUR 50,360 | 13.697,92 | 0,03 |
| DE0006231004 | Infineon Technologies AG | STK | 8.099 | 8.099 | 1.730 | 0 | EUR 23,090 | 187.005,91 | 0,38 |
| DE000KGX8881 | KION GROUP AG | STK | 437 | 437 | 87 | 0 | EUR 39,590 | 17.300,83 | 0,03 |
| DE000KBX1006 | Knorr-Bremse AG | STK | 335 | 335 | 111 | 98 | EUR 54,420 | 18.230,70 | 0,04 |
| DE0005470405 | LANXESS AG | STK | 497 | 497 | 99 | 6 | EUR 34,180 | 16.987,46 | 0,03 |
| DE000LEG1110 | LEG Immobilien SE | STK | 443 | 443 | 91 | 0 | EUR 79,120 | 35.050,16 | 0,07 |
| DE0006599905 | Merck KGaA | STK | 841 | 841 | 216 | 5 | EUR 161,000 | 135.401,00 | 0,27 |
| DE0008430026 | Münchener Rückvers.-Ges. AG | STK | 870 | 870 | 187 | 0 | EUR 224,200 | 195.054,00 | 0,39 |
| DE000PAH0038 | Porsche Automobil Holding SE | STK | 931 | 931 | 184 | 0 | EUR 63,120 | 58.764,72 | 0,12 |
| DE000PSM7770 | ProSiebenSat.1 Media SE | STK | 637 | 637 | 236 | 595 | EUR 8,810 | 5.611,97 | 0,01 |
| DE0006969603 | PUMA SE | STK | 565 | 565 | 209 | 97 | EUR 62,840 | 35.504,60 | 0,07 |
| DE0007164600 | SAP SE | STK | 6.915 | 6.915 | 1.589 | 1 | EUR 86,930 | 601.120,95 | 1,21 |
| DE0007165631 | Sartorius AG | STK | 150 | 150 | 30 | 0 | EUR 333,400 | 50.010,00 | 0,10 |
| DE000A12DM80 | Scout24 AG | STK | 480 | 480 | 99 | 33 | EUR 48,990 | 23.515,20 | 0,05 |
| DE0007236101 | Siemens AG | STK | 4.771 | 4.771 | 1.149 | 26 | EUR 97,090 | 463.216,39 | 0,93 |
| DE000ENER6Y0 | Siemens Energy AG | STK | 2.664 | 2.664 | 606 | 242 | EUR 13,985 | 37.256,04 | 0,08 |
| DE000SHL1006 | Siemens Healthineers AG | STK | 1.853 | 1.853 | 1.868 | 1.371 | EUR 48,490 | 89.851,97 | 0,18 |
| DE000SYM9999 | Symrise AG | STK | 834 | 834 | 241 | 0 | EUR 103,850 | 86.610,90 | 0,17 |
| DE0008303504 | TAG Immobilien AG | STK | 891 | 891 | 177 | 0 | EUR 10,890 | 9.702,99 | 0,02 |
| DE000A1J5RX9 | Telefónica Deutschland Hldg AG | STK | 5.616 | 5.616 | 5.616 | 0 | EUR 2,740 | 15.387,84 | 0,03 |
| DE0007500001 | thyssenkrupp AG | STK | 2.918 | 2.918 | 982 | 465 | EUR 5,410 | 15.786,38 | 0,03 |
| DE0005089031 | United Internet AG | STK | 617 | 617 | 122 | 0 | EUR 27,230 | 16.800,91 | 0,03 |
| DE0007664039 | Volkswagen AG | STK | 1.183 | 1.183 | 295 | 5 | EUR 127,420 | 150.737,86 | 0,30 |
| DE000A1ML7J1 | Vonovia SE | STK | 4.481 | 4.481 | 1.964 | 115 | EUR 29,400 | 131.741,40 | 0,27 |
| DE000WCH8881 | Wacker Chemie AG | STK | 110 | 110 | 110 | 0 | EUR 137,600 | 15.136,00 | 0,03 |
| DE000ZAL1111 | Zalando SE | STK | 1.323 | 1.323 | 608 | 168 | EUR 24,960 | 33.022,08 | 0,07 |
| | | | | | | | EUR | 5.797.092,52 | 11,70 |
| Ausland | | | | | | | | | |
| GB00B1YW4409 | 3i Group PLC | STK | 6.120 | 6.120 | 1.374 | 0 | GBP 11,085 | 78.810,64 | 0,16 |
| DK0010244508 | A.P.Møller-Mærsk A/S | STK | 36 | 36 | 10 | 4 | DKK 16555,000 | 80.140,92 | 0,16 |
| IT0001233417 | A2A S.p.A. | STK | 9.525 | 9.525 | 1.886 | 0 | EUR 1,212 | 11.544,30 | 0,02 |
| SE0011337708 | AAK AB | STK | 786 | 786 | 231 | 311 | SEK 166,900 | 12.245,08 | 0,02 |
| NL0000852564 | Aalberts N.V. | STK | 625 | 625 | 157 | 0 | EUR 37,190 | 23.243,75 | 0,05 |
| NL0015000W81 | Aalberts N.V. - Anrechte | STK | 625 | 625 | 625 | 0 | EUR 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| CH0012221716 | ABB Ltd. | STK | 9.862 | 9.862 | 2.311 | 1.027 | CHF 25,460 | 250.860,75 | 0,51 |
| NL0011540547 | ABN AMRO Bank N.V. | STK | 2.481 | 2.481 | 572 | 388 | EUR 10,715 | 26.583,92 | 0,05 |
| ES0125220311 | Acciona S.A. | STK | 150 | 150 | 30 | 0 | EUR 175,500 | 26.325,00 | 0,05 |
| FR0000120404 | ACCOR S.A. | STK | 1.106 | 1.106 | 300 | 0 | EUR 25,830 | 28.567,98 | 0,06 |
| ES0167050915 | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA | STK | 1.461 | 1.461 | 393 | 140 | EUR 23,130 | 33.792,93 | 0,07 |
| SE0014781795 | Addtech AB | STK | 1.627 | 1.627 | 656 | 297 | SEK 133,400 | 20.259,38 | 0,04 |
| CH0012138605 | Adecco Group AG | STK | 1.023 | 1.023 | 227 | 0 | CHF 32,440 | 33.156,28 | 0,07 |
| BE0003851681 | Aedifica S.A. | STK | 230 | 230 | 245 | 176 | EUR 91,500 | 21.045,00 | 0,04 |
| BE6336384530 | Aedifica S.A. - Anrechte | STK | 230 | 230 | 230 | 0 | EUR 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| NL0000303709 | AEGON N.V. | STK | 11.038 | 11.038 | 2.226 | 47 | EUR 4,128 | 45.564,86 | 0,09 |
| NL0015000SA1 | AEGON N.V. - Anrechte | STK | 11.038 | 11.038 | 11.038 | 0 | EUR 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| ES0105046009 | Aena SME S.A. | STK | 447 | 447 | 89 | 0 | EUR 121,250 | 54.198,75 | 0,11 |

| | | | | | | | | | |
|---------------|--------------------------------|-----|---------|--------|-------|-----|-----------|--------------|------|
| FR0010340141 | Aéroports de Paris S.A. | STK | 170 | 34 | 0 | EUR | 120,850 | 20.544,50 | 0,04 |
| BE0974264930 | AGEAS SA/NV | STK | 999 | 259 | 142 | EUR | 41,980 | 41.938,02 | 0,08 |
| NL0011794037 | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. | STK | 6.499 | 1.399 | 0 | EUR | 24,860 | 161.565,14 | 0,33 |
| NO0010345853 | Aker BP ASA | STK | 791 | 874 | 610 | NOK | 342,100 | 26.198,82 | 0,05 |
| NL0013267909 | Akzo Nobel N.V. | STK | 1.139 | 226 | 16 | EUR | 62,620 | 71.324,18 | 0,14 |
| CH0432492467 | Alcon AG | STK | 3.078 | 695 | 54 | CHF | 66,680 | 205.056,49 | 0,41 |
| SE0000695876 | Alfa Laval AB | STK | 1.808 | 358 | 0 | SEK | 246,600 | 41.617,34 | 0,08 |
| DK0061802139 | ALK-Abelló AS | STK | 565 | 800 | 235 | DKK | 123,200 | 9.360,13 | 0,02 |
| FR0010220475 | Alstom S.A. | STK | 1.876 | 380 | 0 | EUR | 21,590 | 40.502,84 | 0,08 |
| FR0000071946 | Alten S.A. | STK | 178 | 36 | 0 | EUR | 103,800 | 18.476,40 | 0,04 |
| ES0109067019 | Amadeus IT Group S.A. | STK | 2.772 | 575 | 0 | EUR | 53,160 | 147.359,52 | 0,30 |
| DK0060946788 | Ambu A/S | STK | 1.082 | 647 | 472 | DKK | 68,920 | 10.027,56 | 0,02 |
| AT0000A18XM4 | ams AG | STK | 1.235 | 428 | 531 | CHF | 8,598 | 10.608,98 | 0,02 |
| FR0004125920 | Amundi S.A. | STK | 377 | 77 | 0 | EUR | 52,200 | 19.679,40 | 0,04 |
| AT0000730007 | Andritz AG | STK | 448 | 252 | 151 | EUR | 38,440 | 17.221,12 | 0,03 |
| GB00B1XZS820 | Anglo American PLC | STK | 8.534 | 8.534 | 6.192 | GBP | 29,370 | 291.175,16 | 0,59 |
| BE0974293251 | Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. | STK | 5.679 | 1.548 | 0 | EUR | 51,360 | 291.673,44 | 0,59 |
| GB0000456144 | Antofagasta PLC | STK | 4.092 | 2.201 | 0 | GBP | 11,550 | 54.905,44 | 0,11 |
| NL00006237562 | Arcadis N.V. | STK | 451 | 455 | 4 | EUR | 32,100 | 14.477,10 | 0,03 |
| LU1598757687 | ArcelorMittal S.A. | STK | 4.563 | 1.937 | 835 | EUR | 21,510 | 98.150,13 | 0,20 |
| FR0010313833 | Arkema S.A. | STK | 401 | 80 | 0 | EUR | 84,920 | 34.052,92 | 0,07 |
| LU1673108939 | Aroundtown SA | STK | 5.662 | 1.148 | 245 | EUR | 3,033 | 17.172,85 | 0,03 |
| LU2489901806 | Aroundtown SA - Anrechte | STK | 5.662 | 5.662 | 0 | EUR | 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| GB0000536739 | Ashtead Group PLC | STK | 2.966 | 789 | 24 | GBP | 34,390 | 118.495,28 | 0,24 |
| NL0000334118 | ASM International N.V. | STK | 294 | 67 | 3 | EUR | 238,600 | 70.148,40 | 0,14 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. | STK | 2.568 | 563 | 41 | EUR | 455,850 | 1.170.622,80 | 2,36 |
| NL0011872643 | ASR Nederland N.V. | STK | 839 | 166 | 15 | EUR | 38,570 | 32.360,23 | 0,07 |
| SE0007100581 | Assa-Abloy AB | STK | 6.169 | 1.335 | 0 | SEK | 217,300 | 125.128,81 | 0,25 |
| IT0000062072 | Assicurazioni Generali S.p.A. | STK | 6.717 | 1.501 | 1.064 | EUR | 15,225 | 102.266,33 | 0,21 |
| GB0006731235 | Associated British Foods PLC | STK | 2.190 | 434 | 0 | GBP | 15,780 | 40.146,61 | 0,08 |
| GB0009895292 | AstraZeneca PLC | STK | 9.791 | 3.389 | 0 | GBP | 108,000 | 1.228.424,72 | 2,48 |
| IT0003506190 | Atlantia S.p.A. | STK | 3.086 | 833 | 0 | EUR | 22,380 | 69.064,68 | 0,14 |
| SE0017486889 | Atlas Copco AB | STK | 16.012 | 24.018 | 8.006 | SEK | 95,570 | 142.840,05 | 0,29 |
| FR0000051732 | Atos SE | STK | 673 | 137 | 0 | EUR | 12,785 | 8.604,31 | 0,02 |
| GB00BVYVFW23 | Auto Trader Group PLC | STK | 6.722 | 2.071 | 75 | GBP | 5,550 | 43.340,03 | 0,09 |
| GB00BDD85M81 | Avast Plc. | STK | 5.026 | 1.746 | 0 | GBP | 5,170 | 30.186,36 | 0,06 |
| GB00BPQY8M80 | Aviva PLC | STK | 18.576 | 18.576 | 0 | GBP | 4,013 | 86.600,24 | 0,17 |
| FR0000120628 | AXA S.A. | STK | 12.611 | 3.073 | 496 | EUR | 21,660 | 273.154,26 | 0,55 |
| SE0006993770 | Axfood AB | STK | 680 | 680 | 0 | SEK | 294,300 | 18.680,22 | 0,04 |
| FO0000000179 | Bakkafrost P/F | STK | 231 | 270 | 282 | NOK | 630,000 | 14.089,80 | 0,03 |
| CH0012410517 | Báloise Holding AG | STK | 256 | 59 | 41 | CHF | 155,900 | 39.874,51 | 0,08 |
| ES0113211835 | Banco Bilbao Vizcaya Argent. | STK | 38.890 | 9.724 | 3.353 | EUR | 4,331 | 168.413,15 | 0,34 |
| ES0113860A34 | Banco de Sabadell S.A. | STK | 34.215 | 6.773 | 0 | EUR | 0,761 | 26.023,93 | 0,05 |
| ES0113900J37 | Banco Santander S.A. | STK | 109.239 | 24.671 | 1 | EUR | 2,688 | 293.634,43 | 0,59 |
| IE00BD1RP616 | Bank of Ireland Group PLC | STK | 5.913 | 1.454 | 68 | EUR | 6,032 | 35.667,22 | 0,07 |
| ES0113679I37 | Bankinter S.A. | STK | 3.908 | 774 | 1 | EUR | 5,952 | 23.260,42 | 0,05 |
| GB0031348658 | Barclays PLC | STK | 101.626 | 26.760 | 3.045 | GBP | 1,531 | 180.773,39 | 0,36 |
| GB0000811801 | Barratt Developments PLC | STK | 7.135 | 2.169 | 0 | GBP | 4,574 | 37.912,98 | 0,08 |
| CH0009002962 | Barry Callebaut AG | STK | 20 | 5 | 2 | CHF | 2.130,000 | 42.561,69 | 0,09 |
| AT0000BAWAG2 | BAWAG Group AG | STK | 448 | 596 | 488 | EUR | 40,160 | 17.991,68 | 0,04 |
| NL0012866412 | BE Semiconductor Inds N.V. | STK | 461 | 111 | 2 | EUR | 45,870 | 21.146,07 | 0,04 |
| GB00BYQ0JC66 | Beazley PLC | STK | 3.828 | 3.828 | 0 | GBP | 4,990 | 22.190,66 | 0,04 |
| CH1101098163 | BELIMO Holding AG | STK | 60 | 12 | 0 | CHF | 336,000 | 20.141,87 | 0,04 |
| GB0000904986 | Bellway PLC | STK | 750 | 148 | 0 | GBP | 21,460 | 18.697,72 | 0,04 |
| GB00BLJNXL82 | Berkeley Group Holdings PLC | STK | 683 | 684 | 1 | GBP | 37,240 | 29.548,00 | 0,06 |
| GB0002869419 | Big Yellow Group PLC | STK | 1.430 | 1.430 | 0 | GBP | 13,120 | 21.795,54 | 0,04 |
| SE0000862997 | BillerudKorsnäs AB | STK | 1.889 | 995 | 0 | SEK | 119,350 | 21.044,43 | 0,04 |
| FR0013280286 | bioMerieux | STK | 296 | 59 | 0 | EUR | 93,200 | 27.587,20 | 0,06 |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. | STK | 7.244 | 1.620 | 0 | EUR | 45,365 | 328.624,06 | 0,66 |
| SE0017768716 | Boliden AB | STK | 2.496 | 7.256 | 4.760 | SEK | 325,350 | 75.801,57 | 0,15 |
| FR0000039299 | Bolloré S.A. | STK | 5.463 | 5.463 | 4.381 | EUR | 4,420 | 24.146,46 | 0,05 |
| FR0000120503 | Bouygues S.A. | STK | 1.807 | 366 | 0 | EUR | 29,360 | 53.053,52 | 0,11 |
| GB0007980591 | BP PLC | STK | 122.808 | 27.423 | 3.314 | GBP | 3,883 | 553.977,07 | 1,12 |
| GB0001367019 | British Land Co. PLC, The | STK | 6.139 | 1.930 | 0 | GBP | 4,471 | 31.886,00 | 0,06 |
| GB00B0N8QD54 | Britvic PLC | STK | 1.626 | 323 | 0 | GBP | 8,110 | 15.319,31 | 0,03 |
| GB0030913577 | BT Group PLC | STK | 46.169 | 12.309 | 8.920 | GBP | 1,863 | 99.921,99 | 0,20 |
| CH0002432174 | Bucher Industries AG | STK | 29 | 45 | 48 | CHF | 332,000 | 9.619,34 | 0,02 |
| GB00B0744B38 | Bunzl PLC | STK | 2.253 | 609 | 0 | GBP | 27,190 | 71.165,28 | 0,14 |
| GB0031743007 | Burberry Group PLC | STK | 2.750 | 775 | 0 | GBP | 16,410 | 52.425,07 | 0,11 |
| FR0006174348 | Bureau Veritas SA | STK | 1.776 | 354 | 0 | EUR | 24,450 | 43.423,20 | 0,09 |
| ES0140609019 | Caixabank S.A. | STK | 26.834 | 5.681 | 0 | EUR | 3,317 | 89.008,38 | 0,18 |
| FR0000125338 | Capgemini SE | STK | 1.062 | 239 | 0 | EUR | 163,450 | 173.583,90 | 0,35 |
| DK0010181759 | Carlsberg AS | STK | 614 | 121 | 0 | DKK | 904,000 | 74.637,91 | 0,15 |
| FR0000120172 | Carrefour S.A. | STK | 3.718 | 897 | 144 | EUR | 16,885 | 62.778,43 | 0,13 |
| SE0000379190 | Castellum AB | STK | 1.839 | 755 | 27 | SEK | 131,450 | 22.564,47 | 0,05 |
| ES0105066007 | Cellnex Telecom S.A. | STK | 3.324 | 691 | 165 | EUR | 37,030 | 123.087,72 | 0,25 |
| GB00B033F229 | Centrica PLC | STK | 41.401 | 12.723 | 0 | GBP | 0,800 | 38.476,77 | 0,08 |
| CH0010570759 | Chocoladef. Lindt & Sprüngli | STK | 1 | 0 | 0 | CHF | 100100,00 | 100.009,99 | 0,20 |
| DK0060227585 | Christian Hansen Holding AS | STK | 710 | 208 | 0 | DKK | 516,600 | 49.321,40 | 0,10 |
| CH0210483332 | Cie Financière Richemont AG | STK | 3.317 | 771 | 0 | CHF | 101,650 | 336.869,87 | 0,68 |
| FR001400AJ45 | Cie Génle Ets Michelin SCpA | STK | 4.482 | 4.482 | 0 | EUR | 25,975 | 116.419,95 | 0,23 |
| CH0012142631 | Clariant AG | STK | 1.368 | 271 | 0 | CHF | 18,180 | 24.847,88 | 0,05 |
| NL0010545661 | CNH Industrial N.V. | STK | 6.286 | 1.421 | 0 | EUR | 11,020 | 69.271,72 | 0,14 |

| | | | | | | | | | |
|--------------|--------------------------------|-----|--------|--------|-------|-----|----------|------------|------|
| CH0198251305 | Coca-Cola HBC AG | STK | 1.225 | 245 | 1 | GBP | 18,220 | 25.928,79 | 0,05 |
| BE0003593044 | Cofinimmo S.A. | STK | 181 | 47 | 0 | EUR | 103,600 | 18.751,60 | 0,04 |
| DK0060448595 | Coloplast AS | STK | 747 | 166 | 0 | DKK | 808,400 | 81.202,53 | 0,16 |
| FR0000125007 | Compagnie de Saint-Gobain S.A. | STK | 3.238 | 641 | 1 | EUR | 40,945 | 132.579,91 | 0,27 |
| GB00BD6K4575 | Compass Group PLC | STK | 11.485 | 2.778 | 0 | GBP | 16,800 | 224.149,63 | 0,45 |
| GB00BD3VFW73 | ConvaTec Group PLC | STK | 12.129 | 4.236 | 0 | GBP | 2,244 | 31.618,82 | 0,06 |
| FR0000064578 | Covivio S.A. | STK | 286 | 57 | 0 | EUR | 52,950 | 15.143,70 | 0,03 |
| FR0000045072 | Crédit Agricole S.A. | STK | 8.543 | 2.183 | 0 | EUR | 8,731 | 74.588,93 | 0,15 |
| CH0012138530 | Credit Suisse Group AG | STK | 15.509 | 4.611 | 892 | CHF | 5,420 | 83.983,20 | 0,17 |
| IE0001827041 | CRH PLC | STK | 5.022 | 1.210 | 66 | EUR | 33,000 | 165.726,00 | 0,33 |
| GB00BJFFLV09 | Croda International PLC | STK | 959 | 264 | 0 | GBP | 64,720 | 72.103,25 | 0,15 |
| FR0000120644 | Danone S.A. | STK | 4.010 | 841 | 0 | EUR | 53,260 | 213.572,60 | 0,43 |
| DK0010274414 | Danske Bank AS | STK | 4.480 | 1.171 | 0 | DKK | 100,300 | 60.422,91 | 0,12 |
| FR0014003TT8 | Dassault Systemes SE | STK | 4.566 | 4.566 | 0 | EUR | 35,115 | 160.335,09 | 0,32 |
| NL0015435975 | Davide Campari-Milano N.V. | STK | 3.258 | 993 | 3 | EUR | 10,035 | 32.694,03 | 0,07 |
| IE0002424939 | DCC PLC | STK | 692 | 198 | 0 | GBP | 50,980 | 40.982,99 | 0,08 |
| GB0009633180 | Dechra Pharmaceuticals PLC | STK | 804 | 276 | 0 | GBP | 34,580 | 32.298,23 | 0,07 |
| DK0060738599 | Demant AS | STK | 736 | 263 | 19 | DKK | 266,300 | 26.355,52 | 0,05 |
| GB0002652740 | Derwent London PLC | STK | 783 | 285 | 0 | GBP | 26,120 | 23.759,25 | 0,05 |
| GB0002374006 | Diageo PLC | STK | 14.517 | 3.265 | 154 | GBP | 35,305 | 595.402,75 | 1,20 |
| BE0974259880 | D'leteren Group S.A. | STK | 147 | 147 | 0 | EUR | 139,600 | 20.521,20 | 0,04 |
| GB0001826634 | Diploma PLC | STK | 768 | 768 | 607 | GBP | 22,280 | 19.878,07 | 0,04 |
| GB00BY9D0Y18 | Direct Line Insurance Grp PLC | STK | 9.453 | 3.351 | 486 | GBP | 2,517 | 27.640,80 | 0,06 |
| CH0126673539 | DKSH Holding AG | STK | 225 | 311 | 86 | CHF | 78,800 | 17.714,06 | 0,04 |
| NO0010161896 | DNB Bank ASA | STK | 5.594 | 5.594 | 0 | NOK | 176,550 | 95.618,61 | 0,19 |
| SE0007691613 | Dometic Group AB | STK | 1.279 | 500 | 664 | SEK | 60,000 | 7.163,16 | 0,01 |
| GB0008220112 | DS Smith PLC | STK | 9.827 | 3.130 | 0 | GBP | 2,773 | 31.656,91 | 0,06 |
| DK0060079531 | DSV Panalpina A/S | STK | 1.243 | 296 | 25 | DKK | 991,200 | 165.674,28 | 0,33 |
| CH0023405456 | Dufry AG | STK | 445 | 237 | 168 | CHF | 30,860 | 13.720,35 | 0,03 |
| FR0010908533 | Edenred S.A. | STK | 1.518 | 315 | 0 | EUR | 44,970 | 68.264,46 | 0,14 |
| ES0127797019 | EDP Renováveis S.A. | STK | 1.461 | 289 | 0 | EUR | 22,520 | 32.901,72 | 0,07 |
| FR0000130452 | Eiffage S.A. | STK | 604 | 604 | 489 | EUR | 85,880 | 51.871,52 | 0,10 |
| FR0010242511 | Electricité de France (E.D.F.) | STK | 3.594 | 2.081 | 956 | EUR | 7,806 | 28.054,76 | 0,06 |
| GB0003096442 | Electrocomponents PLC | STK | 3.339 | 1.047 | 0 | GBP | 8,690 | 33.708,07 | 0,07 |
| SE0016589188 | Electrolux, AB | STK | 1.047 | 1.400 | 353 | SEK | 137,660 | 13.453,56 | 0,03 |
| SE0000163628 | Elekta AB | STK | 1.585 | 574 | 787 | SEK | 70,660 | 10.454,08 | 0,02 |
| BE0003822393 | Elia Group | STK | 182 | 66 | 45 | EUR | 135,200 | 24.606,40 | 0,05 |
| FR0012435121 | Elis S.A. | STK | 1.142 | 257 | 0 | EUR | 12,700 | 14.503,40 | 0,03 |
| FI0009007884 | Elisa Oyj | STK | 851 | 195 | 78 | EUR | 53,620 | 45.630,62 | 0,09 |
| ES0130960018 | Enagas S.A. | STK | 1.434 | 284 | 0 | EUR | 21,070 | 30.214,38 | 0,06 |
| FR0010208488 | Engie S.A. | STK | 11.456 | 2.387 | 0 | EUR | 10,966 | 125.626,50 | 0,25 |
| IT0003132476 | ENI S.p.A. | STK | 15.599 | 3.348 | 0 | EUR | 11,328 | 176.705,47 | 0,36 |
| IM00B5VQMV65 | Entain PLC | STK | 3.870 | 1.015 | 0 | GBP | 12,450 | 55.972,93 | 0,11 |
| SE0015658109 | Epiroc AB | STK | 3.966 | 899 | 0 | SEK | 157,950 | 58.472,97 | 0,12 |
| SE0012853455 | EQT AB | STK | 4.208 | 1.126 | 0 | SEK | 209,400 | 82.249,87 | 0,17 |
| NO0010096985 | Equinor ASA | STK | 6.869 | 1.626 | 0 | NOK | 342,550 | 227.808,39 | 0,46 |
| AT0000652011 | Erste Group Bank AG | STK | 1.913 | 693 | 220 | EUR | 24,200 | 46.294,60 | 0,09 |
| FR0000121667 | EssilorLuxottica S.A. | STK | 1.920 | 483 | 17 | EUR | 142,900 | 274.368,00 | 0,55 |
| SE0009922164 | Essity AB | STK | 3.803 | 862 | 8 | SEK | 267,100 | 94.816,31 | 0,19 |
| FR0000121121 | Eurazeo SE | STK | 315 | 88 | 0 | EUR | 59,100 | 18.616,50 | 0,04 |
| FR0014000MR3 | Eurofins Scientific S.E. | STK | 797 | 176 | 0 | EUR | 75,080 | 59.838,76 | 0,12 |
| NL0006294274 | Euronext N.V. | STK | 486 | 111 | 0 | EUR | 77,900 | 37.859,40 | 0,08 |
| GB00B19NLV48 | Experian PLC | STK | 5.961 | 1.501 | 269 | GBP | 24,060 | 166.614,38 | 0,34 |
| SE0011166974 | Fabege AB | STK | 1.430 | 501 | 436 | SEK | 96,580 | 12.891,58 | 0,03 |
| SE0017832488 | Fastighets AB Balder | STK | 4.026 | 4.026 | 0 | SEK | 49,010 | 18.417,95 | 0,04 |
| FR0000121147 | Faurecia SE | STK | 1.030 | 394 | 0 | EUR | 18,910 | 19.482,45 | 0,04 |
| JE00BJVNSS43 | Ferguson PLC | STK | 1.394 | 346 | 84 | GBP | 91,880 | 148.792,66 | 0,30 |
| NL0011585146 | Ferrari N.V. | STK | 748 | 177 | 22 | EUR | 175,200 | 131.049,60 | 0,26 |
| ES0118900010 | Ferrovial S.A. | STK | 3.296 | 805 | 68 | EUR | 24,190 | 79.730,24 | 0,16 |
| IT0000072170 | Fincobank Banca Fineco S.p.A. | STK | 3.709 | 735 | 0 | EUR | 11,420 | 42.356,78 | 0,09 |
| ES0137650018 | Fluidra S.A. | STK | 591 | 166 | 48 | EUR | 19,340 | 11.429,94 | 0,02 |
| PTGALOAM0009 | Galp Energia SGPS S.A. | STK | 3.177 | 784 | 0 | EUR | 11,185 | 35.534,75 | 0,07 |
| FR0011726835 | Gaztransport Technigaz | STK | 142 | 142 | 0 | EUR | 119,500 | 16.969,00 | 0,03 |
| CH0030170408 | Geberit AG | STK | 221 | 46 | 6 | CHF | 458,800 | 101.303,63 | 0,20 |
| FR0010040865 | Gecina S.A. | STK | 288 | 57 | 0 | EUR | 89,000 | 25.632,00 | 0,05 |
| CH1169151003 | Georg Fischer AG | STK | 500 | 1.550 | 1.050 | CHF | 46,960 | 23.458,89 | 0,05 |
| SE0000202624 | Getinge AB | STK | 1.324 | 262 | 0 | SEK | 236,400 | 29.215,83 | 0,06 |
| FR0010533075 | Getlink SE | STK | 2.656 | 525 | 0 | EUR | 16,830 | 44.700,48 | 0,09 |
| CH0010645932 | Givaudan SA | STK | 49 | 10 | 0 | CHF | 3357,000 | 164.345,09 | 0,33 |
| NO0010582521 | Gjensidige Forsikring ASA | STK | 1.148 | 227 | 0 | NOK | 199,500 | 22.173,64 | 0,04 |
| IE0000669501 | Glanbia PLC | STK | 1.210 | 721 | 477 | EUR | 10,330 | 12.499,30 | 0,03 |
| GB0009252882 | GlaxoSmithKline PLC | STK | 32.239 | 7.783 | 83 | GBP | 17,656 | 661.259,04 | 1,33 |
| DK0010272632 | GN Store Nord AS | STK | 798 | 312 | 146 | DKK | 248,700 | 26.687,10 | 0,05 |
| IE00B00MZ448 | Grafton Group PLC | STK | 1.340 | 265 | 0 | GBP | 7,768 | 12.092,38 | 0,02 |
| GB00B63QSB39 | Greggs PLC | STK | 619 | 124 | 0 | GBP | 18,080 | 13.001,30 | 0,03 |
| ES0171996087 | Grifols S.A. | STK | 1.785 | 354 | 2 | EUR | 18,035 | 32.192,48 | 0,06 |
| BE0003797140 | Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) | STK | 600 | 159 | 33 | EUR | 79,680 | 47.680,00 | 0,10 |
| SE0000106270 | H & M Hennes & Mauritz AB | STK | 4.641 | 1.064 | 69 | SEK | 122,160 | 52.920,44 | 0,11 |
| GB0004052071 | Halma PLC | STK | 2.493 | 642 | 0 | GBP | 20,090 | 58.183,52 | 0,12 |
| GB0004161021 | Hays PLC | STK | 10.524 | 10.524 | 8.204 | GBP | 1,116 | 13.644,03 | 0,03 |
| NL0000008977 | Heineken Holding N.V. | STK | 615 | 122 | 0 | EUR | 69,450 | 42.711,75 | 0,09 |
| NL0000009165 | Heineken N.V. | STK | 1.551 | 389 | 0 | EUR | 87,000 | 134.937,00 | 0,27 |
| CH0466642201 | Helvetia Holding AG | STK | 175 | 47 | 42 | CHF | 111,700 | 19.529,92 | 0,04 |

| | | | | | | | | | |
|--------------|---------------------------------|-----|---------|---------|--------|-----|-----------|--------------|------|
| IT0001250932 | Hera S.p.A. | STK | 4.900 | 978 | 0 | EUR | 2,760 | 13.524,00 | 0,03 |
| FR0000052292 | Hermes International S.C.A. | STK | 225 | 53 | 0 | EUR | 1.067.000 | 240.075,00 | 0,48 |
| SE0015961909 | Hexagon AB | STK | 13.243 | 3.580 | 0 | SEK | 106,250 | 131.340,34 | 0,26 |
| GB00BOLCW083 | Hikma Pharmaceuticals PLC | STK | 1.267 | 434 | 0 | GBP | 16,175 | 23.807,77 | 0,05 |
| CH0012214059 | Holcim Ltd. | STK | 3.478 | 718 | 0 | CHF | 40,850 | 141.948,55 | 0,29 |
| SE0011090018 | Holmen AB | STK | 1.264 | 799 | 0 | SEK | 414,900 | 48.952,32 | 0,10 |
| GB0005576813 | Howden Joinery Group PLC | STK | 4.307 | 1.396 | 29 | GBP | 6,026 | 30.151,00 | 0,06 |
| GB0005405286 | HSBC Holdings PLC | STK | 129.035 | 28.240 | 407 | GBP | 5,356 | 802.871,12 | 1,62 |
| FI0009000459 | Huhtamäki Oyj | STK | 467 | 197 | 200 | EUR | 37,800 | 17.652,60 | 0,04 |
| SE0001662230 | Husqvarna AB | STK | 1.976 | 501 | 550 | SEK | 75,240 | 13.877,73 | 0,03 |
| ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. | STK | 37.493 | 10.404 | 1.492 | EUR | 9,896 | 371.030,73 | 0,75 |
| NL0010801007 | IMCD N.V. | STK | 347 | 69 | 0 | EUR | 130,950 | 45.439,65 | 0,09 |
| GB00BGLP8L22 | IMI PLC | STK | 1.585 | 318 | 49 | GBP | 11,730 | 21.598,57 | 0,04 |
| ES0148396007 | Industria de Diseño Textil SA | STK | 7.217 | 1.798 | 1 | EUR | 21,590 | 155.815,03 | 0,31 |
| SE0000190126 | Industrivärden AB | STK | 1.037 | 321 | 125 | SEK | 230,200 | 22.282,65 | 0,04 |
| SE0001515552 | Indutrade AB | STK | 1.625 | 322 | 0 | SEK | 186,550 | 28.296,42 | 0,06 |
| GB00BMJ6DW54 | Infirma PLC | STK | 9.929 | 2.599 | 1 | GBP | 5,288 | 60.995,06 | 0,12 |
| IT0005090300 | Infrastrutt. Wireless Italiane | STK | 2.139 | 2.139 | 1.715 | EUR | 9,684 | 20.714,08 | 0,04 |
| NL0011821202 | ING Groep N.V. | STK | 24.222 | 5.190 | 0 | EUR | 9,431 | 228.437,68 | 0,46 |
| ES0139140174 | Inmobiliaria Colonial SOCIMI | STK | 1.818 | 513 | 0 | EUR | 6,105 | 11.098,89 | 0,02 |
| GB00BHJYC057 | InterContinental Hotels Group | STK | 1.228 | 313 | 0 | GBP | 43,500 | 62.056,23 | 0,13 |
| GB00BYT1DJ19 | Intermediate Capital Grp PLC | STK | 1.945 | 510 | 0 | GBP | 13,090 | 29.577,20 | 0,06 |
| ES0177542018 | Internat. Cons. Airl. Group SA | STK | 15.115 | 2.993 | 1 | GBP | 1,076 | 18.897,26 | 0,04 |
| IT0001078911 | Interpump Group S.p.A. | STK | 502 | 100 | 0 | EUR | 36,380 | 18.262,76 | 0,04 |
| GB0031638363 | Intertek Group PLC | STK | 1.071 | 284 | 0 | GBP | 42,060 | 52.330,69 | 0,11 |
| IT0000072618 | Intesa Sanpaolo S.p.A. | STK | 112.378 | 23.418 | 1 | EUR | 1,780 | 200.032,84 | 0,40 |
| GB00B17BBQ50 | Investec PLC | STK | 4.699 | 4.699 | 0 | GBP | 4,448 | 24.281,08 | 0,05 |
| SE0015811963 | Investor AB | STK | 11.306 | 2.421 | 0 | SEK | 168,180 | 177.486,83 | 0,36 |
| FR0010259150 | Ipsen S.A. | STK | 102 | 102 | 51 | EUR | 90,050 | 20.531,40 | 0,04 |
| DK0060542181 | ISS AS | STK | 903 | 533 | 382 | DKK | 111,900 | 13.587,53 | 0,03 |
| IT0005211237 | Italgas S.P.A. | STK | 2.978 | 591 | 0 | EUR | 5,555 | 16.542,79 | 0,03 |
| GB0033986497 | ITV PLC | STK | 28.500 | 10.812 | 0 | GBP | 0,653 | 21.606,76 | 0,04 |
| GB00BM8Q5M07 | JD Sports Fashion PLC | STK | 15.089 | 15.089 | 0 | GBP | 1,154 | 20.228,52 | 0,04 |
| PTJMTOAE0001 | Jerónimo Martins, SGPS, S.A. | STK | 1.678 | 485 | 0 | EUR | 20,740 | 34.801,72 | 0,07 |
| GB00BZ4BQC70 | Johnson, Matthey PLC | STK | 1.361 | 434 | 43 | GBP | 19,255 | 30.443,84 | 0,06 |
| CH0102484968 | Julius Baer Gruppe AG | STK | 1.389 | 509 | 212 | CHF | 44,040 | 61.116,56 | 0,12 |
| BE0003565737 | KBC Groep N.V. | STK | 1.635 | 418 | 0 | EUR | 53,540 | 87.537,90 | 0,18 |
| FR0000121485 | Kering S.A. | STK | 465 | 109 | 1 | EUR | 490,100 | 227.896,50 | 0,46 |
| IE0004906560 | Kerry Group PLC | STK | 964 | 206 | 0 | EUR | 91,340 | 88.051,76 | 0,18 |
| FI0009000202 | Kesko Oyj | STK | 1.490 | 338 | 180 | EUR | 22,510 | 33.539,90 | 0,07 |
| SE0007871645 | Kindred Group PLC | STK | 883 | 942 | 1.181 | SEK | 85,060 | 7.010,82 | 0,01 |
| GB0033195214 | Kingfisher PLC | STK | 12.699 | 2.532 | 130 | GBP | 2,443 | 36.040,50 | 0,07 |
| IE0004927939 | Kingspan Group PLC | STK | 968 | 206 | 1 | EUR | 57,400 | 55.563,20 | 0,11 |
| SE0015810247 | Kinnevik AB | STK | 1.514 | 599 | 265 | SEK | 164,800 | 23.289,81 | 0,05 |
| FR0000121964 | Klépierre S.A. | STK | 1.269 | 251 | 22 | EUR | 18,360 | 23.298,84 | 0,05 |
| FI4000312251 | Kojamo Oyj | STK | 915 | 1.505 | 1.603 | EUR | 16,460 | 15.060,90 | 0,03 |
| NL0000009082 | Kon. KPN N.V. | STK | 20.826 | 4.433 | 0 | EUR | 3,401 | 70.829,23 | 0,14 |
| FI0009013403 | KONE Oyj | STK | 2.523 | 768 | 217 | EUR | 45,360 | 114.443,28 | 0,23 |
| NL0000009827 | Koninklijke DSM N.V. | STK | 1.077 | 225 | 0 | EUR | 137,100 | 147.656,70 | 0,30 |
| NL0000009538 | Koninklijke Philips N.V. | STK | 5.503 | 1.135 | 75 | EUR | 20,555 | 113.114,17 | 0,23 |
| CH0025238863 | Kühne & Nagel Internat. AG | STK | 355 | 79 | 0 | CHF | 226,000 | 80.157,86 | 0,16 |
| FR0013451333 | LA FRANCAISE DES JEUX | STK | 693 | 150 | 0 | EUR | 33,020 | 22.882,86 | 0,05 |
| GB00BYW0PQ60 | Land Securities Group PLC | STK | 4.763 | 1.432 | 59 | GBP | 6,640 | 36.740,61 | 0,07 |
| GB0005603997 | Legal & General Group PLC | STK | 38.638 | 9.534 | 0 | GBP | 2,395 | 107.502,34 | 0,22 |
| FR0010307819 | Legrand S.A. | STK | 1.648 | 344 | 0 | EUR | 70,460 | 116.118,08 | 0,23 |
| IE00BZ12WP82 | Linde PLC | STK | 3.164 | 701 | 70 | EUR | 273,950 | 866.777,80 | 1,75 |
| GB0008706128 | Lloyds Banking Group PLC | STK | 444.456 | 113.611 | 15.233 | GBP | 0,423 | 218.458,79 | 0,44 |
| CH0025751329 | Logitech International S.A. | STK | 1.053 | 209 | 0 | CHF | 49,870 | 52.465,89 | 0,11 |
| GB00BOSWJX34 | London Stock Exchange Group PLC | STK | 2.258 | 685 | 0 | GBP | 76,320 | 200.198,14 | 0,40 |
| GB00B4WFW713 | Londonmetric Property PLC | STK | 7.308 | 2.871 | 0 | GBP | 2,284 | 19.390,65 | 0,04 |
| CH0013841017 | Lonza Group AG | STK | 459 | 96 | 0 | CHF | 509,000 | 233.420,92 | 0,47 |
| PLPPP0000011 | LPP S.A. | STK | 7 | 12 | 5 | PLN | 8995,000 | 13.396,38 | 0,03 |
| FR0000121014 | LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE | STK | 1.660 | 375 | 8 | EUR | 581,700 | 965.622,00 | 1,95 |
| GB00BKFB1C65 | M&G PLC | STK | 17.931 | 5.252 | 1 | GBP | 1,946 | 40.536,40 | 0,08 |
| JE00BJ1DLW90 | Man Group Ltd. | STK | 8.511 | 8.511 | 7.048 | GBP | 2,498 | 24.698,51 | 0,05 |
| GB0031274896 | Marks & Spencer Group PLC | STK | 11.908 | 2.366 | 0 | GBP | 1,355 | 18.744,59 | 0,04 |
| IT0000062957 | Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA | STK | 3.724 | 747 | 224 | EUR | 8,258 | 30.752,79 | 0,06 |
| ES0105025003 | Merlin Properties SOCIMI S.A. | STK | 2.041 | 404 | 0 | EUR | 9,205 | 18.787,41 | 0,04 |
| FI0009014575 | Metso Outotec Oyj | STK | 4.136 | 1.532 | 836 | EUR | 7,150 | 29.572,40 | 0,06 |
| SE0001174970 | Millicom Intl Cellular S.A. | STK | 1.083 | 835 | 248 | SEK | 146,000 | 14.759,24 | 0,03 |
| IT0004965148 | Moncler S.p.A. | STK | 1.333 | 265 | 0 | EUR | 40,930 | 54.559,69 | 0,11 |
| GB00B1CRLC47 | Mondi PLC | STK | 3.098 | 870 | 140 | GBP | 14,550 | 52.365,13 | 0,11 |
| NO0003054108 | Mowi ASA | STK | 2.763 | 561 | 0 | NOK | 224,100 | 59.948,04 | 0,12 |
| GB00BDR05C01 | National Grid PLC | STK | 23.119 | 5.781 | 0 | GBP | 10,520 | 282.541,68 | 0,57 |
| ES0116870314 | Naturgy Energy Group S.A. | STK | 1.188 | 1.289 | 1.696 | EUR | 27,470 | 32.634,36 | 0,07 |
| GB00B7777214 | NatWest Group PLC | STK | 35.804 | 10.774 | 1.486 | GBP | 2,183 | 90.799,41 | 0,18 |
| FI0009013296 | Neste Oyj | STK | 2.649 | 556 | 0 | EUR | 42,240 | 111.893,76 | 0,23 |
| CH0038863350 | Nestlé S.A. | STK | 17.759 | 4.031 | 322 | CHF | 111,440 | 1.977.283,40 | 3,99 |
| DK0060952919 | Netcompany Group A/S | STK | 273 | 54 | 0 | DKK | 387,800 | 14.236,17 | 0,03 |
| FR0000044448 | Nexans S.A. | STK | 115 | 115 | 0 | EUR | 73,950 | 8.504,25 | 0,02 |
| IT0005366767 | Nexi S.p.A. | STK | 4.265 | 1.815 | 0 | EUR | 7,904 | 33.710,56 | 0,07 |
| GB0032089863 | NEXT PLC | STK | 884 | 236 | 0 | GBP | 58,600 | 60.179,37 | 0,12 |
| SE0015988019 | NIBE Industrier AB | STK | 9.135 | 2.261 | 0 | SEK | 76,800 | 65.486,62 | 0,13 |

| | | | | | | | | | |
|--------------|--------------------------------|-----|--------|--------|--------|-----|-----------|--------------|------|
| GB00B7FC0762 | NMC HEALTH PLC | STK | 261 | 0 | 0 | GBP | 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| NL0010773842 | NN Group N.V. | STK | 1.736 | 576 | 390 | EUR | 43,340 | 75.238,24 | 0,15 |
| FI0009000681 | Nokia Oyj | STK | 33.567 | 7.355 | 0 | EUR | 4,440 | 149.020,70 | 0,30 |
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp | STK | 23.843 | 7.285 | 849 | EUR | 8,396 | 200.185,83 | 0,40 |
| SE0012116390 | Nordic Entertainment Group AB | STK | 218 | 86 | 214 | SEK | 209,900 | 4.271,22 | 0,01 |
| NO0003055501 | Nordic Semiconductor ASA | STK | 1.097 | 518 | 276 | NOK | 152,800 | 16.228,64 | 0,03 |
| NO0005052605 | Norsk Hydro ASA | STK | 13.101 | 6.468 | 0 | NOK | 55,160 | 69.965,02 | 0,14 |
| CH0012005267 | Novartis AG | STK | 15.150 | 3.414 | 296 | CHF | 80,850 | 1.223.776,10 | 2,47 |
| DK0060534915 | Novo-Nordisk AS | STK | 10.320 | 2.346 | 103 | DKK | 787,200 | 1.092.414,46 | 2,20 |
| DK0060336014 | Novozymes A/S | STK | 1.325 | 304 | 0 | DKK | 426,000 | 75.901,11 | 0,15 |
| NL0010558797 | OCI N.V. | STK | 621 | 621 | 0 | EUR | 31,480 | 19.549,08 | 0,04 |
| AT0000743059 | OMV AG | STK | 933 | 383 | 146 | EUR | 44,760 | 41.761,08 | 0,08 |
| FR0000133308 | Orange S.A. | STK | 12.627 | 2.631 | 0 | EUR | 11,220 | 141.674,94 | 0,29 |
| FR0000120321 | Oréal S.A., L' | STK | 1.541 | 360 | 14 | EUR | 329,300 | 507.451,30 | 1,02 |
| FI0009014377 | Orion Corp. | STK | 535 | 194 | 176 | EUR | 42,600 | 22.791,00 | 0,05 |
| NO0003733800 | Orkla ASA | STK | 4.568 | 905 | 1 | NOK | 78,720 | 34.814,76 | 0,07 |
| DK0060252690 | Pandora A/S | STK | 652 | 169 | 5 | DKK | 446,500 | 39.146,39 | 0,08 |
| CH0024608827 | Partners Group Holding AG | STK | 140 | 29 | 0 | CHF | 860,200 | 120.319,71 | 0,24 |
| GB006776081 | Pearson PLC | STK | 5.190 | 1.502 | 0 | GBP | 7,498 | 45.207,50 | 0,09 |
| GB00BNNTLN49 | Pennon Group PLC | STK | 2.058 | 2.102 | 44 | GBP | 9,525 | 22.772,36 | 0,05 |
| FR0000120693 | Pernod-Ricard S.A. | STK | 1.264 | 263 | 0 | EUR | 175,300 | 221.579,20 | 0,45 |
| GB00BGXQNP29 | Phoenix Group Holdings PLC | STK | 6.017 | 2.496 | 0 | GBP | 5,904 | 41.269,02 | 0,08 |
| IT0003796171 | Poste Italiane S.p.A. | STK | 2.838 | 561 | 0 | EUR | 8,910 | 25.292,26 | 0,05 |
| PLPKO0000016 | Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski | STK | 5.215 | 1.051 | 138 | PLN | 28,000 | 31.067,09 | 0,06 |
| PLPZU0000011 | Powszechny Zaklad Ubezpieczen | STK | 3.721 | 3.721 | 2.771 | PLN | 29,980 | 23.734,47 | 0,05 |
| NL0013654783 | Prosus N.V. | STK | 5.710 | 7.993 | 4.452 | EUR | 62,480 | 356.760,80 | 0,72 |
| BE0003810273 | Proximus S.A. | STK | 956 | 190 | 0 | EUR | 14,065 | 13.446,14 | 0,03 |
| GB0007099541 | Prudential PLC | STK | 17.734 | 17.843 | 12.865 | GBP | 10,160 | 209.313,94 | 0,42 |
| IT0004176001 | Prysmian S.p.A. | STK | 1.630 | 322 | 0 | EUR | 26,210 | 42.722,30 | 0,09 |
| FR0000130577 | Publicis Groupe S.A. | STK | 1.463 | 334 | 0 | EUR | 46,660 | 68.263,58 | 0,14 |
| NL0012169213 | Qiagen N.V. | STK | 1.332 | 1.484 | 1.278 | EUR | 44,700 | 59.540,40 | 0,12 |
| AT0000606306 | Raiffeisen Bank Intl AG | STK | 410 | 801 | 1.052 | EUR | 10,340 | 4.239,40 | 0,01 |
| NL0000379121 | Randstad N.V. | STK | 798 | 189 | 0 | EUR | 46,200 | 36.867,60 | 0,07 |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group | STK | 4.704 | 1.113 | 1 | GBP | 61,700 | 337.171,00 | 0,68 |
| IT0003828271 | Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA | STK | 632 | 709 | 568 | EUR | 41,510 | 26.234,32 | 0,05 |
| ES0173093024 | Red Electrica Corporacion S.A. | STK | 2.540 | 792 | 363 | EUR | 18,025 | 45.783,50 | 0,09 |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC | STK | 12.540 | 2.914 | 46 | GBP | 22,260 | 324.280,20 | 0,65 |
| FR0000130395 | Rémy Cointreau S.A. | STK | 138 | 64 | 31 | EUR | 166,700 | 23.004,60 | 0,05 |
| FR0000131906 | Renault S.A. | STK | 1.259 | 250 | 0 | EUR | 23,790 | 29.951,61 | 0,06 |
| GB00B082RF11 | Rentokil Initial PLC | STK | 12.347 | 3.279 | 0 | GBP | 4,746 | 68.074,88 | 0,14 |
| IT0005282865 | Reply S.p.A. | STK | 141 | 141 | 110 | EUR | 115,700 | 16.313,70 | 0,03 |
| ES0173516115 | Repsol S.A. | STK | 8.902 | 2.591 | 555 | EUR | 14,050 | 125.073,10 | 0,25 |
| FR0010451203 | Rexel S.A. | STK | 1.485 | 294 | 0 | EUR | 14,675 | 21.792,38 | 0,04 |
| DK0010219153 | Rockwool International A/S | STK | 53 | 11 | 0 | DKK | 1.597,500 | 11.385,17 | 0,02 |
| GB00BVFNZH21 | Rotork PLC | STK | 5.228 | 1.044 | 79 | GBP | 2,406 | 14.612,65 | 0,03 |
| GB00BDVZY77 | Royal Mail PLC | STK | 4.924 | 1.000 | 192 | GBP | 2,697 | 15.427,54 | 0,03 |
| DK0060634707 | Royal Unibrew AS | STK | 260 | 323 | 268 | DKK | 628,400 | 21.970,11 | 0,04 |
| FR0013269123 | Rubis S.C.A. | STK | 589 | 119 | 9 | EUR | 22,280 | 13.122,92 | 0,03 |
| IE00BYTBXV33 | Ryanair Holdings PLC | STK | 3.361 | 7.175 | 6.565 | EUR | 11,275 | 38.040,06 | 0,08 |
| GB00B019KW72 | Sainsbury PLC, J. | STK | 10.788 | 2.604 | 0 | GBP | 2,040 | 25.566,36 | 0,05 |
| SE0009554454 | Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB | STK | 5.467 | 1.842 | 1.545 | SEK | 17,035 | 8.693,09 | 0,02 |
| FI0009003305 | Sampo OYJ | STK | 3.245 | 758 | 0 | EUR | 41,520 | 134.732,40 | 0,27 |
| SE0000667891 | Sandvik AB | STK | 6.767 | 1.476 | 48 | SEK | 165,850 | 104.759,75 | 0,21 |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. | STK | 7.215 | 1.643 | 0 | EUR | 96,340 | 695.093,10 | 1,40 |
| FR0013154002 | Sartorius Stedim Biotech S.A. | STK | 147 | 29 | 0 | EUR | 299,300 | 43.997,10 | 0,09 |
| CH0024638196 | Schindler Holding AG | STK | 248 | 49 | 0 | CHF | 174,100 | 43.137,98 | 0,09 |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE | STK | 3.625 | 859 | 0 | EUR | 112,900 | 409.262,50 | 0,83 |
| GB0002405495 | Schroders PLC | STK | 781 | 154 | 0 | GBP | 26,720 | 24.242,94 | 0,05 |
| FR0010411983 | SCOR SE | STK | 1.041 | 207 | 1 | EUR | 20,500 | 21.340,50 | 0,04 |
| FR0000121709 | SEB S.A. | STK | 149 | 40 | 49 | EUR | 91,550 | 13.640,95 | 0,03 |
| SE0000163594 | Securitas AB | STK | 1.504 | 386 | 446 | SEK | 88,120 | 12.371,01 | 0,02 |
| GB00B5ZN1N88 | Segro PLC | STK | 7.559 | 2.034 | 328 | GBP | 9,768 | 85.776,38 | 0,17 |
| GB00B1FH8J72 | Severn Trent PLC | STK | 1.723 | 488 | 0 | GBP | 27,190 | 54.424,22 | 0,11 |
| CH0002497458 | SGS S.A. | STK | 37 | 8 | 1 | CHF | 2.185,000 | 80.772,30 | 0,16 |
| ES0143416115 | Siemens Gamesa Renew. En. S.A. | STK | 1.364 | 271 | 1 | EUR | 17,910 | 24.429,24 | 0,05 |
| CH0435377954 | SIG Combibloc Services AG | STK | 2.179 | 724 | 106 | CHF | 21,020 | 45.761,39 | 0,09 |
| NL0011821392 | Signify N.V. | STK | 829 | 203 | 0 | EUR | 31,630 | 26.221,27 | 0,05 |
| CH0418792922 | Sika AG | STK | 948 | 293 | 0 | CHF | 220,000 | 208.372,46 | 0,42 |
| DK0060495240 | SimCorp A/S | STK | 246 | 49 | 1 | DKK | 515,200 | 17.042,51 | 0,03 |
| SE0000148884 | Skandinaviska Enskilda Banken | STK | 10.740 | 2.921 | 0 | SEK | 100,400 | 100.651,63 | 0,20 |
| SE0000113250 | Skanska AB | STK | 2.766 | 814 | 0 | SEK | 156,800 | 40.483,78 | 0,08 |
| SE0000108227 | SKF AB | STK | 4.132 | 2.557 | 270 | SEK | 150,500 | 58.046,98 | 0,12 |
| GB0009223206 | Smith & Nephew PLC | STK | 5.871 | 1.555 | 0 | GBP | 11,475 | 78.264,09 | 0,16 |
| GB00B1WY2338 | Smiths Group PLC | STK | 2.407 | 476 | 2 | GBP | 13,995 | 39.133,33 | 0,08 |
| IE00B1RR8406 | Smurfit Kappa Group PLC | STK | 1.717 | 523 | 0 | EUR | 32,080 | 55.081,36 | 0,11 |
| IT0003153415 | Snam S.p.A. | STK | 12.505 | 2.476 | 0 | EUR | 4,999 | 62.512,50 | 0,13 |
| FR0000130809 | Société Générale S.A. | STK | 5.189 | 1.043 | 0 | EUR | 20,890 | 108.398,21 | 0,22 |
| FR0000121220 | Sodexo S.A. | STK | 513 | 101 | 0 | EUR | 67,060 | 34.401,78 | 0,07 |
| FR0013227113 | Soitec S.A. | STK | 153 | 41 | 0 | EUR | 135,500 | 20.731,50 | 0,04 |
| BE0003470755 | Solvay S.A. | STK | 469 | 111 | 0 | EUR | 77,320 | 36.263,08 | 0,07 |
| CH0012549785 | Sonova Holding AG | STK | 326 | 70 | 7 | CHF | 304,000 | 99.014,89 | 0,20 |
| FR0000050809 | Sopra Steria Group S.A. | STK | 97 | 19 | 0 | EUR | 142,600 | 13.832,20 | 0,03 |
| GB0003308607 | Spectris PLC | STK | 703 | 703 | 584 | GBP | 27,110 | 22.140,25 | 0,04 |

| | | | | | | | | | |
|---------------|--------------------------------|-----|---------|--------|--------|------------|---------|----------------------|--------------|
| FR0012757854 | Spie S.A. | STK | 922 | 182 | 0 | EUR | 20,700 | 19.085,40 | 0,04 |
| GB00BWFQGN14 | Spirax-Sarco Engineering PLC | STK | 490 | 131 | 0 | GBP | 98,780 | 56.229,32 | 0,11 |
| SE0000120669 | SSAB AB | STK | 9.745 | 9.745 | 0 | SEK | 42,320 | 38.495,53 | 0,08 |
| GB0007908733 | SSE PLC | STK | 6.736 | 6.736 | 5.117 | GBP | 16,160 | 126.456,51 | 0,26 |
| GB0007669376 | St. James's Place PLC | STK | 3.640 | 1.010 | 0 | GBP | 11,025 | 46.620,59 | 0,09 |
| GB0004082847 | Standard Chartered PLC | STK | 16.157 | 4.523 | 1.087 | GBP | 6,186 | 116.109,67 | 0,23 |
| GB00BF8Q6K64 | Standard Life Aberdeen PLC | STK | 13.260 | 2.625 | 0 | GBP | 1,599 | 24.623,73 | 0,05 |
| NL00150001Q9 | Stellantis N.V. | STK | 14.049 | 14.087 | 10.173 | EUR | 11,792 | 165.665,81 | 0,33 |
| NL0000226223 | STMicroelectronics N.V. | STK | 4.070 | 848 | 0 | EUR | 29,985 | 122.038,95 | 0,25 |
| FI0009005961 | Stora Enso Oyj | STK | 5.228 | 2.242 | 0 | EUR | 14,965 | 78.237,02 | 0,16 |
| NO0003053605 | Storebrand ASA | STK | 2.954 | 1.268 | 595 | NOK | 70,100 | 20.048,45 | 0,04 |
| CH1175448666 | Straumann Holding AG | STK | 720 | 720 | 0 | CHF | 114,650 | 82.473,77 | 0,17 |
| SE0000112724 | Svenska Cellulosa AB | STK | 5.303 | 2.587 | 0 | SEK | 152,800 | 75.635,87 | 0,15 |
| SE0007100599 | Svenska Handelsbanken AB | STK | 9.657 | 2.204 | 15 | SEK | 87,420 | 78.801,75 | 0,16 |
| SE0014960373 | Sweco AB | STK | 881 | 248 | 375 | SEK | 106,300 | 8.741,62 | 0,02 |
| SE0000242455 | Swedbank AB | STK | 5.830 | 1.327 | 9 | SEK | 129,300 | 70.363,90 | 0,14 |
| SE0000872095 | Swedish Orphan Biovitrum AB | STK | 1.213 | 256 | 0 | SEK | 221,200 | 25.045,44 | 0,05 |
| CH0014852781 | Swiss Life Holding AG | STK | 195 | 41 | 2 | CHF | 465,000 | 90.593,47 | 0,18 |
| CH0008038389 | Swiss Prime Site AG | STK | 462 | 92 | 1 | CHF | 83,750 | 38.657,71 | 0,08 |
| CH0126881561 | Swiss Re AG | STK | 1.780 | 371 | 0 | CHF | 73,980 | 131.565,99 | 0,27 |
| CH0008742519 | Swisscom AG | STK | 155 | 31 | 0 | CHF | 527,400 | 81.673,49 | 0,16 |
| GB00BP92CJ43 | Tate & Lyle PLC | STK | 2.442 | 2.442 | 0 | GBP | 7,494 | 21.259,70 | 0,04 |
| GB0008782301 | Taylor Wimpey PLC | STK | 22.662 | 4.881 | 0 | GBP | 1,167 | 30.710,06 | 0,06 |
| CH0012100191 | Tecan Group AG | STK | 62 | 38 | 23 | CHF | 277,200 | 17.170,95 | 0,03 |
| SE0005190238 | Tele2 AB | STK | 3.046 | 603 | 0 | SEK | 116,500 | 33.123,68 | 0,07 |
| IT0003497168 | Telecom Italia S.p.A. | STK | 61.930 | 12.259 | 0 | EUR | 0,250 | 15.463,92 | 0,03 |
| SE0000108656 | Telefonaktiebolaget L.M.Erics. | STK | 19.128 | 4.144 | 0 | SEK | 76,270 | 136.177,74 | 0,27 |
| ES0178430E18 | Telefónica S.A. | STK | 35.399 | 11.426 | 2.575 | EUR | 4,862 | 172.109,94 | 0,35 |
| FR0000051807 | Téléperformance SE | STK | 362 | 76 | 0 | EUR | 293,300 | 106.174,60 | 0,21 |
| SE0000667925 | Telia Company AB | STK | 15.045 | 2.979 | 1 | SEK | 39,180 | 55.022,39 | 0,11 |
| CH0012453913 | Temenos AG | STK | 418 | 142 | 49 | CHF | 81,620 | 34.086,48 | 0,07 |
| LU0156801721 | Tenaris S.A. | STK | 2.839 | 2.839 | 2.277 | EUR | 12,270 | 34.834,53 | 0,07 |
| IT0003242622 | Terna Rete Elettrica Nazio.Spa | STK | 8.574 | 1.698 | 0 | EUR | 7,488 | 64.202,11 | 0,13 |
| GB00BLGZ9862 | Tesco PLC | STK | 49.124 | 11.657 | 240 | GBP | 2,555 | 145.808,34 | 0,29 |
| SE0006422390 | Thule Group AB (publ) | STK | 484 | 129 | 155 | SEK | 251,300 | 11.353,26 | 0,02 |
| NO0012470089 | Tomra Systems ASA | STK | 1.510 | 1.510 | 0 | NOK | 182,680 | 26.706,70 | 0,05 |
| FR0000120271 | TotalEnergies SE | STK | 16.518 | 3.692 | 0 | EUR | 50,370 | 832.011,66 | 1,68 |
| GB00BK9RKT01 | Travis Perkins PLC | STK | 1.368 | 271 | 0 | GBP | 9,676 | 57.777,29 | 0,03 |
| SE0000114837 | Trelleborg AB | STK | 1.475 | 292 | 0 | SEK | 206,100 | 28.376,11 | 0,06 |
| GB00BG49KP99 | Tritax Big Box REIT PLC | STK | 13.952 | 5.564 | 0 | GBP | 1,815 | 29.417,84 | 0,06 |
| DK0006036678 | Tryg AS | STK | 2.301 | 542 | 0 | DKK | 159,350 | 49.305,04 | 0,10 |
| CH0244767585 | UBS Group AG | STK | 21.075 | 4.787 | 688 | CHF | 15,390 | 324.052,60 | 0,65 |
| BE0003739530 | UCB S.A. | STK | 794 | 179 | 2 | EUR | 80,640 | 64.028,16 | 0,13 |
| BE0974320526 | Umicore S.A. | STK | 1.320 | 332 | 0 | EUR | 33,320 | 43.982,40 | 0,09 |
| FR0013326246 | Unibail-Rodamco-Westfield SE | STK | 647 | 137 | 61 | EUR | 48,650 | 31.476,55 | 0,06 |
| IT0005239360 | UniCredit S.p.A. | STK | 13.714 | 2.870 | 98 | EUR | 9,065 | 124.317,41 | 0,25 |
| GB00B10RZP78 | Unilever PLC | STK | 16.661 | 3.878 | 40 | GBP | 37,210 | 720.208,89 | 1,45 |
| GB0006928617 | Unite Group PLC | STK | 2.289 | 697 | 0 | GBP | 10,640 | 28.293,40 | 0,06 |
| GB00B39J2M42 | United Utilities Group PLC | STK | 4.536 | 1.210 | 0 | GBP | 10,200 | 53.749,07 | 0,11 |
| FI00009005987 | UPM Kymmene Corp. | STK | 4.151 | 1.548 | 0 | EUR | 29,010 | 120.420,51 | 0,24 |
| FR0013176526 | Valéo S.E. | STK | 1.324 | 266 | 0 | EUR | 18,425 | 24.394,70 | 0,05 |
| FI4000074984 | Valmet Oyj | STK | 857 | 459 | 251 | EUR | 23,410 | 20.062,37 | 0,04 |
| FR0000124141 | Veolia Environnement S.A. | STK | 4.288 | 1.821 | 188 | EUR | 23,290 | 99.867,52 | 0,20 |
| AT0000746409 | Verbund AG | STK | 401 | 79 | 0 | EUR | 93,350 | 37.433,35 | 0,08 |
| DK0061539921 | Vestas Wind Systems AS | STK | 6.482 | 1.557 | 0 | DKK | 149,900 | 130.657,19 | 0,26 |
| FR0000125486 | VINCI S.A. | STK | 3.586 | 846 | 145 | EUR | 84,960 | 304.666,56 | 0,61 |
| GB00BD6GN030 | Virgin Money UK PLC | STK | 10.605 | 4.500 | 0 | GBP | 1,308 | 16.108,32 | 0,03 |
| GB0001859296 | Vistry Group PLC | STK | 1.352 | 268 | 0 | GBP | 8,360 | 13.130,48 | 0,03 |
| SE0011205202 | Vitrolife AB | STK | 360 | 1.015 | 655 | SEK | 235,200 | 7.903,56 | 0,02 |
| FR0000127771 | Vivendi S.A. | STK | 4.428 | 1.052 | 336 | EUR | 9,696 | 42.933,89 | 0,09 |
| GB00BH4HKS39 | Vodafone Group PLC | STK | 184.198 | 52.230 | 8.570 | GBP | 1,267 | 271.032,98 | 0,55 |
| AT0000937503 | voestalpine AG | STK | 1.789 | 1.248 | 0 | EUR | 20,280 | 36.280,92 | 0,07 |
| SE0000115446 | Volvo (publ), AB | STK | 9.878 | 2.131 | 0 | SEK | 158,380 | 146.033,39 | 0,29 |
| SE0016844831 | Volvo Car AB | STK | 2.877 | 3.533 | 656 | SEK | 67,960 | 18.250,55 | 0,04 |
| SE0017780133 | Wallenstam AB | STK | 1.818 | 1.818 | 0 | SEK | 44,750 | 7.593,99 | 0,02 |
| BE0974349814 | Warehouses De Pauw N.V. | STK | 814 | 313 | 181 | EUR | 30,000 | 24.420,00 | 0,05 |
| FI0009003727 | Wärtsilä Corp. | STK | 2.484 | 782 | 673 | EUR | 7,430 | 18.456,12 | 0,04 |
| GB0009465807 | Weir Group PLC, The | STK | 1.862 | 596 | 0 | GBP | 13,630 | 29.483,11 | 0,06 |
| FR0000121204 | Wendel SE | STK | 166 | 34 | 0 | EUR | 79,750 | 13.238,50 | 0,03 |
| GB00B1KJJ408 | Whitbread PLC | STK | 1.395 | 410 | 0 | GBP | 24,780 | 40.158,11 | 0,08 |
| AT0000831706 | Wienerberger AG | STK | 721 | 417 | 258 | EUR | 20,480 | 14.766,08 | 0,03 |
| SE0018012635 | Wihlborgs Fastigheter AB | STK | 1.050 | 1.050 | 0 | SEK | 71,550 | 7.012,64 | 0,01 |
| JE00BN574F90 | Wizz Air Holdings PLC | STK | 313 | 104 | 0 | GBP | 17,540 | 6.377,81 | 0,01 |
| NL0000395903 | Wolters Kluwer N.V. | STK | 1.634 | 357 | 28 | EUR | 92,560 | 151.243,04 | 0,31 |
| FR0011981968 | Worldline S.A. | STK | 1.427 | 286 | 0 | EUR | 35,380 | 50.487,26 | 0,10 |
| JE00B8KF9B49 | WPP PLC | STK | 7.107 | 1.426 | 192 | GBP | 8,246 | 68.081,23 | 0,14 |
| NO0010208051 | Yara International ASA | STK | 1.116 | 352 | 70 | NOK | 411,600 | 44.472,53 | 0,09 |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG | STK | 953 | 219 | 0 | CHF | 415,200 | 395.329,80 | 0,80 |
| | | | | | | EUR | | 42.150.961,83 | 85,04 |

Andere Wertpapiere

Ausland

| | | | | | | | | | |
|--------------|----------------------------------|-----|-------|-------|---|-----|---------|--------------|------|
| CH0012032048 | Roche Holding AG - Genussscheine | STK | 4.437 | 1.011 | 0 | CHF | 318,550 | 1.412.135,43 | 2,85 |
|--------------|----------------------------------|-----|-------|-------|---|-----|---------|--------------|------|

| | | | | | | |
|---|-----|------------|--|------------|----------------------|-----------------------------|
| Summe Wertpapiervermögen | | | | CHF | 1.412.135,43 | 2,85 |
| | | | | EUR | 49.360.189,78 | 99,59 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | EUR | 35.928,28 | 0,07 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | |
| Verwahrstelle | EUR | 20.442,34 | | % 100,000 | 20.442,34 | 0,04 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | |
| Verwahrstelle | CHF | 1.694,27 | | % 100,000 | 1.692,75 | 0,00 |
| Verwahrstelle | DKK | 36.023,19 | | % 100,000 | 4.844,01 | 0,01 |
| Verwahrstelle | NOK | 2.807,36 | | % 100,000 | 271,80 | 0,00 |
| Verwahrstelle | PLN | 385,08 | | % 100,000 | 81,93 | 0,00 |
| Verwahrstelle | SEK | 20.553,99 | | % 100,000 | 1.918,58 | 0,00 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | |
| Verwahrstelle | GBP | 5.747,45 | | % 100,000 | 6.676,87 | 0,01 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | EUR | 194.145,14 | 0,39 |
| Dividendenforderungen Aktien | EUR | 22.936,57 | | | 22.936,57 | 0,05 |
| Dividendenforderungen Aktien | GBP | 28.743,25 | | | 33.391,32 | 0,07 |
| Dividendenforderungen Aktien | PLN | 992,25 | | | 211,11 | 0,00 |
| Dividendenforderungen Aktien | SEK | 4.696,64 | | | 438,40 | 0,00 |
| Dividendenforderungen Aktien | USD | 2.131,06 | | | 2.038,41 | 0,00 |
| Dividendenforderungen REITS | EUR | 354,72 | | | 354,72 | 0,00 |
| Dividendenforderungen REITS | GBP | 1.219,98 | | | 1.417,26 | 0,00 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | CHF | 118.128,32 | | | 118.022,10 | 0,24 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | DKK | 55.524,59 | | | 7.466,34 | 0,02 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | EUR | 7.868,91 | | | 7.868,91 | 0,02 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | EUR | -25.010,65 | -0,05 |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | EUR | -25.010,65 | | | -25.010,65 | -0,05 |
| Wert des Teilsongervermögens | | | | EUR | 49.565.252,55 | 100,00 ¹⁾ |
| Anteilwert | | | | EUR | 41,99 | |
| Umlaufende Anteile | | | | STK | 1.180.400 | |

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)

30.06.2022

| | | | |
|-------------------|-------|----------|---------|
| Britisches Pfund | (GBP) | 0,8608 | = 1 EUR |
| Dänische Krone | (DKK) | 7,43665 | = 1 EUR |
| Norwegische Krone | (NOK) | 10,32875 | = 1 EUR |
| Polnischer Zloty | (PLN) | 4,70015 | = 1 EUR |
| Schwedische Krone | (SEK) | 10,71315 | = 1 EUR |
| Schweizer Franken | (CHF) | 1,0071 | = 1 EUR |
| US-Dollar | (USD) | 1,05145 | = 1 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 |
|-------------------------------------|------------------------------------|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE000A0LD2U1 | alstria office REIT-AG | STK | 206 | 1.029 | |
| DE000A2LQ884 | AUTO1 Group SE | STK | 0 | 515 | |
| DE0005470306 | CTS Eventim AG & Co. KGaA | STK | 0 | 286 | |
| DE000DTR0CK8 | Daimler Truck Holding AG | STK | 2.368 | 2.368 | |
| DE000A2E4K43 | Delivery Hero SE | STK | 0 | 918 | |
| DE000A3E5B58 | Deutsche Lufthansa AG - Anrechte | STK | 1.458 | 1.458 | |
| DE000A0HN5C6 | Deutsche Wohnen SE | STK | 0 | 1.633 | |
| DE000ENAG999 | E.ON SE | STK | 2.862 | 13.165 | |
| DE0005664809 | Evotec SE | STK | 0 | 665 | |
| DE000A0Z2ZZ5 | freenet AG | STK | 0 | 625 | |
| DE000A3MQQ17 | Fresenius SE & Co. KGaA - Anrechte | STK | 2.581 | 2.581 | |
| DE000A3E5D64 | Fuchs Petrolub SE | STK | 339 | 339 | |
| DE0005790430 | FUCHS PETROLUB SE | STK | 0 | 339 | |
| DE000A0LD6E6 | Gerresheimer AG | STK | 34 | 172 | |
| DE0006632003 | MorphoSys AG | STK | 0 | 160 | |
| DE000A0D9PT0 | MTU Aero Engines AG | STK | 41 | 301 | |
| DE0006452907 | Nemetschek SE | STK | 0 | 273 | |
| DE0007010803 | RATIONAL AG | STK | 0 | 25 | |
| DE0007030009 | Rheinmetall AG | STK | 0 | 212 | |

| | | | | |
|----------------|--|-----|--------|--------|
| DE0007037129 | RWE AG | STK | 0 | 3.298 |
| DE000A2YN900 | TeamViewer AG | STK | 123 | 908 |
| DE000TUAG000 | TUI AG | STK | 3.168 | 6.864 |
| DE000TUAG1D6 | TUI AG - Anrechte | STK | 9.270 | 9.270 |
| DE000UNSE018 | Uniper SE | STK | 0 | 446 |
| DE000VTSC017 | Vitesco Technologies Group AG | STK | 105 | 105 |
| DE000VTSC0T7 | Vitesco Technologies Group AG - Anrechte | STK | 105 | 105 |
| DE000A3MQB30 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 2.917 | 2.917 |
| DE0005111702 | zooplus AG | STK | 31 | 31 |
| Ausland | | | | |
| NL00150008U6 | Aalberts N.V. - Anrechte | STK | 0 | 420 |
| SE0016589162 | AB Electrolux | STK | 1.123 | 1.123 |
| SE0005127818 | AB Sagax | STK | 2 | 810 |
| NL0015000RQ9 | ABN AMRO Bank N.V. - Anrechte | STK | 2.864 | 2.864 |
| NL0015000M42 | ABN AMRO Bank N.V. - Anrechte | STK | 2.297 | 2.297 |
| BE0003764785 | Ackermans & van Haaren N.V. | STK | 0 | 109 |
| ES06670509J8 | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte | STK | 0 | 1.208 |
| ES0167050204 | ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. | STK | 27 | 27 |
| ES0167050196 | ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. | STK | 63 | 63 |
| ES06670509K6 | ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. - Anrechte | STK | 1.356 | 1.356 |
| SE0014401378 | Addlife AB | STK | 575 | 575 |
| NO0010844038 | Adevinta ASA | STK | 0 | 1.360 |
| GB00B02J6398 | Admiral Group PLC | STK | 0 | 1.165 |
| NL0012969182 | Adyen N.V. | STK | 0 | 137 |
| BE6328934722 | Aedifica S.A. - Anrechte | STK | 0 | 162 |
| NL0015000KA8 | AEGON N.V. - Anrechte | STK | 8.859 | 8.859 |
| NL00150007X2 | AEGON N.V. - Anrechte | STK | 0 | 8.835 |
| SE0005999836 | AF Pöyry AB | STK | 116 | 581 |
| FR0000120073 | Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.CI. | STK | 1 | 2.311 |
| NL0000235190 | Airbus SE | STK | 0 | 2.839 |
| LU2237380790 | Allegro.eu | STK | 0 | 1.882 |
| GB00BNTJ3546 | Allfunds Group Ltd. | STK | 9 | 1.699 |
| CH0008837566 | Allreal Holdings AG | STK | 11 | 82 |
| FR0014004J72 | Alstom S.A. - Anrechte | STK | 1.496 | 1.496 |
| IT0004056880 | Amplifon S.p.A. | STK | 100 | 738 |
| NL0015000TM4 | ArcelorMittal S.A. - Anrechte | STK | 4.682 | 4.682 |
| NL0010832176 | argenx SE | STK | 1 | 251 |
| LU2353086064 | Aroundtown SA - Anrechte | STK | 4.759 | 4.759 |
| GB00B132NW22 | Ashmore Group PLC | STK | 376 | 2.774 |
| GB00BVBGWW93 | Assura PLC | STK | 2.055 | 15.103 |
| SE0017486863 | Atlas Copco AB | STK | 4.003 | 4.003 |
| SE0011166610 | Atlas Copco AB | STK | 0 | 3.143 |
| SE0012454072 | Avanza Bank Holding AB | STK | 0 | 603 |
| GB00BBG9VN75 | AVEVA Group PLC | STK | 0 | 608 |
| GB0002162385 | Aviva PLC | STK | 0 | 19.163 |
| LU1072616219 | B & M Europ.Value Retail S.A. | STK | 0 | 4.345 |
| GB0002634946 | BAE Systems PLC | STK | 0 | 15.742 |
| IT0005218380 | Banco BPM S.p.A. | STK | 0 | 7.389 |
| PLPEKAO00016 | Bank Polska Kasa Opieki S.A. | STK | 0 | 860 |
| SE0015949748 | Beijer Ref AB | STK | 0 | 1.205 |
| GB00B02L3W35 | Berkeley Group Holdings PLC | STK | 0 | 593 |
| AU000000BHP4 | BHP Group Ltd. | STK | 927 | 927 |
| GB00BH0P3Z91 | BHP Group PLC | STK | 2.543 | 12.843 |
| SE0018015653 | BillerudKorsnäs AB | STK | 377 | 377 |
| SE0018015646 | BillerudKorsnäs AB - Anrechte | STK | 1.889 | 1.889 |
| SE0017768724 | Boliden AB | STK | 2.380 | 2.380 |
| SE0015811559 | Boliden AB | STK | 0 | 1.334 |
| GB00BND88V85 | Bridgepoint Advisers Group PLC | STK | 3.092 | 3.092 |
| GB0002875804 | British American Tobacco PLC | STK | 0 | 10.454 |
| GB0031215220 | Carnival PLC | STK | 0 | 772 |
| PLOPTTC00011 | CD Projekt S.A. | STK | 0 | 344 |
| CH0225173167 | Cembra Money Bank AG | STK | 0 | 146 |
| FR0000130403 | Christian Dior SE | STK | 0 | 22 |
| FR0000121261 | Cie Génle Éts Michelin SCpA | STK | 3.350 | 4.176 |
| GB0007668071 | Close Brothers Group PLC | STK | 0 | 742 |
| FR0000120222 | CNP Assurances S.A. | STK | 879 | 879 |
| BE6335049761 | Cofinimmo S.A. - Anrechte | STK | 181 | 181 |
| NL0010583399 | Corbion N.V. | STK | 39 | 285 |
| GB00BYPHNG03 | Countryside Properties PLC | STK | 572 | 2.891 |
| GB00BNYK8G86 | Darktrace PLC | STK | 1.608 | 1.608 |
| FR0014004L86 | Dassault Aviation S.A. | STK | 110 | 110 |
| FR0000121725 | Dassault Aviation S.A. | STK | 0 | 11 |
| FR0000130650 | Dassault Systemes SE | STK | 2.776 | 3.470 |
| GB00BNC5T391 | Deliveroo PLC | STK | 0 | 5.416 |
| FR00140085J3 | Diageo PLC - Anrechte | STK | 14.176 | 14.176 |
| GB0059822006 | Dialog Semiconductor PLC | STK | 0 | 348 |
| IT0003492391 | Diasorin S.p.A. | STK | 32 | 159 |
| PLDINPL00011 | Dino Polska S.A. | STK | 0 | 234 |
| NO0010031479 | DNB ASA | STK | 0 | 4.356 |
| GB00BL6NGV24 | Dr. Martens PLC | STK | 3.313 | 6.097 |
| GB00B7KR2P84 | EasyJet PLC | STK | 0 | 1.114 |
| GB00BMY5XK54 | easyJet PLC - Anrechte | STK | 734 | 734 |

| | | | | |
|--------------|---|-----|--------|--------|
| PTEDP0AM0009 | EDP - Energias de Portugal SA | STK | 0 | 14.267 |
| FR00140063V5 | Electricité de France (E.D.F.) - Anrechte | STK | 2.892 | 2.892 |
| FR0014008WS3 | Electricité de France S.A. (E.D.F.) - Anrechte | STK | 3.116 | 3.116 |
| FR0014009IA8 | Electricité de France S.A. (E.D.F.) - Anrechte | STK | 3.594 | 3.594 |
| SE0000103814 | Electrolux, AB | STK | 0 | 1.123 |
| BE0970178811 | Elia Group - Anrechte | STK | 171 | 171 |
| FR0014009UZ0 | Elis S.A. - Anrechte | STK | 1.111 | 1.111 |
| CH0016440353 | Ems-Chemie Holding AG | STK | 0 | 33 |
| ES0130670112 | Endesa S.A. | STK | 0 | 1.544 |
| IT0003128367 | ENEL S.p.A. | STK | 0 | 37.886 |
| NO0010716418 | Entra ASA | STK | 97 | 896 |
| FR0014002ZS9 | EssilorLuxottica S.A. - Anrechte | STK | 0 | 1.302 |
| FR0014009LO3 | EssilorLuxottica S.A. - Anrechte | STK | 1.902 | 1.902 |
| BE0974256852 | Établissements Fr. Colruyt SA | STK | 75 | 321 |
| FR0014008VX5 | EuroAPI SAS | STK | 310 | 310 |
| SE0012673267 | Evolution AB (publ) | STK | 87 | 937 |
| GB00B71N6K86 | Evraz PLC | STK | 701 | 3.541 |
| NL0012059018 | EXOR N.V. | STK | 0 | 553 |
| SE0000455057 | Fastighets AB Balder | STK | 0 | 510 |
| FR0014008SJ0 | Faurecia SE - Anrechte | STK | 793 | 793 |
| ES0118900176 | Ferrovial S.A. | STK | 34 | 34 |
| ES0118900184 | Ferrovial S.A. | STK | 37 | 37 |
| ES0618900915 | Ferrovial S.A. - Anrechte | STK | 2.992 | 2.992 |
| ES06189009J3 | Ferrovial S.A. - Anrechte | STK | 3.259 | 3.259 |
| CH0001752309 | Fischer AG, Georg | STK | 480 | 500 |
| CH0319416936 | Flughafen Zürich AG | STK | 0 | 92 |
| IE00BWT6H894 | Flutter Entertainment PLC | STK | 37 | 855 |
| FI0009007132 | Fortum Oyj | STK | 1.340 | 3.473 |
| GB00BYZN9041 | Future PLC | STK | 0 | 554 |
| BE0003818359 | Galapagos N.V. | STK | 0 | 214 |
| CH0360674466 | Galenica AG | STK | 0 | 244 |
| GB0003718474 | Games Workshop Group PLC | STK | 0 | 160 |
| DK0010272202 | GENMAB AS | STK | 0 | 320 |
| GB0002074580 | Genus PLC | STK | 2 | 321 |
| JE00B4T3BW64 | Glencore PLC | STK | 13.689 | 66.806 |
| LU0775917882 | Grand City Properties S.A. | STK | 101 | 595 |
| LU2356307962 | Grand City Properties S.A. - Anrechte | STK | 494 | 494 |
| GB00B1VZOM25 | Hargreaves Lansdown PLC | STK | 270 | 1.994 |
| SE0007074281 | Hexpol AB | STK | 974 | 2.237 |
| BMG4593F1389 | Hiscox Ltd. | STK | 0 | 1.726 |
| GB00BYTTFB60 | Homeserve PLC | STK | 1 | 1.441 |
| ES06445809N8 | Iberdrola S.A. - Anrechte | STK | 32.796 | 32.796 |
| ES0144583244 | Iberdrola S.A. | STK | 714 | 714 |
| ES0144583251 | Iberdrola S.A. | STK | 546 | 546 |
| ES06445809M0 | Iberdrola S.A. - Anrechte | STK | 28.581 | 28.581 |
| SE0000652216 | ICA Gruppen AB | STK | 71 | 522 |
| CH0363463438 | Idorsia AG | STK | 1 | 536 |
| GB00B06QFB75 | IG Group Holdings PLC | STK | 299 | 2.105 |
| GB0004544929 | Imperial Brands PLC | STK | 0 | 4.615 |
| GB00B61TVQ02 | Inchcape PLC | STK | 0 | 1.792 |
| LU2290522684 | InPost S.A. | STK | 0 | 1.316 |
| NL0015000LU4 | Iveco Group N.V. | STK | 1.125 | 1.125 |
| JE00BYVQYS01 | IWG PLC | STK | 0 | 3.757 |
| US46817M1071 | Jackson Financial Inc. | STK | 318 | 318 |
| GB00BYX91H57 | JD Sports Fashion PLC | STK | 11.580 | 14.000 |
| NL0014332678 | JDE Peet's N.V. | STK | 85 | 624 |
| NL0012015705 | Just Eat Takeaway.com N.V. | STK | 5 | 883 |
| PLKGHM000017 | KGHM Polska Miedz S.A. | STK | 0 | 665 |
| NL0015000JX2 | Koninklijke DSM N.V. - Anrechte | STK | 852 | 852 |
| NL0015000VU3 | Koninklijke DSM N.V. - Anrechte | STK | 1.077 | 1.077 |
| NL0015000VF4 | Koninklijke Philips N.V. - Anrechte | STK | 5.503 | 5.503 |
| NL0009432491 | Koninklijke Vopak N.V. | STK | 49 | 362 |
| SE0000108847 | L E Lundbergföretagen AB | STK | 0 | 359 |
| SE0010100958 | Latour Investment AB | STK | 0 | 710 |
| DE000LEG1243 | LEG Immobilien SE - Anrechte | STK | 443 | 443 |
| IT0003856405 | Leonardo S.p.A. | STK | 0 | 1.968 |
| SE0015949201 | Lifco AB | STK | 272 | 1.378 |
| SE0000825820 | Lundin Energy AB | STK | 229 | 1.158 |
| GB0005758098 | Meggitt PLC | STK | 0 | 3.811 |
| GB00BNR5MZ78 | Melrose Industries PLC | STK | 20.200 | 20.200 |
| GB00BZ1G4322 | Melrose Industries PLC | STK | 0 | 22.445 |
| SE0018012759 | Millicom International Cellular S.A. - Anrechte | STK | 371 | 371 |
| GB0006043169 | Morrison Supermarkets PLC, Wm. | STK | 47 | 11.799 |
| FR0000120685 | Natixis S.A. | STK | 0 | 4.539 |
| NO0010081235 | NEL ASA - Anrechte | STK | 0 | 7.107 |
| GB00BJHPLV88 | Ninety One PLC | STK | 646 | 646 |
| NL0015000US9 | NN Group N.V. - Anrechte | STK | 1.981 | 1.981 |
| NL0015000K51 | NN Group N.V. - Anrechte | STK | 1.550 | 1.550 |
| FI0009005318 | Nokian Renkaat Oyj | STK | 300 | 918 |
| SE0015192067 | Nordnet AB [publ] | STK | 707 | 707 |
| GB00B3MBS747 | Ocado Group PLC | STK | 773 | 3.875 |
| FR0000184798 | Orpea | STK | 62 | 316 |
| DK0060094928 | Orsted A/S | STK | 0 | 920 |

| | | | | |
|--------------|--------------------------------------|-----|--------|--------|
| GB00B18V8630 | Pennon Group PLC | STK | 0 | 2.059 |
| GB0006825383 | Persimmon PLC | STK | 2.157 | 3.713 |
| PLPKN0000018 | Polski Koncern Naftowy Orlen | STK | 0 | 1.512 |
| JE00B6T5S470 | Polymetal Intl PLC | STK | 433 | 2.191 |
| GB00BYRJ5J14 | Primary Health Properties PLC | STK | 8 | 6.495 |
| NL0015000LD0 | Prosus N.V. - Anrechte | STK | 4.357 | 4.357 |
| CH0018294154 | PSP Swiss Property AG | STK | 0 | 224 |
| FR0014003307 | Publicis Groupe S.A. - Anrechte | STK | 0 | 1.128 |
| FI4000198031 | QT Group PLC | STK | 96 | 96 |
| GB00BDCXV269 | Quilter PLC | STK | 1.801 | 9.402 |
| GB00BNHSJN34 | Quilter PLC | STK | 7.688 | 7.688 |
| GB00BGDT3G23 | Rightmove PLC | STK | 0 | 4.267 |
| GB0007188757 | Rio Tinto PLC | STK | 0 | 5.234 |
| GB00B63H8491 | Rolls Royce Holdings PLC | STK | 0 | 40.808 |
| GB00B03MLX29 | Royal Dutch Shell | STK | 45.338 | 65.339 |
| NL0015000JR4 | Royal Dutch Shell PLC - Anrechte | STK | 20.001 | 20.001 |
| FR0014003EX2 | Rubis S.C.A. - Anrechte | STK | 0 | 480 |
| GB00BFZM640 | S4 Capital PLC | STK | 2 | 2.241 |
| FR0000073272 | SAFRAN | STK | 0 | 1.850 |
| GB00B8C3BL03 | Sage Group PLC, The | STK | 806 | 6.272 |
| NO0010310956 | Salmar ASA | STK | 371 | 634 |
| NO0010715139 | Scatec ASA | STK | 0 | 578 |
| NO0003028904 | Schibsted ASA | STK | 92 | 462 |
| LU0088087324 | SES S.A. | STK | 0 | 1.870 |
| GB00BP6MXD84 | Shell PLC | STK | 46.924 | 46.924 |
| NL0015000RK2 | Shell PLC - Anrechte | STK | 46.924 | 46.924 |
| CH0014284498 | Siegfried Holding AG | STK | 0 | 21 |
| SE0016101844 | Sinch AB | STK | 65 | 4.772 |
| BE0003717312 | Sofina S.A. | STK | 0 | 76 |
| GB00BYZDVK82 | Softcat PLC | STK | 479 | 1.133 |
| CH0002178181 | Stadler Rail AG | STK | 0 | 285 |
| CH0012280076 | Straumann Holding AG | STK | 0 | 56 |
| FR0010613471 | Suez S.A. | STK | 341 | 2.371 |
| CH0012255151 | Swatch Group AG, The | STK | 35 | 176 |
| SE0015812219 | Swedish Match AB | STK | 0 | 7.706 |
| GB0008754136 | Tate & Lyle PLC | STK | 0 | 2.285 |
| GB00BDSFG982 | TechnipFMC PLC | STK | 334 | 2.404 |
| ES0178430122 | Telefónica S.A. | STK | 1.223 | 1.223 |
| ES0178430130 | Telefónica S.A. | STK | 1.148 | 1.148 |
| ES0178430106 | Telefónica S.A. | STK | 0 | 1.147 |
| ES06784309F4 | Telefónica S.A. - Anrechte | STK | 31.810 | 31.810 |
| ES06784309G2 | Telefónica S.A. - Anrechte | STK | 35.603 | 35.603 |
| NO0010063308 | Telenor ASA | STK | 492 | 3.634 |
| FR0000121329 | THALES S.A. | STK | 0 | 517 |
| GB00BMTV7393 | THG PLC - Anrechte | STK | 589 | 4.758 |
| NO0005668905 | Tomra Systems ASA | STK | 0 | 570 |
| FR0000054470 | Ubisoft Entertainment S.A. | STK | 1 | 506 |
| IE0033024807 | UDG Healthcare PLC | STK | 0 | 1.265 |
| NL0015000IY2 | Universal Music Group N.V. | STK | 3.820 | 3.820 |
| CH0311864901 | VAT Group AG | STK | 0 | 132 |
| FR0014005GA0 | Veolia Environnement S.A. - Anrechte | STK | 2.655 | 2.655 |
| GB0009292243 | Victrex PLC | STK | 0 | 424 |
| CH0364749348 | Vifor Pharma AG | STK | 100 | 330 |
| DE000A3MQQ33 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 4.334 | 4.334 |
| SE0007074844 | Wallenstam AB | STK | 0 | 1.018 |
| BE6334755731 | Warehouses De Pauw N.V. - Anrechte | STK | 911 | 911 |
| GB00BJDQQ870 | Watches Of Switzerland Group PLC | STK | 1.476 | 1.476 |
| GB00B2PDGW16 | WH Smith PLC | STK | 101 | 739 |
| SE0011205194 | Wihlborgs Fastigheter AB | STK | 0 | 671 |
| GB00BL9YR756 | Wise PLC | STK | 2.139 | 2.139 |
| NL0015000QW9 | Wolters Kluwer N.V. - Anrechte | STK | 1.634 | 1.634 |
| NL0015000K69 | Wolters Kluwer N.V. - Anrechte | STK | 1.305 | 1.305 |
| CH0042615283 | Zur Rose Group AG | STK | 0 | 47 |

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2021 bis zum 30.06.2022

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 241.272,46 | 0,204 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 1.499.740,91 | 1,271 |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | 6,89 | 0,000 |
| 4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer) | | 6,23 | 0,000 |
| davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern | 6,23 | | 0,000 |
| 5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -32.582,08 | -0,028 |
| 6. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -120.481,88 | -0,102 |
| 7. Sonstige Erträge | | 66,04 | 0,000 |
| Summe der Erträge | | 1.588.028,57 | 1,345 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme | | -176,66 | 0,000 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -104.421,05 | -0,088 |
| 3. Sonstige Aufwendungen | | -486,49 | 0,000 |
| davon: Verwahrtgelt | -486,49 | | 0,000 |
| Summe der Aufwendungen | | -105.084,20 | -0,089 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 1.482.944,37 | 1,256 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 2.259.161,46 | 1,914 |
| 2. Realisierte Verluste | | -918.756,67 | -0,778 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 1.340.404,79 | 1,136 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 2.823.349,16 | 2,392 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -4.093.807,50 | -3,468 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -2.888.076,79 | -2,447 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -6.981.884,29 | -5,915 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -4.158.535,13 | -3,523 |

Entwicklung des Teilsongervermögens

| | 2021 / 2022 |
|--|----------------------|
| | EUR |
| I. Wert des Teilsongervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | 48.961.655,32 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | -947.381,60 |
| 2. Mittelzufluss (netto) | 5.845.203,58 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 6.587.266,97 |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -742.063,39 |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | -135.689,62 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | -4.158.535,13 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | -4.093.807,50 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -2.888.076,79 |
| II. Wert des Teilsongervermögens am Ende des Geschäftsjahres | 49.565.252,55 |

Verwendung der Erträge des Teilsongervermögens

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|---------------------|--------------------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 7.819.262,25 | 6,624 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 39.387,83 | 0,033 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 2.823.349,16 | 2,392 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen ²⁾ | | 4.956.525,26 | 4,199 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 6.485.410,25 | 5,494 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 0,00 | 0,000 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 6.485.410,25 | 5,494 |
| III. Gesamtausschüttung | | 1.333.852,00 | 1,130 |
| 1. Endausschüttung | | 1.333.852,00 | 1,130 |

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

2) Die Zuführung aus dem Sondervermögen dient dem Ausgleich von im Geschäftsjahr realisierten Verluste, die damit bei der Berechnung der Ausschüttung unberücksichtigt bleiben; im Ergebnis kann sich damit für das laufende oder für künftige Geschäftsjahre eine Substanzausschüttung im investimentrechtlichen Sinne ergeben.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Teilsongervermög am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|---|-------------------|
| 2021/2022 | 49.565.252,55 | 41,99 |
| 2020/2021 | 48.961.655,32 | 46,28 |
| 2019/2020 | 27.459.918,18 | 36,85 |
| 2018/2019 | 15.600.332,88 | 39,67 |

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

| | | |
|-----------------------------|------------|------------------|
| | | DE000ETF9603 |
| Anteilwert | EUR | 41,99 |
| Umlaufende Anteile | STK | 1.180.400 |
| Anleger | | Private Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | % | 5,00 |
| Aktueller Rücknahmeabschlag | % | 5,00 |
| Verwaltungsvergütung p. a. | % | 0,19 |
| Ertragsverwendung | | ausschüttend |

Bestand der Wertpapiere am Teilsongervermögen (in %)

99,59

Bestand der Derivate am Teilsongervermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

| | |
|--|---|
| Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände | zum Nennwert |
| Verbindlichkeiten | zum Rückzahlungsbetrag |
| Fremdwährungsumrechnung | auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters |

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

| | |
|--|-------|
| Korrekturbuchung Dividende aus Vorjahr | 27,12 |
| CSDR Erträge | 36,34 |

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

| | |
|------------------------|--------|
| Negative Einlagezinsen | 466,16 |
|------------------------|--------|

Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsongervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsongervermögens aus.

0,19

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsongervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendungserstattungen, mit denen das jeweilige Teilsongervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsongervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl.

Ertragsausgleich

| | | |
|--|-----|-----------|
| Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF | | |
| Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut, vor Ertragsausgleich) | EUR | 99.207,60 |
| Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft | % | -35,98 |
| Davon für die Verwahrstelle | % | 81,13 |
| Davon für Dritte | % | 54,85 |

Transaktionskosten

EUR

30.453,68

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Lyxor Funds Solutions S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsongervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsongervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 82,18 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 24.074.838,98 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsongervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

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 für Indexfonds gem. §16 (2) KARBV

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilsongervermögens und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilsongervermögen erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen

Teilsondervermögens.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Der ETF hat eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums 0,17%
Höhe der Annual Tracking Difference 0,00%

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Angaben zur Vergütung gemäß KAGB § 101 (4) 1.-5.:

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“) hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2022 überprüft.

Zum 1. Juli 2022 wurde die LFS auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Da dieser Bericht den Zeitraum zwischen dem 1. Januar 2022 und dem 30. Juni 2022 abdeckt, hat dies keine Auswirkungen auf diesen Jahresbericht.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA;
- im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.313 TEUR (92,40%) und der variable Teil 108 TEUR (7,60%). Die Gesamtvergütung betrug 1.421 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 17,07
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 36,40
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,30
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.742 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (36). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 275,24

Gemäß Kapitel 7 der ESMA Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31.03.2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an. Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- folgende Risk-Taker benannt hat: Mathias Turra, Martine Capus, Dr. Qi Chen und Martin Rausch (bis zum 29.04.2022)
- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW Instrumenten vornimmt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht anwendet.

Eine Änderung der Vergütungspolitik ist bis dato nicht erfolgt. Eine Überprüfung der Vergütungspolitik nach Art. 14b Abs. 1 Buchstabe c und d sowie ggf. eine Änderung derselben, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2022.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der EU-Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website <https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor> eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Transparenz bei der Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale in regelmäßigen Berichten

Gemäß Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (die "SFDR-Verordnung") wird das Ausmaß, inwieweit die ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, anhand der nachstehenden Indikatoren beschrieben:

| | | | | |
|--------------------------------------|-------|------|-------|-----|
| % unabhängige Vorstandsmitglieder | 83.2% | 99% | 83.3% | 83% |
| Gewichteter Durchschnitt der | 112.2 | 100% | 138.0 | 99% |
| % Frauen an Bord | 39.1% | 99% | 39.2% | 99% |
| Einhaltung der Menschenrechte | | 99% | | 99% |
| - Bestehen | 91.0% | | 88.1% | |
| - Scheitern | 0.7% | | 0.6% | |
| - Beobachtungsliste | 7.7% | | 10.6% | |
| Bewertung von Menschenrechtsbelangen | | 99% | | 99% |
| - Keine Bedenken | 84.2% | | 82.6% | |
| - Unerheblich | 9.5% | | 8.5% | |
| - Mäßig | 5.9% | | 8.5% | |
| - Stark | 0.5% | | 0.4% | |
| - Sehr ernst | 0.0% | | 0.0% | |
| Übergangspunktzahl | 6.0 | 100% | 5.9 | 99% |

Ein Maß für das Engagement des Portfolios gegenüber den CO₂-intensivsten Unternehmen, das sich in der durchschnittlichen CO₂-Intensität der Unternehmen widerspiegelt (CO₂-Emissionen normalisiert durch den Umsatz). Die CO₂-Intensität des Portfolios wird als gewichteter Durchschnitt der CO₂-Intensität der zugrunde liegenden Emittenten berechnet. Maßnahmen berücksichtigen nicht alle vom Unternehmen verursachten Emissionen, insbesondere solche im Zusammenhang mit der Verwendung von Produkten oder vorgelagerten durch Lieferanten (Scope 3).

Übergangspunktzahl

Dieser Indikator zielt darauf ab, potenzielle Vorreiter und Nachzügler zu identifizieren, indem Unternehmen ganzheitlich in Bezug auf ihre Exposition und ihr Management von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft gemessen werden.

Ein Score auf Unternehmensebene, der den Grad der Ausrichtung eines Unternehmens auf die Low Carbon Transition misst.

Bewertung von Menschenrechtsbelangen

Diese Indikatoren zeigen an, ob ein Unternehmen Reputations- und Betriebsrisiken aufgrund von schwerwiegenden und/oder sehr wichtigen (Verstößen in Bezug auf soziale Belange wie das Management von Humankapital und Arbeitskräften) ausgesetzt ist.

Einhaltung der Menschenrechte

Dieser Faktor gibt an, ob das Unternehmen die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte einhält. Mögliche Werte sind Fail, Watch List oder Pass.

% Frauen an Bord

Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder. Bei Gesellschaften mit dualistischem Vorstand bezieht sich die Berechnung nur auf die Mitglieder des Aufsichtsrats. % **unabhängige Vorstandsmitglieder**

Der Prozentsatz der Vorstandsmitglieder, die unsere festgelegten Kriterien für die Unabhängigkeit erfüllen. Bei Unternehmen mit einem zweistufigen Vorstand basiert die Berechnung nur auf den Mitgliedern des Aufsichtsrats.

Transparenz umweltverträglicher Investitionen in regelmäßigen Berichten

Der Teilfonds bewirbt ökologische Merkmale im Sinne des Artikel 6 der Verordnung (EU) 2020/852 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088 (die "Taxonomie-Verordnung").

Die Taxonomie-Verordnung zielt darauf ab, wirtschaftliche Aktivitäten zu identifizieren, die als ökologisch nachhaltig gelten (die "nachhaltigen Aktivitäten").

In der Taxonomie-Verordnung werden solche Tätigkeiten nach ihrem Beitrag zu sechs Umweltzielen unterschieden: (i) Klimaschutz; (ii) Anpassung an den Klimawandel; (iii) nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen; (iv) Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft; (v) Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung; (vi) Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme.

Eine Wirtschaftstätigkeit gilt als ökologisch nachhaltig, wenn sie einen wesentlichen Beitrag zu einem oder mehreren der sechs Umweltziele leistet, keines der Umweltziele erheblich beeinträchtigt (Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“) und unter Einhaltung des in Artikel 18 der Taxonomie-Verordnung festgelegten Mindestschutzes durchgeführt wird. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Kriterien der Europäischen Union für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Dieser Teilfonds kann in Wirtschaftstätigkeiten investieren, die zu den folgenden, in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen beitragen, ist jedoch nicht verpflichtet zum Datum dieses Jahresberichts in diese zu investieren: Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel.

Der Teilfonds strebt an, den Anlegern einen Ertrag zukommen zu lassen, der an die Wertentwicklung des STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net

Return anknüpft, dabei kommen nur Unternehmen in Frage, die konform auf Basis der Global Standards Screening-Bewertung des ESG-Datenanbieter Sustainalytics und nicht in umstrittene Waffen involviert sind.

Im Einklang mit dem Anlageziel und um einen Beitrag zu den oben genannten Umweltzielen zu leisten, wird erwartet, dass dieser Teilfonds in Wirtschaftstätigkeiten investiert, die gemäß der Taxonomie-Verordnung förderfähig sind, einschließlich, aber nicht beschränkt sind auf alternative Energie und Kohlenstoffenergie sowie CO₂-Effizienz.

Zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresberichts liegen nur unzureichend zuverlässige und überprüfbare Daten vor, auf deren Basis die Investitionen bezüglich der technischen Screeningkriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten bewertet werden konnten. Dementsprechend bestehen Auslegungsunsicherheiten für die Offenlegungs- und Taxonomie-Verordnung und deren delegierte Rechtsakte.

Für die Zwecke der Taxonomieverordnung beträgt daher der Prozentsatz der Anlagen des Teilfonds, der in Anlagen investiert wird, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen, 0%.

Ab der vollständigen Verfügbarkeit der Daten und der Fertigstellung der entsprechenden Berechnungsmethoden wird die Beschreibung, in welchem Umfang die dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen in nachhaltige Aktivitäten getätigt werden, den Anlegern zur Verfügung gestellt.

Bei Fragen zur Taxonomie-Verordnung wenden Sie sich bitte an die Verwaltungsgesellschaft unter der folgenden E-Mail-Adresse: info@lyxoretf.de.

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag:

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A..

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Teilsonderver- mögens |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 192.103.262,03 | 100,06 |
| 1. Aktien | | 191.974.442,24 | 100,00 |
| - Banken | 5.147.751,95 | | 2,68 |
| - Bau und Baustoffe | 1.390.739,76 | | 0,72 |
| - Bergbau | 989.044,45 | | 0,52 |
| - Chemische Industrie | 30.596.606,32 | | 15,94 |
| - Einzelhandel | 4.000.573,38 | | 2,08 |
| - Elektrik / Elektronik | 8.196.172,48 | | 4,27 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 21.000.163,37 | | 10,94 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 26.810.626,52 | | 13,97 |
| - Real Estate | 6.734.858,07 | | 3,51 |
| - Software | 13.498.751,19 | | 7,03 |
| - Sonstige Finanzdienstleistungen | 6.277.387,20 | | 3,27 |
| - Sonstige industrielle Werte | 13.722.835,98 | | 7,15 |
| - Telekommunikation | 15.391.795,22 | | 8,02 |
| - Textilien und Kleidung | 7.492.089,36 | | 3,90 |
| - Transportation | 8.491.860,27 | | 4,42 |
| - Versicherungen | 22.233.186,72 | | 11,58 |
| 2. Forderungen | | 41.334,76 | 0,02 |
| 3. Bankguthaben | | 87.485,03 | 0,05 |
| II. Verbindlichkeiten | | -124.361,66 | -0,06 |
| III. Teilsondervermögen | 191.978.900,37 | 100,00 1) | |

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Teilsonder ver- mögens | |
|---|------------------------------|-------|--|-----------------------|-------------------|----------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------|
| | | | | im Berichtszeitraum | | | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | | |
| DE000A1EWWW0 | adidas AG | STK | 36.372 | 15.749 | 9.483 | EUR | 168,760 | 6.138.138,72 | 3,20 | |
| DE0008404005 | Allianz SE | STK | 75.356 | 43.888 | 30.583 | EUR | 182,120 | 13.723.834,72 | 7,15 | |
| DE0006766504 | Aurubis AG | STK | 6.464 | 6.714 | 250 | EUR | 64,760 | 418.608,64 | 0,22 | |
| DE000BASF111 | BASF SE | STK | 193.263 | 89.985 | 49.242 | EUR | 41,525 | 8.025.246,08 | 4,18 | |
| DE000BAY0017 | Bayer AG | STK | 210.443 | 91.567 | 44.262 | EUR | 56,720 | 11.936.326,96 | 6,22 | |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke AG | STK | 68.641 | 32.879 | 17.450 | EUR | 73,460 | 5.042.367,86 | 2,63 | |
| DE0005200000 | Beiersdorf AG | STK | 20.961 | 9.393 | 4.681 | EUR | 97,480 | 2.043.278,28 | 1,06 | |
| DE000A1DAHH0 | Brenntag SE | STK | 33.095 | 14.897 | 7.458 | EUR | 62,100 | 2.055.199,50 | 1,07 | |
| DE0005313704 | Carl Zeiss Meditec AG | STK | 7.828 | 3.471 | 1.712 | EUR | 113,900 | 891.609,20 | 0,46 | |
| DE000CBK1001 | Commerzbank AG | STK | 226.416 | 109.382 | 48.068 | EUR | 6,686 | 1.513.817,38 | 0,79 | |
| DE0005439004 | Continental AG | STK | 23.135 | 11.671 | 6.471 | EUR | 66,500 | 1.538.477,50 | 0,80 | |
| DE0006062144 | Covestro AG | STK | 40.822 | 20.112 | 11.366 | EUR | 32,980 | 1.346.309,56 | 0,70 | |
| DE0007100000 | Daimler AG | STK | 168.438 | 101.737 | 72.722 | EUR | 55,220 | 9.301.146,36 | 4,84 | |
| DE0005140008 | Deutsche Bank AG | STK | 436.876 | 194.029 | 100.252 | EUR | 8,318 | 3.633.934,57 | 1,89 | |
| DE0005810055 | Deutsche Börse AG | STK | 39.332 | 17.635 | 8.778 | EUR | 159,600 | 6.277.387,20 | 3,27 | |
| DE0008232125 | Deutsche Lufthansa AG | STK | 194.187 | 166.789 | 55.930 | EUR | 5,564 | 1.080.456,47 | 0,56 | |
| DE0005552004 | Deutsche Post AG | STK | 207.370 | 92.508 | 48.301 | EUR | 35,740 | 7.411.403,80 | 3,86 | |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | STK | 739.687 | 365.313 | 160.991 | EUR | 18,946 | 14.014.109,90 | 7,30 | |
| DE000EVNK013 | Evonik Industries AG | STK | 43.921 | 21.640 | 9.515 | EUR | 20,360 | 894.231,56 | 0,47 | |
| DE000A0Z2Z25 | freenet AG | STK | 25.459 | 11.687 | 8.405 | EUR | 23,670 | 602.614,53 | 0,31 | |
| DE0005785802 | Fresenius Medical Care KGaA | STK | 19.223 | 9.618 | 9.618 | EUR | 47,630 | 2.027.751,99 | 1,06 | |
| DE0005785604 | Fresenius SE & Co. KGaA | STK | 88.798 | 40.321 | 19.843 | EUR | 28,900 | 2.566.262,20 | 1,34 | |
| DE0006602006 | GEA Group AG | STK | 32.260 | 14.629 | 6.979 | EUR | 32,890 | 1.061.031,40 | 0,55 | |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | STK | 12.860 | 5.763 | 2.872 | EUR | 138,500 | 1.781.110,00 | 0,93 | |
| DE0006047004 | HeidelbergCement AG | STK | 30.339 | 13.987 | 8.185 | EUR | 45,840 | 1.390.739,76 | 0,72 | |
| DE0006048432 | Henkel AG & Co. KGaA | STK | 36.389 | 16.181 | 8.765 | EUR | 58,780 | 2.138.945,42 | 1,11 | |
| DE000A1PHFF7 | HUGO BOSS AG | STK | 12.449 | 13.557 | 1.108 | EUR | 50,360 | 626.931,64 | 0,33 | |
| DE0006231004 | Infineon Technologies AG | STK | 278.872 | 126.773 | 63.999 | EUR | 23,090 | 6.439.154,48 | 3,35 | |
| DE000KSAG888 | K+S Aktiengesellschaft | STK | 40.999 | 42.649 | 1.650 | EUR | 23,190 | 950.766,81 | 0,50 | |
| DE000KGX8881 | KION GROUP AG | STK | 15.367 | 6.811 | 3.357 | EUR | 39,590 | 608.379,53 | 0,32 | |
| DE000KBX1006 | Knorr-Bremse AG | STK | 14.161 | 6.277 | 3.094 | EUR | 54,420 | 770.641,62 | 0,40 | |
| DE0005470405 | LANXESS AG | STK | 17.512 | 7.765 | 3.829 | EUR | 34,180 | 598.560,16 | 0,31 | |
| DE000LEG1110 | LEG Immobilien SE | STK | 15.603 | 7.127 | 3.496 | EUR | 79,120 | 1.234.509,36 | 0,64 | |
| DE0006599905 | Merck KGaA | STK | 27.685 | 12.464 | 6.241 | EUR | 161,000 | 4.457.285,00 | 2,32 | |
| DE0008430026 | Münchener Rückvers.-Ges. AG | STK | 30.010 | 13.612 | 6.866 | EUR | 224,200 | 6.728.242,00 | 3,50 | |
| DE000PAH0038 | Porsche Automobil Holding SE | STK | 32.801 | 15.053 | 7.679 | EUR | 63,120 | 2.070.399,12 | 1,08 | |
| DE0006969603 | PUMA SE | STK | 21.546 | 11.003 | 4.675 | EUR | 62,840 | 1.353.950,64 | 0,71 | |
| DE0007164600 | SAP SE | STK | 155.283 | 78.846 | 37.638 | EUR | 86,930 | 13.498.751,19 | 7,03 | |
| DE0007165631 | Sartorius AG | STK | 5.270 | 2.364 | 1.179 | EUR | 333,400 | 1.757.018,00 | 0,92 | |
| DE000A12DM80 | Scout24 AG | STK | 15.821 | 7.097 | 5.258 | EUR | 48,990 | 775.070,79 | 0,40 | |
| DE0007236101 | Siemens AG | STK | 133.404 | 72.795 | 40.241 | EUR | 97,090 | 12.952.194,36 | 6,75 | |
| DE000ENER6Y0 | Siemens Energy AG | STK | 98.560 | 44.317 | 24.068 | EUR | 13,985 | 1.378.361,60 | 0,72 | |
| DE000SHL1006 | Siemens Healthineers AG | STK | 59.561 | 66.090 | 6.529 | EUR | 48,490 | 2.888.112,89 | 1,50 | |
| DE000SYM9999 | Symrise AG | STK | 28.437 | 14.425 | 6.174 | EUR | 103,850 | 2.953.182,45 | 1,54 | |
| DE0008303504 | TAG Immobilien AG | STK | 31.381 | 14.149 | 7.095 | EUR | 10,890 | 341.739,09 | 0,18 | |
| DE0007500001 | thyssenkrupp AG | STK | 105.441 | 46.750 | 23.048 | EUR | 5,410 | 570.435,81 | 0,30 | |
| DE000A1ML7J1 | Vonovia SE | STK | 153.651 | 93.489 | 29.460 | EUR | 29,400 | 4.517.339,40 | 2,35 | |
| DE000ZAL1111 | Zalando SE | STK | 49.467 | 31.135 | 11.001 | EUR | 24,960 | 1.234.696,32 | 0,64 | |
| | | | | | | | | EUR | 177.560.061,82 | 92,49 |
| Ausland | | | | | | | | | | |
| LU1673108939 | Aroundtown SA | STK | 211.431 | 104.213 | 54.804 | EUR | 3,033 | 641.270,22 | 0,33 | |
| IE00BZ12WP82 | Linde PLC | STK | 50.276 | 25.706 | 31.918 | EUR | 273,950 | 13.773.110,20 | 7,17 | |
| | | | | | | | | EUR | 14.414.380,42 | 7,51 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | EUR | 191.974.442,24 | 100,00 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | EUR | 87.485,03 | 0,05 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | EUR | 87.485,03 | % | 100,000 | | 87.485,03 | 0,05 | |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | EUR | 41.334,76 | 0,02 |
| Dividendenforderungen | | | EUR | 41.334,76 | | | | 41.334,76 | 0,02 | |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | EUR | -124.361,66 | -0,06 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften | | | EUR | -48.720,92 | | | | -48.720,92 | -0,03 | |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | | | EUR | -75.640,74 | | | | -75.640,74 | -0,04 | |

| | | | | | | |
|-------------------------------------|--|--|--|------------|-----------------------|-----------------------------|
| Wert des Teilsondervermögens | | | | EUR | 191.978.900,37 | 100,00 ¹⁾ |
| Anteilwert | | | | EUR | 31,37 | |
| Umlaufende Anteile | | | | STK | 6.119.300 | |

Fußnoten:

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 30.06.2022

Keine Fremdwährungskurse

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

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheinanleihen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-------------------------------------|--|---|-------------------|----------------------|---------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE0005158703 | Bechtle AG | STK | 14.871 | 19.403 | |
| DE000DTR0CK8 | Daimler Truck Holding AG | STK | 80.597 | 80.597 | |
| DE000A3E5B58 | Deutsche Lufthansa AG - Anrechte | STK | 91.286 | 91.286 | |
| DE000A0HN5C6 | Deutsche Wohnen SE | STK | 8.731 | 58.413 | |
| DE000A3MQQ17 | Fresenius SE & Co. KGaA - Anrechte | STK | 84.492 | 84.492 | |
| DE000LEG1243 | LEG Immobilien SE - Anrechte | STK | 15.232 | 15.232 | |
| DE000PSM7770 | ProSiebenSat.1 Media SE | STK | 5.096 | 37.875 | |
| DE000A2YN900 | TeamViewer AG | STK | 34.825 | 34.825 | |
| DE0005089031 | United Internet AG | STK | 6.590 | 22.308 | |
| DE000VTSC017 | Vitesco Technologies Group AG | STK | 12.174 | 12.174 | |
| DE000VTSC0T7 | Vitesco Technologies Group AG - Anrechte | STK | 8.116 | 8.116 | |
| DE000A3MQQ33 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 140.801 | 140.801 | |
| DE000A3MQB30 | Vonovia SE - Anrechte | STK | 96.244 | 96.244 | |
| Ausland | | | | | |
| LU2353086064 | Aroundtown SA - Anrechte | STK | 167.627 | 167.627 | |

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2021 bis zum 30.06.2022

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|-----------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer) | | 7.181.206,46 | 1,174 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 289.672,19 | 0,047 |
| 3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | | -947.098,97 | -0,155 |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -13.928,98 | -0,002 |
| 5. Sonstige Erträge | | 244,91 | 0,000 |
| Summe der Erträge | | 6.510.095,61 | 1,064 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahme | | -40,21 | 0,000 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -342.861,90 | -0,056 |
| 3. Sonstige Aufwendungen | | -671,58 | 0,000 |
| davon: Verwahrtgelt | -671,58 | | 0,000 |
| Summe der Aufwendungen | | -343.573,69 | -0,056 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 6.166.521,92 | 1,008 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 4.143.977,74 | 0,677 |
| 2. Realisierte Verluste | | -4.625.500,59 | -0,756 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -481.522,85 | -0,079 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 5.684.999,07 | 0,929 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -2.326.639,46 | -0,380 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -46.935.838,59 | -7,670 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -49.262.478,05 | -8,050 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -43.577.478,98 | -7,121 |

Entwicklung des Teilsongervermögens

| | 2021 / 2022 |
|--|-----------------------|
| | EUR |
| I. Wert des Teilsongervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | 194.073.479,88 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | -3.314.634,84 |
| 2. Mittelzufluss (netto) | 45.111.429,73 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 92.993.875,80 |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -47.882.446,07 |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | -313.895,42 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | -43.577.478,98 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | -2.326.639,46 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | -46.935.838,59 |
| II. Wert des Teilsongervermögens am Ende des Geschäftsjahres | 191.978.900,37 |

Verwendung der Erträge des Teilsongervermögens

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|---|------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | 38.089.431,69 | 6,224 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | | 13.206.542,58 | 2,158 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 5.684.999,07 | 0,929 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen ²⁾ | | 19.197.890,04 | 3,137 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | 32.398.482,69 | 5,294 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | | 0,00 | 0,000 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | | 32.398.482,69 | 5,294 |
| III. Gesamtausschüttung | | 5.690.949,00 | 0,930 |
| 1. Endausschüttung | | 5.690.949,00 | 0,930 |

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

2) Die Zuführung aus dem Sondervermögen dient dem Ausgleich von im Geschäftsjahr realisierten Verluste, die damit bei der Berechnung der Ausschüttung unberücksichtigt bleiben; im Ergebnis kann sich damit für das laufende oder für künftige Geschäftsjahre eine Substanzausschüttung im investmentrechtlichen Sinne ergeben.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Teilsongervermög am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|---|-------------------|
| 2021/2022 | 191.978.900,37 | 31,37 |
| 2020/2021 | 194.073.479,88 | 39,29 |
| 2020 | 3.726.906,74 | 30,93 |

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9090

Anteilwert

EUR

31,37

Umlaufende Anteile

STK

6.119.300

Anleger

Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

5,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

5,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

0,15

Ertragsverwendung

ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)

100,00

Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände

zum Nennwert

Verbindlichkeiten

zum Rückzahlungsbetrag

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

CSDR Erträge

237,80

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagezinsen

622,07

Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB

0,15

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsondervermögens aus.

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendungserstattungen, mit denen das jeweilige Teilsondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl.

Ertragsausgleich

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut, vor Ertragsausgleich)

EUR

317.299,79

Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft

%

-8,72

Davon für die Verwahrstelle

%

39,22

Davon für Dritte

%

69,50

Transaktionskosten

EUR

7.904,46

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Lyxor Funds Solutions S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 79,26 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 196.913.565,47 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

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 für Indexfonds gem. §16 (2) KARBV

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilsondervermögens und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilsondervermögen erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilsondervermögens.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Der ETF hat eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums
Höhe der Annual Tracking Difference

0,24%
-0,01%

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Angaben zur Vergütung gemäß KAGB § 101 (4) 1.-5.:

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“) hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2022 überprüft.

Zum 1. Juli 2022 wurde die LFS auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Da dieser Bericht den Zeitraum zwischen dem 1. Januar 2022 und dem 30. Juni 2022 abdeckt, hat dies keine Auswirkungen auf diesen Jahresbericht.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA;
- im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.313 TEUR (92,40%) und der variable Teil 108 TEUR (7,60%). Die Gesamtvergütung betrug 1.421 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 17,07
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 36,40
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,30
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2021 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.742 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (36). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2021 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 275,24

Gemäß Kapitel 7 der ESMA Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31.03.2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an. Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- folgende Risk-Taker benannt hat: Mathias Turra, Martine Capus, Dr. Qi Chen und Martin Rausch (bis zum 29.04.2022)
- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW Instrumenten vornimmt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht anwendet.

Eine Änderung der Vergütungspolitik ist bis dato nicht erfolgt. Eine Überprüfung der Vergütungspolitik nach Art. 14b Abs. 1 Buchstabe c und d sowie ggf. eine Änderung derselbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2022.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der EU-Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website <https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor> eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Transparenz bei der Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale in regelmäßigen Berichten

Gemäß Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (die "SFDR-Verordnung") wird das Ausmaß, inwieweit die ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllt wurden, anhand der nachstehenden Indikatoren beschrieben:

| | | | | |
|---|-------|------|-------|-----|
| % unabhängige Vorstandsmitglieder | 83.2% | 99% | 83.3% | 83% |
| Gewichteter Durchschnitt der | 112.2 | 100% | 138.0 | 99% |
| % Frauen an Bord | 39.1% | 99% | 39.2% | 99% |
| Einhaltung der Menschenrechte | | 99% | | 99% |
| - Bestehen | 91.0% | | 88.1% | |
| - Scheitern | 0.7% | | 0.6% | |
| - Beobachtungsliste | 7.7% | | 10.6% | |
| Bewertung von Menschenrechtsbelangen | | 99% | | 99% |
| - Keine Bedenken | 84.2% | | 82.6% | |
| - Unerheblich | 9.5% | | 8.5% | |
| - Mäßig | 5.9% | | 8.5% | |
| - Stark | 0.5% | | 0.4% | |
| - Sehr ernst | 0.0% | | 0.0% | |
| Übergangspunktzahl | 6.0 | 100% | 5.9 | 99% |

Ein Maß für das Engagement des Portfolios gegenüber den CO₂-intensivsten Unternehmen, das sich in der durchschnittlichen CO₂-Intensität der Unternehmen widerspiegelt (CO₂-Emissionen normalisiert durch den Umsatz). Die CO₂-Intensität des Portfolios wird als gewichteter Durchschnitt der CO₂-Intensität der zugrunde liegenden Emittenten berechnet. Maßnahmen berücksichtigen nicht alle vom Unternehmen verursachten Emissionen, insbesondere solche im Zusammenhang mit der Verwendung von Produkten oder vorgelagerten durch Lieferanten (Scope 3).

Übergangspunktzahl

Dieser Indikator zielt darauf ab, potenzielle Vorreiter und Nachzügler zu identifizieren, indem Unternehmen ganzheitlich in Bezug auf ihre Exposition und ihr Management von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft gemessen werden.

Ein Score auf Unternehmensebene, der den Grad der Ausrichtung eines Unternehmens auf die Low Carbon Transition misst.

Bewertung von Menschenrechtsbelangen

Diese Indikatoren zeigen an, ob ein Unternehmen Reputations- und Betriebsrisiken aufgrund von schwerwiegenden und/oder sehr wichtigen (Verstößen in Bezug auf soziale Belange **Einhaltung der Menschenrechte**

Dieser Faktor gibt an, ob das Unternehmen die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte einhält. Mögliche Werte sind Fail, Watch List oder Pass.

% Frauen an Bord

Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder. Bei Gesellschaften mit dualistischem Vorstand bezieht sich die Berechnung nur auf die Mitglieder des Aufsichtsrats. **% unabhängige Vorstandsmitglieder**

Der Prozentsatz der Vorstandsmitglieder, die unsere festgelegten Kriterien für die Unabhängigkeit erfüllen. Bei Unternehmen mit einem zweistufigen Vorstand basiert die Berechnung nur auf den Mitgliedern des Aufsichtsrats.

Transparenz umweltverträglicher Investitionen in regelmäßigen Berichten

Der Teilfonds bewirbt ökologische Merkmale im Sinne des Artikel 6 der Verordnung (EU) 2020/852 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088 (die "Taxonomie-Verordnung").

Die Taxonomie-Verordnung zielt darauf ab, wirtschaftliche Aktivitäten zu identifizieren, die als ökologisch nachhaltig gelten (die "nachhaltigen Aktivitäten").

In der Taxonomie-Verordnung werden solche Tätigkeiten nach ihrem Beitrag zu sechs Umweltzielen unterschieden: (i) Klimaschutz; (ii) Anpassung an den Klimawandel; (iii) nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen; (iv) Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft; (v) Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung; (vi) Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme.

Eine Wirtschaftstätigkeit gilt als ökologisch nachhaltig, wenn sie einen wesentlichen Beitrag zu einem oder mehreren der sechs Umweltziele leistet, keines der Umweltziele erheblich beeinträchtigt (Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“) und unter Einhaltung des in Artikel 18 der Taxonomie-Verordnung festgelegten Mindestschutzes durchgeführt wird. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Kriterien der Europäischen Union für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Dieser Teilfonds kann in Wirtschaftstätigkeiten investieren, die zu den folgenden, in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen beitragen, ist jedoch nicht verpflichtet zum Datum dieses Jahresberichts in diese zu investieren: Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel.

Der Teilfonds strebt an, den Anlegern einen Ertrag zukommen zu lassen, der an die Wertentwicklung des STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return anknüpft, dabei kommen nur Unternehmen in Frage, die konform auf Basis der Global Standards Screening-Bewertung des ESG-Datenanbieter Sustainalytics und nicht in umstrittene

Waffen involviert sind.

Im Einklang mit dem Anlageziel und um einen Beitrag zu den oben genannten Umweltzielen zu leisten, wird erwartet, dass dieser Teilfonds in Wirtschaftstätigkeiten investiert, die gemäß der Taxonomie-Verordnung förderfähig sind, einschließlich, aber nicht beschränkt sind auf alternative Energie und Kohlenstoffenergie sowie CO2-Effizienz.

Zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresberichts liegen nur unzureichend zuverlässige und überprüfbare Daten vor, auf deren Basis die Investitionen bezüglich der technischen Screeningkriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten bewertet werden könnten. Dementsprechend bestehen Auslegungsunsicherheiten für die Offenlegungs- und Taxonomie-Verordnung und deren delegierte Rechtsakte.

Für die Zwecke der Taxonomieverordnung beträgt daher der Prozentsatz der Anlagen des Teilfonds, der in Anlagen investiert wird, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen, 0%.

Ab der vollständigen Verfügbarkeit der Daten und der Fertigstellung der entsprechenden Berechnungsmethoden wird die Beschreibung, in welchem Umfang die dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen in nachhaltige Aktivitäten getätigt werden, den Anlegern zur Verfügung gestellt.

Bei Fragen zur Taxonomie-Verordnung wenden Sie sich bitte an die Verwaltungsgesellschaft unter der folgenden E-Mail-Adresse: info@lyxoretf.de.

Wesentliche Änderungen nach Berichtsstichtag:

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilsondervermögen änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A..



Charles Giraldez
Deputy Chief Executive Officer
Amundi Luxembourg



Enrico Turchi
Managing Director
Amundi Luxembourg S. [®]

Lyxor 1

Vermerk des Abschlussprüfers

An die Amundi Luxembourg S.A.

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresberichte der Teilsondervermögen Lyxor 1 MDAX® UCITS ETF, Lyxor 1 DivDAX® UCITS ETF, Lyxor 1 EUROSTOXX 50® UCITS ETF, Lyxor 1 TecDAX® UCITS ETF, Lyxor 1 SDAX® UCITS ETF, Lyxor 1 STOXX® Europe 600 UCITS ETF und Lyxor 1 DAX® 50 ESG UCITS ETF der Umbrella-Konstruktion Lyxor 1 – bestehend aus den Tätigkeitsberichten für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2021 bis zum 30. Juni 2022, den Vermögensübersichten und den Vermögensaufstellungen zum 30. Juni 2022, den Ertrags- und Aufwandsrechnungen, der Verwendungsrechnungen, der Entwicklungsrechnungen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2021 bis zum 30. Juni 2022, sowie den vergleichenden Übersichten über die letzten drei Geschäftsjahre, den Aufstellungen der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und den Anhängen – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entsprechen die beigelegten Jahresberichte in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglichen es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung der Jahresberichte in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresberichte“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Amundi Luxembourg S.A. unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu den Jahresberichten zu dienen.

Hervorhebung eines Sachverhalts

Wir verweisen auf die Angabe der gesetzlichen Vertreter im Tätigkeitsbericht des Jahresberichts im Zusammenhang mit der Fortführung der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF, in der beschrieben ist, dass die Auflösung der Teilsondervermögen durch Kündigung zum 13. September 2022 erfolgt ist. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht ist diesbezüglich nicht modifiziert.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für die Jahresberichte

Die gesetzlichen Vertreter der Amundi Luxembourg S.A. sind verantwortlich für die Aufstellung der Jahresberichte, die den deutschen Vorschriften des KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entsprechen und dafür, dass die Jahresberichte es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglichen, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung der Jahresberichte zu ermöglichen, die frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen sind.

Bei der Aufstellung der Jahresberichte sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung der Investmentvermögen wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung der Jahresberichte die Fortführung des Sondervermögens durch die Amundi Luxembourg S.A. zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Ereignisse oder Gegebenheiten im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens - sofern einschlägig - anzugeben.

Die gesetzlichen Vertreter sind auch verantwortlich für die Angaben nach der EU-Offenlegungsverordnung ((EU) 2019/2088) und der EU-Taxonomieverordnung ((EU) 2020/852) in Übereinstimmung mit den von der Kapitalverwaltungsgesellschaft für Kapitalverwaltungsgesellschaft für die bei den Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF des Investmentvermögen angewandten konkretisierenden Kriterien. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die Vorkehrungen und Maßnahmen (Systeme), die sie als notwendig erachtet haben, um die Angaben nach der EU-Offenlegungsverordnung und der EU-Taxonomieverordnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (Manipulation der Nachhaltigkeitsberichterstattung) oder Irrtümern sind.

Die einschlägigen europäischen Vorschriften enthalten Formulierungen und Begriffe, die erheblichen Auslegungsunsicherheiten unterliegen und für die noch keine maßgebenden umfassenden Interpretationen veröffentlicht wurden. Demzufolge haben die gesetzlichen Vertreter im Anhang der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF ihre Auslegungen solcher Formulierungen und Begriffe angegeben. Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Vertretbarkeit dieser Auslegungen. Da solche Formulierungen und Begriffe unterschiedlich durch Regulatoren oder Gerichte ausgelegt werden können, ist die Gesetzmäßigkeit dieser Auslegungen unsicher. Wie im Anhang der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF dargelegt, unterliegt auch die Taxonomie-Quote inhärenten Unsicherheiten, da zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresberichts nur unzureichend zuverlässige und überprüfbare Daten vorlagen, auf deren Basis die Investitionen bezüglich der technischen Screeningkriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten bewertet werden konnten.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresberichte

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresberichte als Ganzes frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen sind, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zu den Jahresberichten beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieser Jahresberichte getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – falscher Darstellungen in den Jahresberichten planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unsere Prüfungsurteile zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung der Jahresberichte relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Amundi Luxembourg S.A. abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Amundi Luxembourg S.A. bei der Aufstellung der Jahresberichte angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Amundi Luxembourg S.A. aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben in den Jahresberichten aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Amundi Luxembourg S.A. nicht fortgeführt werden.
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt der Jahresberichte, einschließlich der Angaben sowie ob die Jahresberichte die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellen, dass die Jahresberichte es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglichen, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.
- beurteilen wir die Eignung der von den gesetzlichen Vertretern zu den Angaben nach der EU-Offenlegungsverordnung und der EU-Taxonomieverordnung im Anhang der Teilsondervermögen Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF und Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF angewendeten Kriterien insgesamt. Wie in der Beschreibung der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter dargelegt, haben die gesetzlichen Vertreter die in den einschlägigen europäischen Vorschriften enthaltenen Formulierungen und Begriffe ausgelegt; die Gesetzmäßigkeit dieser Auslegungen ist mit den in der Beschreibung genannten inhärenten Unsicherheiten behaftet. Des Weiteren unterliegen die in dieser Beschreibung genannten Quoten den dort genannten inhärenten Unsicherheiten bei deren Messung bzw. Beurteilung. Diese inhärenten Unsicherheiten bei der Auslegung und bei der Messung bzw. Beurteilung gelten entsprechend auch für unsere Prüfung.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen."

Eschborn/Frankfurt am Main, 31. Oktober 2022

Ernst & Young GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Heist
Wirtschaftsprüfer

Art
Wirtschaftsprüfer



Auftragsbedingungen, Haftung und Verwendungsvorbehalt

Wir, die Ernst & Young GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, haben unsere Prüfung der vorliegenden Rechnungslegung im Auftrag der Gesellschaft vorgenommen. Neben der gesetzlichen Funktion der Offenlegung in den Fällen gesetzlicher Abschlussprüfungen richtet sich der Vermerk ausschließlich an die Gesellschaft und wurde zu deren interner Verwendung erteilt, ohne dass er weiteren Zwecken Dritter oder diesen als Entscheidungsgrundlage dienen soll. Das in dem Vermerk zusammengefasste Ergebnis von freiwilligen Abschlussprüfungen ist somit nicht dazu bestimmt, Grundlage von Entscheidungen Dritter zu sein, und nicht für andere als bestimmungsgemäße Zwecke zu verwenden.

Unserer Tätigkeit, über die wir vorliegend berichten, liegt unser Auftragsbestätigungsschreiben einschließlich der "Allgemeinen Auftragsbedingungen für Wirtschaftsprüfer und Wirtschaftsprüfungsgesellschaften" in der vom Institut der Wirtschaftsprüfer herausgegebenen Fassung vom 1. Januar 2017 zugrunde.

Klarstellend weisen wir darauf hin, dass wir Dritten gegenüber keine Verantwortung, Haftung oder anderweitige Pflichten übernehmen, es sei denn, dass wir mit dem Dritten eine anders lautende schriftliche Vereinbarung geschlossen hätten oder ein solcher Haftungsausschluss unwirksam wäre.

Wir weisen ausdrücklich darauf hin, dass wir keine Aktualisierung des Vermerks hinsichtlich nach seiner Erteilung eintretender Ereignisse oder Umstände vornehmen, sofern hierzu keine rechtliche Verpflichtung besteht.

Wer auch immer das in vorstehendem Vermerk zusammengefasste Ergebnis unserer Tätigkeit zur Kenntnis nimmt, hat eigenverantwortlich zu entscheiden, ob und in welcher Form er dieses Ergebnis für seine Zwecke nützlich und tauglich erachtet und durch eigene Untersuchungshandlungen erweitert, verifiziert oder aktualisiert.

Allgemeine Auftragsbedingungen

für

Wirtschaftsprüfer und Wirtschaftsprüfungsgesellschaften

vom 1. Januar 2017

1. Geltungsbereich

(1) Die Auftragsbedingungen gelten für Verträge zwischen Wirtschaftsprüfern oder Wirtschaftsprüfungsgesellschaften (im Nachstehenden zusammenfassend „Wirtschaftsprüfer“ genannt) und ihren Auftraggebern über Prüfungen, Steuerberatung, Beratungen in wirtschaftlichen Angelegenheiten und sonstige Aufträge, soweit nicht etwas anderes ausdrücklich schriftlich vereinbart oder gesetzlich zwingend vorgeschrieben ist.

(2) Dritte können nur dann Ansprüche aus dem Vertrag zwischen Wirtschaftsprüfer und Auftraggeber herleiten, wenn dies ausdrücklich vereinbart ist oder sich aus zwingenden gesetzlichen Regelungen ergibt. Im Hinblick auf solche Ansprüche gelten diese Auftragsbedingungen auch diesen Dritten gegenüber.

2. Umfang und Ausführung des Auftrags

(1) Gegenstand des Auftrags ist die vereinbarte Leistung, nicht ein bestimmter wirtschaftlicher Erfolg. Der Auftrag wird nach den Grundsätzen ordnungsmäßiger Berufsausübung ausgeführt. Der Wirtschaftsprüfer übernimmt im Zusammenhang mit seinen Leistungen keine Aufgaben der Geschäftsführung. Der Wirtschaftsprüfer ist für die Nutzung oder Umsetzung der Ergebnisse seiner Leistungen nicht verantwortlich. Der Wirtschaftsprüfer ist berechtigt, sich zur Durchführung des Auftrags sachverständiger Personen zu bedienen.

(2) Die Berücksichtigung ausländischen Rechts bedarf – außer bei betriebswirtschaftlichen Prüfungen – der ausdrücklichen schriftlichen Vereinbarung.

(3) Ändert sich die Sach- oder Rechtslage nach Abgabe der abschließenden beruflichen Äußerung, so ist der Wirtschaftsprüfer nicht verpflichtet, den Auftraggeber auf Änderungen oder sich daraus ergebende Folgerungen hinzuweisen.

3. Mitwirkungspflichten des Auftraggebers

(1) Der Auftraggeber hat dafür zu sorgen, dass dem Wirtschaftsprüfer alle für die Ausführung des Auftrags notwendigen Unterlagen und weiteren Informationen rechtzeitig übermittelt werden und ihm von allen Vorgängen und Umständen Kenntnis gegeben wird, die für die Ausführung des Auftrags von Bedeutung sein können. Dies gilt auch für die Unterlagen und weiteren Informationen, Vorgänge und Umstände, die erst während der Tätigkeit des Wirtschaftsprüfers bekannt werden. Der Auftraggeber wird dem Wirtschaftsprüfer geeignete Auskunftspersonen benennen.

(2) Auf Verlangen des Wirtschaftsprüfers hat der Auftraggeber die Vollständigkeit der vorgelegten Unterlagen und der weiteren Informationen sowie der gegebenen Auskünfte und Erklärungen in einer vom Wirtschaftsprüfer formulierten schriftlichen Erklärung zu bestätigen.

4. Sicherung der Unabhängigkeit

(1) Der Auftraggeber hat alles zu unterlassen, was die Unabhängigkeit der Mitarbeiter des Wirtschaftsprüfers gefährdet. Dies gilt für die Dauer des Auftragsverhältnisses insbesondere für Angebote auf Anstellung oder Übernahme von Organfunktionen und für Angebote, Aufträge auf eigene Rechnung zu übernehmen.

(2) Sollte die Durchführung des Auftrags die Unabhängigkeit des Wirtschaftsprüfers, die der mit ihm verbundenen Unternehmen, seiner Netzwerkunternehmen oder solcher mit ihm assoziierten Unternehmen, auf die die Unabhängigkeitsvorschriften in gleicher Weise Anwendung finden wie auf den Wirtschaftsprüfer, in anderen Auftragsverhältnissen beeinträchtigen, ist der Wirtschaftsprüfer zur außerordentlichen Kündigung des Auftrags berechtigt.

5. Berichterstattung und mündliche Auskünfte

Soweit der Wirtschaftsprüfer Ergebnisse im Rahmen der Bearbeitung des Auftrags schriftlich darzustellen hat, ist alleine diese schriftliche Darstellung maßgebend. Entwürfe schriftlicher Darstellungen sind unverbindlich. Sofern nicht anders vereinbart, sind mündliche Erklärungen und Auskünfte des Wirtschaftsprüfers nur dann verbindlich, wenn sie schriftlich bestätigt werden. Erklärungen und Auskünfte des Wirtschaftsprüfers außerhalb des erteilten Auftrags sind stets unverbindlich.

6. Weitergabe einer beruflichen Äußerung des Wirtschaftsprüfers

(1) Die Weitergabe beruflicher Äußerungen des Wirtschaftsprüfers (Arbeitsergebnisse oder Auszüge von Arbeitsergebnissen – sei es im Entwurf oder in der Endfassung) oder die Information über das Tätigwerden des Wirtschaftsprüfers für den Auftraggeber an einen Dritten bedarf der schriftlichen Zustimmung des Wirtschaftsprüfers, es sei denn, der Auftraggeber ist zur Weitergabe oder Information aufgrund eines Gesetzes oder einer behördlichen Anordnung verpflichtet.

(2) Die Verwendung beruflicher Äußerungen des Wirtschaftsprüfers und die Information über das Tätigwerden des Wirtschaftsprüfers für den Auftraggeber zu Werbezwecken durch den Auftraggeber sind unzulässig.

7. Mängelbeseitigung

(1) Bei etwaigen Mängeln hat der Auftraggeber Anspruch auf Nacherfüllung durch den Wirtschaftsprüfer. Nur bei Fehlschlagen, Unterlassen bzw. unberechtigter Verweigerung, Unzumutbarkeit oder Unmöglichkeit der Nacherfüllung kann er die Vergütung mindern oder vom Vertrag zurücktreten; ist der Auftrag nicht von einem Verbraucher erteilt worden, so kann der Auftraggeber wegen eines Mangels nur dann vom Vertrag zurücktreten, wenn die erbrachte Leistung wegen Fehlschlagens, Unterlassung, Unzumutbarkeit oder Unmöglichkeit der Nacherfüllung für ihn ohne Interesse ist. Soweit darüber hinaus Schadensersatzansprüche bestehen, gilt Nr. 9.

(2) Der Anspruch auf Beseitigung von Mängeln muss vom Auftraggeber unverzüglich in Textform geltend gemacht werden. Ansprüche nach Abs. 1, die nicht auf einer vorsätzlichen Handlung beruhen, verjähren nach Ablauf eines Jahres ab dem gesetzlichen Verjährungsbeginn.

(3) Offenbare Unrichtigkeiten, wie z.B. Schreibfehler, Rechenfehler und formelle Mängel, die in einer beruflichen Äußerung (Bericht, Gutachten und dgl.) des Wirtschaftsprüfers enthalten sind, können jederzeit vom Wirtschaftsprüfer auch Dritten gegenüber berichtigt werden. Unrichtigkeiten, die geeignet sind, in der beruflichen Äußerung des Wirtschaftsprüfers enthaltene Ergebnisse infrage zu stellen, berechtigen diesen, die Äußerung auch Dritten gegenüber zurückzunehmen. In den vorgenannten Fällen ist der Auftraggeber vom Wirtschaftsprüfer tunlichst vorher zu hören.

8. Schweigepflicht gegenüber Dritten, Datenschutz

(1) Der Wirtschaftsprüfer ist nach Maßgabe der Gesetze (§ 323 Abs. 1 HGB, § 43 WPO, § 203 StGB) verpflichtet, über Tatsachen und Umstände, die ihm bei seiner Berufstätigkeit anvertraut oder bekannt werden, Stillschweigen zu bewahren, es sei denn, dass der Auftraggeber ihn von dieser Schweigepflicht entbindet.

(2) Der Wirtschaftsprüfer wird bei der Verarbeitung von personenbezogenen Daten die nationalen und europarechtlichen Regelungen zum Datenschutz beachten.

9. Haftung

(1) Für gesetzlich vorgeschriebene Leistungen des Wirtschaftsprüfers, insbesondere Prüfungen, gelten die jeweils anzuwendenden gesetzlichen Haftungsbeschränkungen, insbesondere die Haftungsbeschränkung des § 323 Abs. 2 HGB.

(2) Sofern weder eine gesetzliche Haftungsbeschränkung Anwendung findet noch eine einzelvertragliche Haftungsbeschränkung besteht, ist die Haftung des Wirtschaftsprüfers für Schadensersatzansprüche jeder Art, mit Ausnahme von Schäden aus der Verletzung von Leben, Körper und Gesundheit, sowie von Schäden, die eine Ersatzpflicht des Herstellers nach § 1 ProdHaftG begründen, bei einem fahrlässig verursachten einzelnen Schadensfall gemäß § 54a Abs. 1 Nr. 2 WPO auf 4 Mio. € beschränkt.

(3) Einreden und Einwendungen aus dem Vertragsverhältnis mit dem Auftraggeber stehen dem Wirtschaftsprüfer auch gegenüber Dritten zu.

(4) Leiten mehrere Anspruchsteller aus dem mit dem Wirtschaftsprüfer bestehenden Vertragsverhältnis Ansprüche aus einer fahrlässigen Pflichtverletzung des Wirtschaftsprüfers her, gilt der in Abs. 2 genannte Höchstbetrag für die betreffenden Ansprüche aller Anspruchsteller insgesamt.

(5) Ein einzelner Schadensfall im Sinne von Abs. 2 ist auch bezüglich eines aus mehreren Pflichtverletzungen stammenden einheitlichen Schadens gegeben. Der einzelne Schadensfall umfasst sämtliche Folgen einer Pflichtverletzung ohne Rücksicht darauf, ob Schäden in einem oder in mehreren aufeinanderfolgenden Jahren entstanden sind. Dabei gilt mehrfaches auf gleicher oder gleichartiger Fehlerquelle beruhendes Tun oder Unterlassen als einheitliche Pflichtverletzung, wenn die betreffenden Angelegenheiten miteinander in rechtlichem oder wirtschaftlichem Zusammenhang stehen. In diesem Fall kann der Wirtschaftsprüfer nur bis zur Höhe von 5 Mio. € in Anspruch genommen werden. Die Begrenzung auf das Fünffache der Mindestversicherungssumme gilt nicht bei gesetzlich vorgeschriebenen Pflichtprüfungen.

(6) Ein Schadensersatzanspruch erlischt, wenn nicht innerhalb von sechs Monaten nach der schriftlichen Ablehnung der Ersatzleistung Klage erhoben wird und der Auftraggeber auf diese Folge hingewiesen wurde. Dies gilt nicht für Schadensersatzansprüche, die auf vorsätzliches Verhalten zurückzuführen sind, sowie bei einer schuldhaften Verletzung von Leben, Körper oder Gesundheit sowie bei Schäden, die eine Ersatzpflicht des Herstellers nach § 1 ProdHaftG begründen. Das Recht, die Einrede der Verjährung geltend zu machen, bleibt unberührt.

10. Ergänzende Bestimmungen für Prüfungsaufträge

(1) Ändert der Auftraggeber nachträglich den durch den Wirtschaftsprüfer geprüften und mit einem Bestätigungsvermerk versehenen Abschluss oder Lagebericht, darf er diesen Bestätigungsvermerk nicht weiterverwenden.

Hat der Wirtschaftsprüfer einen Bestätigungsvermerk nicht erteilt, so ist ein Hinweis auf die durch den Wirtschaftsprüfer durchgeführte Prüfung im Lagebericht oder an anderer für die Öffentlichkeit bestimmter Stelle nur mit schriftlicher Einwilligung des Wirtschaftsprüfers und mit dem von ihm genehmigten Wortlaut zulässig.

(2) Widerruft der Wirtschaftsprüfer den Bestätigungsvermerk, so darf der Bestätigungsvermerk nicht weiterverwendet werden. Hat der Auftraggeber den Bestätigungsvermerk bereits verwendet, so hat er auf Verlangen des Wirtschaftsprüfers den Widerruf bekanntzugeben.

(3) Der Auftraggeber hat Anspruch auf fünf Berichtsausfertigungen. Weitere Ausfertigungen werden besonders in Rechnung gestellt.

11. Ergänzende Bestimmungen für Hilfeleistung in Steuersachen

(1) Der Wirtschaftsprüfer ist berechtigt, sowohl bei der Beratung in steuerlichen Einzelfragen als auch im Falle der Dauerberatung die vom Auftraggeber genannten Tatsachen, insbesondere Zahlenangaben, als richtig und vollständig zugrunde zu legen; dies gilt auch für Buchführungsaufträge. Er hat jedoch den Auftraggeber auf von ihm festgestellte Unrichtigkeiten hinzuweisen.

(2) Der Steuerberatungsauftrag umfasst nicht die zur Wahrung von Fristen erforderlichen Handlungen, es sei denn, dass der Wirtschaftsprüfer hierzu ausdrücklich den Auftrag übernommen hat. In diesem Fall hat der Auftraggeber dem Wirtschaftsprüfer alle für die Wahrung von Fristen wesentlichen Unterlagen, insbesondere Steuerbescheide, so rechtzeitig vorzulegen, dass dem Wirtschaftsprüfer eine angemessene Bearbeitungszeit zur Verfügung steht.

(3) Mangels einer anderweitigen schriftlichen Vereinbarung umfasst die laufende Steuerberatung folgende, in die Vertragsdauer fallenden Tätigkeiten:

- a) Ausarbeitung der Jahressteuererklärungen für die Einkommensteuer, Körperschaftsteuer und Gewerbesteuer sowie der Vermögensteuererklärungen, und zwar auf Grund der vom Auftraggeber vorzulegenden Jahresabschlüsse und sonstiger für die Besteuerung erforderlicher Aufstellungen und Nachweise
- b) Nachprüfung von Steuerbescheiden zu den unter a) genannten Steuern
- c) Verhandlungen mit den Finanzbehörden im Zusammenhang mit den unter a) und b) genannten Erklärungen und Bescheiden
- d) Mitwirkung bei Betriebsprüfungen und Auswertung der Ergebnisse von Betriebsprüfungen hinsichtlich der unter a) genannten Steuern
- e) Mitwirkung in Einspruchs- und Beschwerdeverfahren hinsichtlich der unter a) genannten Steuern.

Der Wirtschaftsprüfer berücksichtigt bei den vorgenannten Aufgaben die wesentliche veröffentlichte Rechtsprechung und Verwaltungsauffassung.

(4) Erhält der Wirtschaftsprüfer für die laufende Steuerberatung ein Pauschalhonorar, so sind mangels anderweitiger schriftlicher Vereinbarungen die unter Abs. 3 Buchst. d) und e) genannten Tätigkeiten gesondert zu honorieren.

(5) Sofern der Wirtschaftsprüfer auch Steuerberater ist und die Steuerberatervergütungsverordnung für die Bemessung der Vergütung anzuwenden ist, kann eine höhere oder niedrigere als die gesetzliche Vergütung in Textform vereinbart werden.

(6) Die Bearbeitung besonderer Einzelfragen der Einkommensteuer, Körperschaftsteuer, Gewerbesteuer, Einheitsbewertung und Vermögensteuer sowie aller Fragen der Umsatzsteuer, Lohnsteuer, sonstigen Steuern und Abgaben erfolgt auf Grund eines besonderen Auftrags. Dies gilt auch für

- a) die Bearbeitung einmalig anfallender Steuerangelegenheiten, z.B. auf dem Gebiet der Erbschaftsteuer, Kapitalverkehrsteuer, Grunderwerbsteuer,
- b) die Mitwirkung und Vertretung in Verfahren vor den Gerichten der Finanz- und der Verwaltungsgerichtsbarkeit sowie in Steuerstrafsachen,
- c) die beratende und gutachtliche Tätigkeit im Zusammenhang mit Umwandlungen, Kapitalerhöhung und -herabsetzung, Sanierung, Eintritt und Ausscheiden eines Gesellschafters, Betriebsveräußerung, Liquidation und dergleichen und
- d) die Unterstützung bei der Erfüllung von Anzeige- und Dokumentationspflichten.

(7) Soweit auch die Ausarbeitung der Umsatzsteuerjahreserklärung als zusätzliche Tätigkeit übernommen wird, gehört dazu nicht die Überprüfung etwaiger besonderer buchmäßiger Voraussetzungen sowie die Frage, ob alle in Betracht kommenden umsatzsteuerrechtlichen Vergünstigungen wahrgenommen worden sind. Eine Gewähr für die vollständige Erfassung der Unterlagen zur Geltendmachung des Vorsteuerabzugs wird nicht übernommen.

12. Elektronische Kommunikation

Die Kommunikation zwischen dem Wirtschaftsprüfer und dem Auftraggeber kann auch per E-Mail erfolgen. Soweit der Auftraggeber eine Kommunikation per E-Mail nicht wünscht oder besondere Sicherheitsanforderungen stellt, wie etwa die Verschlüsselung von E-Mails, wird der Auftraggeber den Wirtschaftsprüfer entsprechend in Textform informieren.

13. Vergütung

(1) Der Wirtschaftsprüfer hat neben seiner Gebühren- oder Honorarforderung Anspruch auf Erstattung seiner Auslagen; die Umsatzsteuer wird zusätzlich berechnet. Er kann angemessene Vorschüsse auf Vergütung und Auslagenersatz verlangen und die Auslieferung seiner Leistung von der vollen Befriedigung seiner Ansprüche abhängig machen. Mehrere Auftraggeber haften als Gesamtschuldner.

(2) Ist der Auftraggeber kein Verbraucher, so ist eine Aufrechnung gegen Forderungen des Wirtschaftsprüfers auf Vergütung und Auslagenersatz nur mit unbestrittenen oder rechtskräftig festgestellten Forderungen zulässig.

14. Streitschlichtungen

Der Wirtschaftsprüfer ist nicht bereit, an Streitbeilegungsverfahren vor einer Verbraucherschlichtungsstelle im Sinne des § 2 des Verbraucherstreitbeilegungsgesetzes teilzunehmen.

15. Anzuwendendes Recht

Für den Auftrag, seine Durchführung und die sich hieraus ergebenden Ansprüche gilt nur deutsches Recht.