

Lyxor Funds Solutions S.A. Luxemburg

Testatsexemplar

OGAW

Umbrella-Konstruktion Lyxor 1

Jahresbericht zum 30. Juni 2021

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 Lyxor Funds Solutions 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 sowie des verschmolzenen Teilsondervermögens Lyxor 1 DAX® UCITS ETF - bestehend aus den Tätigkeitsberichten für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 30. Juni 2021 (für das Teilsondervermögen Lyxor 1 DAX® UCITS ETF: Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 22. April 2021), den Vermögensübersichten und den Vermögensaufstellungen zum 30. Juni 2021 (für das Teilsondervermögen Lyxor 1 DAX® UCITS ETF: Vermögensübersicht und Vermögensaufstellung zum 22. April 2021), den Ertrags- und Aufwandsrechnungen, der Verwendungsrechnungen, der Entwicklungsrechnungen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 30. Juni 2021 (für das Teilsondervermögen Lyxor 1 DAX® UCITS ETF: Ertrags- und Aufwandsrechnung, Verwendungsrechnung, Entwicklungsrechnung für das Rumpfgeschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 22. April 2021), 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 Lyxor Funds Solutions 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.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für die Jahresberichte

Die gesetzlichen Vertreter der Lyxor Funds Solutions 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 Lyxor Funds Solutions S.A. zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Ereignisse oder Gegebenheiten im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens - sofern einschlägig - anzugeben.

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 Lyxor Funds Solutions S.A. abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Lyxor Funds Solutions 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 Lyxor Funds Solutions 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 Lyxor Funds Solutions 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.

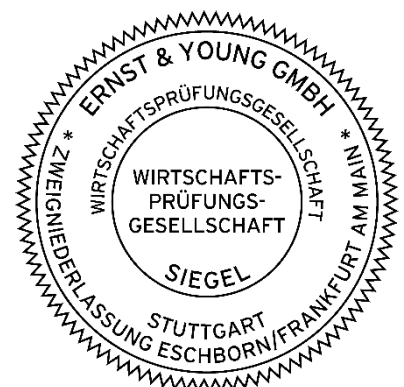
Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Eschborn/Frankfurt am Main, 26. Oktober 2021

Ernst & Young GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Heist
Wirtschaftsprüfer

Arlt
Wirtschaftsprüfer



Lyxor 1

Zusammenfassender Tätigkeitsbericht für die Teilsondervermögen

**Lyxor 1 MDAX[®] UCITS ETF,
Lyxor 1 DivDAX[®] UCITS ETF,
Lyxor 1 TecDAX[®] UCITS ETF,
Lyxor 1 SDAX[®] UCITS ETF,
Lyxor 1 EURO STOXX 50[®] UCITS ETF,
Lyxor 1 STOXX[®] Europe 600 UCITS ETF und
Lyxor 1 DAX[®] UCITS ETF ¹
Lyxor 1 DAX[®] 50 ESG 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[®] UCITS ETF ® Wertentwicklung des MDAX[®] (Performance-Index)

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

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

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

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

Lyxor 1 STOXX[®] Europe 600 UCITS ETF ® Wertentwicklung des STOXX[®] Europe 600 (Net-Total-Return-Index)

Lyxor 1 DAX 50 ESG 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 2020 bis 30. Juni 2021) war geprägt vom weiteren Verlauf der COVID-19 Pandemie und der Reaktion vieler Regierungen mit entsprechenden Konjunkturprogrammen sowie der US-Präsidentenwahl. Die weltweiten Aktienmärkte verzeichneten im Berichtszeitraum einen deutlichen Anstieg. Bereits im September wurden über weite Strecken die Niveaus vor Pandemieausbruch wieder erreicht. Nach der US-Wahl und gemeldeten Erfolgen bei der Impfstoffentwicklung im November konnten die Aktienmärkte ihren Aufwärtstrend weiter fortsetzen.

Wertentwicklung bekannter Aktienindizes:

MSCI World Preis-Index (in USD):	37,04%
EuroStoxx 50 Preis-Index (in EUR):	25,67%
Dax 30 Performance-Index (in EUR):	26,16%
Topix Preis-Index (in JPY):	24,69%
S&P 500 Preis-Index (in USD):	38,62%

An den Rohstoffmärkten führten Erwartungen an eine deutliche Erholung der Konjunktur sowie die Ankündigung staatlicher Investitionsprogramme insbesondere nach der US-Wahl zu deutlich steigenden Notierungen für Rohöl und Industriemetalle. Der Goldpreis konsolidierte hingegen und notierte in USD in etwa auf dem Niveau zu Beginn des Berichtszeitraums.

Wertentwicklung wichtiger Rohstoffe in USD:

Rohöl (Sorte Brent):	82,04%
Kupfer:	58,34%
Gold:	-0,61%

Der Euro hat im Berichtszeitraum gegenüber dem US-Dollar an Wert gewonnen (+5,55%), was umgekehrt bedeutet, dass Anlagen in US-Dollar um denselben Prozentsatz an Wert verloren haben. Ebenfalls an Wert gewonnen hat der Euro gegenüber dem japanischen Yen (+8,67%).

Zum 30. Juni 2020 notierte die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen bei -0,45%. Im Verlauf des Betrachtungszeitraums stieg die Rendite dieser langlaufenden Schulden der Bundesrepublik Deutschland um 24 Basispunkte auf -0,21% per 30. Juni 2021.

¹ Dieses Teilsondervermögen wurde per 23.04.2021 auf das Teilsondervermögen Lyxor 1 DAX[®] 50 ESG UCITS ETF verschmolzen.

Wertentwicklung von ausgewählten Indizes mit Bezug zu den Teilfonds:

DAX Performance-Index:	24,45%*
MDAX Performance-Index:	31,77%
DivDAX Performance-Index:	30,85%
TecDAX Performance-Index:	20,67%
SDAX Performance-Index:	38,88%
DAX50 ESG Performance-Index:	28,25%
Euro Stoxx 50 Preis-Index:	25,67%
Stoxx Europe 600 Preis-Index:	25,67%

Datenquelle: Bloomberg

* Wertentwicklung bis zur 22.04.2021.

Wesentliche Ereignisse:

Im Berichtszeitraum wurde der Lyxor 1 DAX® UCITS ETF auf den Lyxor 1 DAX 50 ESG UCITS ETF verschmolzen. Mit Wirkung vom 22. April 2022 wurden alle im Portfolio enthaltenen Vermögensgegenstände auf den Lyxor 1 DAX 50 ESG UCITS ETF übertragen. Es wurde kein neuer Teilfonds aufgelegt.

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.

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 endgültigen Auswirkungen nicht möglich.

Die Auswirkungen von CoVid-19 wurden im Jahr 2020 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.

Lyxor Funds Solutions S.A. 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 Lyxor Funds Solutions S.A. 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.

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, welche in den von der Lyxor Funds Solutions S.A. verwalteten Investmentfonds investiert sind, 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 auszuzahlen – 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. Hieraus können potenzielle negative Markteffekte im ersten und zweiten Geschäftsquartal 2021, aber auch für mehrere Quartale danach entstehen.

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 Lyxor Funds Solutions S.A. unter folgendem Link abgerufen werden:

(<https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor>)

Wesentliche Gewinne und Verluste

Lyxor 1 DivDAX® UCITS ETF:

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

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

Lyxor 1 MDAX® UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Delivery Hero).

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

Lyxor1 EURO STOXX 50® 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 Banco Bilbao Vizcaya Argent).

Lyxor 1 SDAX® UCITS ETF:

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position Shop Apotheke Europe N.V.).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position AUTO1 Group SE).

Lyxor 1 TecDAX® UCITS ETF:

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

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position Wirecard. AG).

Lyxor 1 STOXX® Europe 600 UCITS ETF:

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

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

Lyxor 1 DAX 50 ESG UCITS ETF

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

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

Der Verwaltungsrat

Luxemburg, den 26. Oktober 2021

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

Lyxor 1 DivDAX[®] UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		46.550.295,21	100,06
1. Aktien		46.525.666,47	100,01
- Chemische Industrie	5.679.593,46		12,21
- Einzelhandel	1.292.326,56		2,78
- Energieversorger	3.405.587,54		7,32
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	6.941.507,07		14,92
- Pharmaindustrie / Biotech	4.185.188,46		9,00
- Real Estate	3.731.559,06		8,02
- Sonstige industrielle Werte	4.665.743,16		10,03
- Telekommunikation	4.725.862,03		10,16
- Transportation	4.688.491,68		10,08
- Versicherungen	7.209.807,45		15,50
2. Bankguthaben		24.628,74	0,05
II. Verbindlichkeiten		-27.603,12	-0,06
III. Wert des Teilsondervermögens		46.522.692,09	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 DivDAX[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE0008404005	Allianz SE		STK	21.484	4.890	2.149	EUR 210,300	4.518.085,20	9,71
DE000BASF111	BASF SE		STK	72.313	16.547	10.979	EUR 66,440	4.804.475,72	10,33
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	81.726	38.964	6.215	EUR 51,210	4.185.188,46	9,00
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	26.657	4.453	5.115	EUR 89,310	2.380.736,67	5,12
DE0006062144	Covestro AG		STK	16.069	4.377	2.708	EUR 54,460	875.117,74	1,88
DE0007100000	Daimler AG		STK	60.568	8.241	19.253	EUR 75,300	4.560.770,40	9,80
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	81.738	14.186	16.223	EUR 57,360	4.688.491,68	10,08
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	265.319	69.125	25.232	EUR 17,812	4.725.862,03	10,16
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE		STK	24.889	26.816	1.927	EUR 51,580	1.283.774,62	2,76
DE000ENAG999	E.ON SE		STK	172.903	27.779	43.378	EUR 9,754	1.686.495,86	3,63
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	14.514	15.331	817	EUR 89,040	1.292.326,56	2,78
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	11.655	2.138	2.427	EUR 230,950	2.691.722,25	5,79
DE0007037129	RWE AG		STK	56.253	9.592	5.749	EUR 30,560	1.719.091,68	3,70
DE0007236101	Siemens AG		STK	34.918	10.329	8.160	EUR 133,620	4.665.743,16	10,03
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	44.897	47.061	2.164	EUR 54,520	2.447.784,44	5,26
							EUR	46.525.666,47	100,01
Summe Wertpapiervermögen							EUR	46.525.666,47	100,01
Bankguthaben, nicht verbriefte									
Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
	Verwahrstelle		EUR	24.628,74			% 100,000	24.628,74	0,05
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-27.603,12			EUR	-27.603,12	-0,06
Wert des Teilsondervermögens							EUR	46.522.692,09	100,00¹⁾
Anteilwert							EUR	195,10	
Umlaufende Anteile							STK	238.450	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2021

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE0005439004	Continental AG	STK	717	9.925	
DE0006047004	HeidelbergCement AG	STK	0	12.597	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK	15.075	15.075	
DE0007664039	Volkswagen AG	STK	0	15.607	
DE000A3H3L51	Vonovia SE - Anrechte	STK	42.088	42.088	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 30.06.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		1.756.672,31	7,367
2. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-221.214,25	-0,928
Summe der Erträge		1.535.458,06	6,439
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-0,64	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-102.988,97	-0,432
3. Sonstige Aufwendungen		-1.131,09	-0,005
davon: Verwahrtgelt	-1.131,09		-0,005
Summe der Aufwendungen		-104.120,70	-0,437
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.431.337,36	6,003
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.299.414,66	5,449
2. Realisierte Verluste		-520.997,76	-2,185
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		778.416,90	3,264
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.209.754,26	9,267
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		5.096.354,60	21,373
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.665.731,43	11,179
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		7.762.086,03	32,552
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		9.971.840,29	41,819

Entwicklung des Teilsondervermögen

	EUR	EUR
		2020 / 2021
I. Wert des Teilsondervermögen am Beginn des Geschäftsjahres		34.557.898,72
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.244.298,00
2. Mittelzufluss (netto)		3.395.756,08
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	5.447.811,34	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-2.052.055,26	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-158.505,00
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		9.971.840,29
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	5.096.354,60	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	2.665.731,43	
II. Wert des Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres		46.522.692,09

Verwendung der Erträge des Teilsondervermögen

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		7.000.071,57	29,357
1. Vortrag aus dem Vorjahr		4.790.317,31	20,089
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.209.754,26	9,267
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		5.817.359,57	24,397
1. Vortrag auf neue Rechnung		5.817.359,57	24,397
III. Gesamtausschüttung		1.182.712,00	4,960
1. Endausschüttung		1.182.712,00	4,960

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre / Lyxor I DivDAX® UCITS ETF
Geschäftsjahr

	Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2020/2021	46.522.692,09	195,10
2019/2020	34.557.898,72	155,81
2018/2019	31.172.569,36	166,25
2017/2018	24.979.442,39	170,22

Lyxor 1 DivDAX® UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 DivDAX® UCITS ETF (I)

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF9033
Anteilwert	EUR	195,10
Umlaufende Anteile	STK	238.450
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,25
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

100,01

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 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 Aufwendungen setzen sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	1.052,80
-------------------------	----------

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 Sondervermögens 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 Aufwendungsersatzungen, 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® UCITS ETF (I)

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	95.457,19
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	22,05
Davon für die Verwahrstelle	%	22,12
Davon für Dritte	%	55,83

Transaktionskosten

EUR

2.207,90

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 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 25.968.848,48 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	0,385%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,236%

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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S. der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%).

Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

--Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.

Lyxor 1 MDAX[®] UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		228.057.340,35	100,08
1. Aktien		227.612.207,33	99,89
- Aeronautik und Weltraum	24.318.846,60		10,67
- Audiovisuelle Industrie	2.252.295,38		0,99
- Banken	4.045.399,28		1,78
- Bau und Baustoffe	2.379.896,14		1,04
- Bergbau	4.666.372,74		2,05
- Büroausstattung	4.264.697,95		1,87
- Chemische Industrie	29.614.744,86		13,00
- Einzelhandel	18.039.555,53		7,92
- Elektrik / Elektronik	10.677.177,75		4,69
- Energieversorger	4.118.174,88		1,81
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	20.059.075,64		8,80
- Papier- und Verpackungsindustrie	1.791.425,75		0,79
- Pharmaindustrie / Biotech	31.934.809,24		14,01
- Real Estate	16.237.505,74		7,13
- Software	8.404.868,74		3,69
- Sonstige industrielle Werte	4.361.605,00		1,91
- Telekommunikation	12.129.544,36		5,32
- Textilien und Kleidung	6.267.482,60		2,75
- Transportation	3.239.079,35		1,42
- Unterhaltungsindustrie	3.370.784,40		1,48
- Verbrauchsgüter	9.677.329,10		4,25
- Versicherungen	5.761.536,30		2,53
2. Forderungen		64.761,54	0,03
3. Bankguthaben		380.371,48	0,17
II. Verbindlichkeiten		-183.700,36	-0,08
III. Wert des Teilsondervermögens		227.873.639,99	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 MDAX[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE	STK		76.155	84.089	7.934	EUR 22,850	1.740.141,75	0,76
DE000A0LD2U1	alstria office REIT-AG	STK		114.906	66.724	27.446	EUR 15,590	1.791.384,54	0,79
DE0006766504	Aurubis AG	STK		22.050	11.516	1.619	EUR 78,160	1.723.428,00	0,76
DE000A2LQ884	AUTO1 Group SE	STK		71.299	71.299	0	EUR 37,050	2.641.627,95	1,16
DE0005158703	Bechtle AG	STK		18.563	9.163	2.222	EUR 156,650	2.907.893,95	1,28
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK		66.556	67.127	571	EUR 101,750	6.772.073,00	2,97
DE000A1DAHH0	Brenntag AG	STK		105.087	52.835	13.542	EUR 78,420	8.240.922,54	3,62
DE0005419105	CANCOM SE	STK		26.604	13.272	3.084	EUR 51,000	1.356.804,00	0,60
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		24.857	12.134	2.840	EUR 162,950	4.050.448,15	1,78
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK		676.262	327.858	74.996	EUR 5,982	4.045.399,28	1,78
DE000A288904	CompuGroup Medical SE & Co.KGaA	STK		17.598	10.916	2.469	EUR 66,050	1.162.347,90	0,51
DE0005470306	CTS Eventim AG & Co. KGaA	STK		39.936	20.850	3.828	EUR 52,700	2.104.627,20	0,92
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG	STK		341.315	195.954	26.673	EUR 9,490	3.239.079,35	1,42
DE0005565204	Dürr AG	STK		33.438	16.495	3.951	EUR 32,080	1.072.691,04	0,47
DE0006095003	ENCAVIS AG	STK		68.540	70.292	1.752	EUR 15,940	1.092.527,60	0,48
DE000A3E5AN9	ENCAVIS AG - Anrechte	STK		69.651	69.651	0	EUR 0,000	0,00	0,00
DE000EVNK013	Evonik Industries AG	STK		130.239	68.340	19.642	EUR 28,280	3.683.158,92	1,62
DE0005664809	Evotec AG	STK		92.635	48.359	8.048	EUR 38,230	3.541.436,05	1,55
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG	STK		25.057	12.149	2.780	EUR 57,460	1.439.775,22	0,63
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG	STK		90.839	47.987	11.683	EUR 19,920	1.809.512,88	0,79
DE0005790430	FUCHS PETROLUB SE	STK		47.272	24.024	6.349	EUR 41,020	1.939.097,44	0,85
DE0006602006	GEA Group AG	STK		100.803	52.155	14.379	EUR 34,160	3.443.430,48	1,51
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG	STK		19.211	9.578	2.395	EUR 93,250	1.791.425,75	0,79
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK		40.833	21.027	5.759	EUR 141,100	5.761.536,30	2,53
DE000A13SX22	HELLA GmbH & Co. KGaA	STK		30.230	14.656	3.353	EUR 57,760	1.746.084,80	0,77
DE000A161408	HelloFresh SE	STK		118.045	64.147	6.082	EUR 81,980	9.677.329,10	4,25
DE0006070006	HOCHTIEF AG	STK		14.517	7.589	1.989	EUR 64,760	940.120,92	0,41
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG	STK		37.086	19.152	7.018	EUR 45,880	1.701.505,68	0,75
DE000KSA6888	K+S Aktiengesellschaft	STK		130.185	63.116	14.439	EUR 11,480	1.494.523,80	0,66
DE000KGX8881	KION GROUP AG	STK		48.795	29.301	8.114	EUR 89,880	4.385.694,60	1,92
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG	STK		44.965	29.173	4.692	EUR 97,000	4.361.605,00	1,91
DE0005470405	LANXESS AG	STK		55.608	29.147	6.444	EUR 57,820	3.215.254,56	1,41
DE000LEG1110	LEG Immobilien AG	STK		49.038	25.748	6.098	EUR 121,450	5.955.665,10	2,61
DE0006632003	MorphoSys AG	STK		22.300	10.802	2.434	EUR 65,420	1.458.866,00	0,64
DE0006452907	Nemetschek SE	STK		38.047	20.935	6.389	EUR 64,520	2.454.792,44	1,08
DE000A0D6554	Nordex SE	STK		53.398	53.438	40	EUR 20,480	1.093.591,04	0,48
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE	STK		104.152	104.231	79	EUR 90,360	9.411.174,72	4,13
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	STK		134.265	71.009	14.416	EUR 16,775	2.252.295,38	0,99
DE0006969603	PUMA SE	STK		62.332	32.103	5.026	EUR 100,550	6.267.482,60	2,75
DE0007010803	RATIONAL AG	STK		3.469	1.704	407	EUR 764,000	2.650.316,00	1,16
DE0007030009	Rheinmetall AG	STK		29.382	14.945	3.910	EUR 83,300	2.447.520,60	1,07
DE0007165631	Sartorius AG	STK		16.734	8.484	6.304	EUR 439,000	7.346.226,00	3,22
DE000A12DM80	Scout24 AG	STK		57.269	33.219	19.783	EUR 71,120	4.072.971,28	1,79
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	STK		189.124	141.230	15.217	EUR 51,680	9.773.329,10	4,29
DE000A2GS401	Software AG	STK		34.684	17.482	3.672	EUR 37,940	1.315.910,96	0,58
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA	STK		18.744	9.485	1.927	EUR 67,550	1.266.157,20	0,56
DE000SYM9999	Symrise AG	STK		82.681	42.936	14.904	EUR 117,500	9.715.017,50	4,26
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK		99.645	52.053	14.794	EUR 26,760	2.666.500,20	1,17
DE000A2YN900	TeamViewer AG	STK		109.452	63.826	6.328	EUR 31,720	3.471.817,44	1,52
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK		622.746	350.816	117.964	EUR 2,225	1.385.609,85	0,61
DE0007500001	thyssenkrupp AG	STK		334.806	162.317	37.129	EUR 8,790	2.942.944,74	1,29
DE000UNSE018	Uniper SE	STK		62.204	33.268	12.518	EUR 31,060	1.932.056,24	0,85
DE0005089031	United Internet AG	STK		64.380	32.539	12.754	EUR 34,480	2.219.822,40	0,97
DE000A0TGJ55	VARTA AG	STK		12.237	5.934	903	EUR 130,000	1.590.810,00	0,70
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG	STK		10.202	11.190	988	EUR 130,050	1.326.770,10	0,58
DE000ZAL1111	Zalando SE	STK		120.147	60.154	12.509	EUR 101,950	12.248.986,65	5,38
							EUR	192.140.120,51	84,32
Ausland									
NL0000235190	Airbus SE	STK		201.765	109.900	65.539	EUR 108,400	21.871.326,00	9,60
LU1673108939	Aroundtown SA	STK		663.649	346.765	196.211	EUR 6,580	4.366.810,42	1,92
LU0775917882	Grand City Properties S.A.	STK		63.966	34.364	13.756	EUR 22,780	1.457.145,48	0,64
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK		155.497	75.423	17.222	EUR 40,760	6.338.057,72	2,78
NL0012044747	Shop Apotheke Europe N.V.	STK		9.083	11.458	2.375	EUR 158,400	1.438.747,20	0,63
							EUR	35.472.086,82	15,57
							EUR	227.612.207,33	99,89
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
							EUR	380.371,48	0,17
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle			EUR	380.371,48			% 100,000	380.371,48	0,17
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenforderungen			EUR	64.027,69			EUR	64.761,54	0,03
Quellensteuererstattungsansprüche			EUR	733,85				64.027,69	0,03
								733,85	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
							EUR	-183.700,36	-0,08

Verbindlichkeiten Aktien	EUR	-19.965,40			-19.965,40	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR	-163.734,96			-163.734,96	-0,07
Wert des Teilsondervermögens						
Anteilwert				EUR	227.873.639,99	100,00 ¹⁾
Umlaufende Anteile				EUR	180,69	
				STK	1.261.150	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Teilsondervermögen sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2021

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					
DE0005408116	Aareal Bank AG	STK	18.605	44.095	
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE	STK	1.104	62.174	
DE000A161N30	GRENKE AG	STK	990	12.678	
DE000A289A57	GRENKE AG - Anrechte	STK	11.899	11.899	
DE000A3H22F2	KION GROUP AG - Anrechte	STK	28.017	28.017	
DE000LEG1201	LEG Immobilien AG - Anrechte	STK	29.327	29.327	
DE000LEG1227	LEG Immobilien SE - Anrechte	STK	50.168	50.168	
DE000BFB0019	METRO AG	STK	48.167	120.153	
DE000LED4000	OSRAM Licht AG	STK	8.917	22.956	
DE000A12UKK6	Rocket Internet SE	STK	2.142	33.859	
DE000A3H3LR9	Scout24 AG - Anrechte	STK	65.380	65.380	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK	327.368	327.368	
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK	6.446	15.283	
Ausland					
LU2264048211	Aroundtown SA - Anrechte	STK	504.977	504.977	
QS0491798ATT	AROUNDTOWN SA - Anrechte	STK	504.977	504.977	
LU2181585527	Grand City Properties S.A. - Anrechte	STK	0	43.358	
LU0061462528	RTL Group S.A.	STK	1.022	16.152	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 30.06.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		2.887.960,52	2,290
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		117.229,99	0,093
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-287.579,41	-0,228
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-17.584,47	-0,014
Summe der Erträge		2.700.026,63	2,141
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-17,72	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-604.613,35	-0,479
3. Sonstige Aufwendungen		-2.139,11	-0,002
davon: Verwahrtgelt	-2.139,11		-0,002
Summe der Aufwendungen		-606.770,18	-0,481
III. Ordentlicher Nettoertrag		2.093.256,45	1,660
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		12.382.531,00	9,818
2. Realisierte Verluste		-4.240.766,74	-3,363
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		8.141.764,26	6,456
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		10.235.020,71	8,116
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		21.472.136,81	17,026
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		8.716.674,79	6,912
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		30.188.811,60	23,938
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		40.423.832,31	32,053

Entwicklung des Teilsndervermögen

	EUR	EUR
I. Wert des Teilsndervermögen am Beginn des Geschäftsjahres		107.645.218,05
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.006.980,00
2. Mittelzufluss (netto)		83.499.497,82
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	94.978.460,15	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-11.478.962,33	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-2.687.928,19
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		40.423.832,31
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	21.472.136,81	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	8.716.674,79	
II. Wert des Teilsndervermögen am Ende des Geschäftsjahres		227.873.639,99

Verwendung der Erträge des Teilsndervermögen

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		12.556.836,38	9,957
1. Vortrag aus dem Vorjahr		2.321.815,67	1,841
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		10.235.020,71	8,116
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		11.119.125,38	8,817
1. Vortrag auf neue Rechnung		11.119.125,38	8,817
III. Gesamtausschüttung		1.437.711,00	1,140
1. Endausschüttung		1.437.711,00	1,140

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Teilsndervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2020/2021	227.873.639,99	180,69
2019/2020	107.645.218,05	139,02
2018/2019	91.953.133,11	140,89
2016/2017	80.329.541,32	145,92

Lyxor 1 MDAX® UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 MDAX® UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF9074
Anteilwert	EUR	180,69
Umlaufende Anteile	STK	1.261.150
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,30
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,89

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 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 Aufwendungen setzen sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	1.461,75
-------------------------	----------

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 Sondervermögens 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 Aufwendungsersatzungen, 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® UCITS ETF

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	465.852,33
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	32,92
Davon für die Verwahrstelle	%	20,64
Davon für Dritte	%	46,44

Transaktionskosten

EUR

10.177,46

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 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 189.500.664,92 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	0,124%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,341%

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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S. der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%). Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

--Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.

Lyxor 1 EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		35.607.711,58	100,04
1. Aktien		35.549.657,22	99,87
- Aeronautik und Weltraum	1.281.953,44		3,60
- Audiovisuelle Industrie	257.208,07		0,72
- Banken	2.418.535,90		6,79
- Bau und Baustoffe	1.038.039,44		2,92
- Chemische Industrie	3.069.896,55		8,62
- Einzelhandel	393.865,47		1,11
- Elektrik / Elektronik	4.323.579,26		12,15
- Energieversorger	3.205.151,00		9,00
- Holdinggesellschaften	318.726,36		0,90
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	1.888.404,92		5,31
- Pharmaindustrie / Biotech	3.910.455,67		10,99
- Real Estate	350.999,76		0,99
- Software	1.548.247,52		4,35
- Sonstige Finanzdienstleistungen	1.021.762,20		2,87
- Sonstige industrielle Werte	1.192.291,26		3,35
- Telekommunikation	1.126.335,60		3,16
- Textilien und Kleidung	3.434.223,90		9,65
- Transportation	674.037,36		1,89
- Unterhaltungsindustrie	305.705,40		0,86
- Verbrauchsgüter	1.845.256,00		5,18
- Versicherungen	1.944.982,14		5,46
2. Forderungen		33.109,64	0,09
3. Bankguthaben		24.944,72	0,07
II. Verbindlichkeiten		-13.111,42	-0,04
III. Wert des Teilsondervermögens		35.594.600,16	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	2.227	878	1.484	EUR 313,900	699.055,30	1,96	
DE0008404005	Allianz SE		STK	4.918	1.971	3.470	EUR 210,300	1.034.255,40	2,91	
DE000BASF111	BASF SE		STK	10.956	4.352	7.523	EUR 66,440	727.916,64	2,05	
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	11.718	4.655	8.048	EUR 51,210	600.078,78	1,69	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	3.822	1.519	2.626	EUR 89,310	341.342,82	0,96	
DE0007100000	Daimler AG		STK	10.013	3.977	6.876	EUR 75,300	753.978,90	2,12	
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	2.266	900	1.556	EUR 147,200	333.555,20	0,94	
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	11.751	4.706	8.069	EUR 57,360	674.037,36	1,89	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	38.677	15.363	26.560	EUR 17,812	688.914,72	1,94	
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	15.577	25.125	9.548	EUR 33,820	526.814,14	1,48	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	1.671	664	1.148	EUR 230,950	385.917,45	1,08	
DE0007164600	SAP SE		STK	13.028	5.183	8.985	EUR 118,840	1.548.247,52	4,35	
DE0007236101	Siemens AG		STK	8.923	3.544	6.131	EUR 133,620	1.192.291,26	3,35	
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	2.184	868	1.500	EUR 211,200	461.260,40	1,30	
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	6.438	10.420	3.982	EUR 54,520	350.999,76	0,99	
							EUR	10.318.666,05	28,99	
Ausland										
NL0012969182	Adyen N.V.		STK	334	543	209	EUR 2.060,500	688.207,00	1,93	
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.		STK	12.473	5.238	9.695	EUR 25,070	312.698,11	0,88	
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét. Expl. P.G. Cl.		STK	5.651	2.246	3.876	EUR 147,660	834.426,66	2,34	
NL0000235190	Airbus SE		STK	6.944	2.773	4.750	EUR 108,440	753.007,36	2,12	
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.		STK	5.373	2.134	3.690	EUR 59,320	318.726,36	0,90	
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.		STK	10.102	4.000	6.876	EUR 60,810	614.302,62	1,73	
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	5.004	2.012	3.555	EUR 579,400	2.899.317,60	8,15	
FR0000120628	AXA S.A.		STK	24.541	9.784	17.060	EUR 21,385	524.809,29	1,47	
ES0113900J37	Banco Santander S.A.		STK	206.837	92.779	141.546	EUR 3,220	665.911,72	1,87	
FR0000131104	BNP Paribas S.A.		STK	13.755	5.464	9.446	EUR 52,870	727.226,85	2,04	
IE0001827041	CRH PLC		STK	9.484	3.784	6.599	EUR 42,500	403.070,00	1,13	
FR0000120644	Danone S.A.		STK	7.751	3.080	5.309	EUR 59,370	460.176,87	1,29	
IT0003128367	ENEL S.p.A.		STK	92.660	36.807	63.632	EUR 7,832	725.713,12	2,04	
FR0010208488	Engie S.A.		STK	22.181	8.810	15.231	EUR 11,554	256.279,27	0,72	
IT0003132476	ENI S.p.A.		STK	29.963	11.983	21.092	EUR 10,270	307.720,01	0,86	
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.		STK	3.557	1.425	2.431	EUR 155,640	553.611,48	1,56	
FR0014002ZS9	EssilorLuxottica S.A. - Anrechte		STK	3.249	3.249	0	EUR 0,000	0,00	0,00	
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC		STK	2.002	3.213	1.211	EUR 152,700	305.705,40	0,86	
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.		STK	69.902	31.423	52.277	EUR 10,280	718.592,56	2,02	
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA		STK	13.257	5.267	9.104	EUR 29,710	393.865,47	1,11	
NL0011821202	ING Groep N.V.		STK	46.548	18.502	31.948	EUR 11,140	518.544,72	1,46	
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.		STK	217.580	115.853	149.304	EUR 2,330	506.852,61	1,42	
FR0000121485	Kering S.A.		STK	874	351	624	EUR 737,000	644.138,00	1,81	
FI0009013403	KONE Oyj		STK	4.823	7.878	3.055	EUR 68,800	331.822,40	0,93	
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.		STK	10.867	4.609	7.535	EUR 41,790	454.131,93	1,28	
IE00BZ12WP82	Linde PLC		STK	6.195	2.580	4.876	EUR 243,350	1.507.553,25	4,24	
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE		STK	3.162	1.257	2.182	EUR 661,300	2.091.030,60	5,87	
FR0000120321	Oréal S.A., L'		STK	2.923	1.169	1.994	EUR 375,800	1.098.463,40	3,09	
FR0000120693	Permod-Ricard S.A.		STK	2.447	3.947	1.500	EUR 187,200	458.078,40	1,29	
NL0013654783	Prosus N.V.		STK	5.304	8.643	3.339	EUR 82,470	437.420,88	1,23	
FR0000073272	SAFRAN		STK	4.524	2.123	3.068	EUR 116,920	528.946,08	1,49	
FR0000120578	Sanofi S.A.		STK	13.628	5.419	9.293	EUR 88,360	1.204.170,08	3,38	
FR0000121972	Schneider Electric SE		STK	6.764	2.922	4.632	EUR 132,680	897.447,52	2,52	
FR0000120271	TotalEnergies SE		STK	31.368	12.402	21.054	EUR 38,155	1.196.846,04	3,36	
FR0000125486	VINCI S.A.		STK	7.056	3.123	4.617	EUR 89,990	634.969,44	1,78	
FR0000127771	Vivendi S.A.		STK	9.079	4.091	8.318	EUR 28,330	257.208,07	0,72	
							EUR	25.230.991,17	70,88	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	35.549.657,22	99,87
Bankguthaben, nicht briefierte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	24.944,72	0,07
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrestelle								EUR	24.944,72	0,07
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	33.109,64	0,09
Dividendenforderungen								EUR	20.702,88	0,06
Quellensteuererstattungsansprüche								EUR	12.406,76	0,03
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-13.111,42	-0,04
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung								EUR	-13.111,42	-0,04
Wert des Teilsondervermögens								EUR	35.594.600,16	100,00 ¹⁾
Anteilwert								EUR	41,68	
Umlaufende Anteile								STK	854.000	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2021

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK	1.167	7.491	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK	6.562,00	6.562,00	
DE000A3H3L51	Vonovia SE - Anrechte	STK	5.788	5.788	
Ausland					
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK	18.936	121.495	
ES0113902342	Banco Santander S.A.	STK	13.311	13.311	
ES06139009S5	Banco Santander S.A. - Anrechte	STK	306.156	306.156	
ES06445809L2	Iberdrola S.A - Anrechte	STK	106.798	106.798	
ES0144583236	Iberdrola S.A.	STK	1.525	1.525	
ES0144583228	Iberdrola S.A.	STK	2.062	2.062	
ES06445809K4	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	90.756	90.756	
NL0015031550	Koninklijke Philips N.V. - Anrechte	STK	0	13.793	
NL0015000AH4	Koninklijke Philips N.V. - Anrechte	STK	9.943	9.943	
FI0009000681	Nokia Oyj	STK	21.057	108.020	
FR0000133308	Orange S.A.	STK	5.622	36.075	
NL0015436106	Prosus N.V. - Anrechte	STK	7.799	7.799	
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	2.423	15.549	
ES0178430072	Telefónica S.A - Anrechte	STK	2.985	2.985	
ES0178430E18	Telefónica S.A.	STK	16.227	84.965	
ES06784309C1	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	0	71.643	
FR0013517257	Total S.A. - Anrechte	STK	0	40.020	
NL0000388619	Unilever N.V.	STK	5.109	26.208	
FR0013508132	VINCI S.A. - Anrechte	STK	0	8.550	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 30.06.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		297.360,80	0,348
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		518.564,02	0,607
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-39.354,39	-0,046
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-17.774,21	-0,021
Summe der Erträge		758.796,22	0,889
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-240,88	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-46.598,22	-0,055
3. Sonstige Aufwendungen		-864,83	-0,001
davon: Verwahrtgelt	-864,83		-0,001
Summe der Aufwendungen		-47.703,93	-0,056
III. Ordentlicher Nettoertrag		711.092,29	0,833
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		5.902.484,96	6,912
2. Realisierte Verluste		-2.245.994,35	-2,630
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		3.656.490,61	4,282
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		4.367.582,90	5,114
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		2.560.243,61	2,998
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		5.272.779,61	6,174
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		7.833.023,22	9,172
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		12.200.606,12	14,286

Entwicklung des Teisondervermögen

	EUR	EUR
I. Wert des Teisondervermögen am Beginn des Geschäftsjahres		36.328.112,78
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-927.675,00
2. Mittelzufluss (netto)		-11.304.888,63
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	11.865.749,62	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-23.170.638,25	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-701.555,11
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		12.200.606,12
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	2.560.243,61	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	5.272.779,61	
II. Wert des Teisondervermögen am Ende des Geschäftsjahres		35.594.600,16

Verwendung der Erträge des Teisondervermögen

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		4.411.141,14	5,165
1. Vortrag aus dem Vorjahr		43.558,24	0,051
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		4.367.582,90	5,114
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		3.813.341,14	4,465
1. Vortrag auf neue Rechnung		3.813.341,14	4,465
III. Gesamtausschüttung		597.800,00	0,700
1. Endausschüttung		597.800,00	0,700

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
2020/2021	35.594.600,16	41,68
2019/2020	36.328.112,78	33,17
2018/2019	35.367.583,36	35,91
2016/2017	40.155.470,16	35,02

Lyxor 1 EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 EURO STOXX 50[®] UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF9504
Anteilwert	EUR	41,68
Umlaufende Anteile	STK	854.000
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,15
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,87

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 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 Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	1.216,45
-------------------------	----------

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 DivDAX[®] UCITS ETF (I)

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	63.723,48
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	-34,83
Davon für die Verwahrstelle	%	41,63
Davon für Dritte	%	93,20

Transaktionskosten

EUR

3.860,55

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 99,47 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 42.834.414,26 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	0,257%
Höhe der Annual Tracking Difference	0,838%

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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S. der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%). Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

--Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.

Lyxor 1 SDAX[®] UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		19.807.286,27	100,22
1. Aktien		19.776.161,81	100,07
- Audiovisuelle Industrie	509.635,50		2,58
- Banken	320.062,47		1,62
- Bau und Baustoffe	914.803,40		4,63
- Bergbau	475.618,04		2,41
- Büroausstattung	786.637,86		3,98
- Chemische Industrie	332.715,14		1,68
- Einzelhandel	1.214.180,75		6,14
- Elektrik / Elektronik	1.370.462,00		6,93
- Energieversorger	217.829,28		1,10
- Holdinggesellschaften	1.135.439,20		5,75
- Landwirtschaft und Fischerei	139.375,60		0,71
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	3.260.979,76		16,50
- Pharmaindustrie / Biotech	1.303.722,00		6,60
- Real Estate	1.784.113,95		9,03
- Sonstige Dienstleistungen	236.388,60		1,20
- Sonstige Finanzdienstleistungen	944.161,93		4,78
- Sonstige industrielle Werte	590.383,30		2,99
- Telekommunikation	2.251.577,52		11,39
- Transportation	134.598,80		0,68
- Unterhaltungsindustrie	290.662,97		1,47
- Verbrauchsgüter	630.526,14		3,19
- Verkehr	410.777,60		2,08
- Versicherungen	521.510,00		2,64
2. Forderungen		12.302,22	0,06
3. Bankguthaben		18.822,24	0,10
II. Verbindlichkeiten		-43.973,63	-0,22
III. Wert des Teilsondervermögens		19.763.312,64	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 SDAX[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30.Juni 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE0005545503	1&1 AG	STK		12.422	3.748	1.242	EUR 25,800	320.487,60	1,62
DE0005408116	Aareal Bank AG	STK		16.189	18.226	2.037	EUR 19,470	315.199,83	1,59
DE0005103006	ADVA Optical Networking SE	STK		12.319	3.740	1.154	EUR 11,680	143.885,92	0,73
DE0005093108	AMADEUS FIRE AG	STK		1.533	501	152	EUR 154,200	236.388,60	1,20
DE0005194062	BayWa AG	STK		3.829	1.272	468	EUR 36,400	139.375,60	0,71
DE0005909006	Bilfinger SE	STK		6.804	2.410	2.085	EUR 25,240	171.732,96	0,87
DE0005493092	Borussia Dortmund GmbH&Co.KGaA	STK		18.338	7.498	1.706	EUR 6,215	113.970,67	0,58
DE0007257503	CECONOMY AG	STK		48.054	14.500	4.804	EUR 4,116	197.790,26	1,00
DE0005403901	CEWE Stiftung & Co. KGaA	STK		1.518	506	194	EUR 130,600	198.250,80	1,00
DE000A2GS5D8	Dermapharm Holding SE	STK		5.441	2.689	309	EUR 67,250	365.907,25	1,85
DE0007480204	Deutsche EuroShop AG	STK		14.131	4.285	1.491	EUR 20,000	282.620,00	1,43
DE0008019001	Deutsche Pfandbriefbank AG	STK		38.386	12.540	4.795	EUR 8,338	320.062,47	1,62
DE0006305006	DEUTZ AG	STK		34.500	10.410	3.449	EUR 6,820	235.290,00	1,19
DE000A1X3XX4	DIC Asset AG	STK		10.606	4.871	3.598	EUR 14,570	154.529,42	0,78
DE0005550636	Drägerwerk AG & Co. KGaA	STK		2.455	740	245	EUR 79,800	195.909,00	0,99
DE000DWS1007	DWS Group GmbH & Co. KGaA	STK		8.855	3.414	1.627	EUR 38,220	338.438,10	1,71
DE0005659700	Eckert & Ziegler Str.-u.Med.AG	STK		4.041	3.641	399	EUR 96,350	389.350,35	1,97
DE0007856023	ElringKlinger AG	STK		8.674	9.122	448	EUR 15,010	130.196,74	0,66
DE0005772206	Fielmann AG	STK		6.795	2.050	679	EUR 65,950	448.130,25	2,27
DE000FTG1111	flatexDEGIRO AG	STK		4.160	4.373	213	EUR 113,500	472.160,00	2,39
DE000A161N30	GRENKE AG	STK		7.852	15.299	7.447	EUR 37,000	290.524,00	1,47
DE000A3H2333	HAMBORNER REIT AG	STK		20.851	22.257	1.406	EUR 8,979	187.221,13	0,95
DE000A0S8488	Hamburger Hafen u. Logistik AG	STK		6.349	2.362	1.055	EUR 21,200	134.598,80	0,68
DE000A3E5AY6	Hamburger Hafen und Logistik AG - Anrechte	STK		6.464	6.464	0	EUR 0,000	0,00	0,00
DE000HAG0005	HENSOLDT AG	STK		9.579	11.435	1.856	EUR 15,200	145.600,80	0,74
DE000A14KEB5	home24 SE	STK		7.757	8.158	401	EUR 15,750	122.172,75	0,62
DE0006083405	Hornbach Holding AG&Co.KGaA	STK		2.491	784	572	EUR 96,100	239.385,10	1,21
DE0005493365	Hypoport SE	STK		1.159	351	117	EUR 436,000	505.324,00	2,56
DE0006200108	INDUS Holding AG	STK		5.918	2.273	522	EUR 33,400	197.661,20	1,00
DE000A2NBX80	Instone Real Estate Group AG	STK		13.413	8.044	3.059	EUR 25,400	340.690,20	1,72
DE000A2NB601	JENOPTIK AG	STK		14.541	4.495	1.561	EUR 23,060	335.315,46	1,70
DE000JST4000	JOST Werke AG	STK		3.805	1.288	708	EUR 50,300	191.391,50	0,97
DE0006219934	Jungheinrich AG	STK		13.701	4.243	1.479	EUR 41,220	564.755,22	2,86
DE000KC01000	Klöckner & Co SE	STK		21.284	6.423	2.128	EUR 11,540	245.617,36	1,24
DE0006335003	KRONES AG	STK		3.785	1.155	491	EUR 75,350	285.199,75	1,44
DE0007074007	KWS SAAT SE & Co. KGaA	STK		2.933	981	314	EUR 69,400	203.550,20	1,03
DE0006450000	LPKF Laser & Electronics AG	STK		6.992	2.125	715	EUR 24,560	171.723,52	0,87
DE000A1MMCC8	Medios AG	STK		3.295	3.562	267	EUR 33,600	110.712,00	0,56
DE000BFB0019	METRO AG	STK		37.356	39.285	1.929	EUR 10,440	389.996,64	1,97
DE000A3H2200	Nagarro SE	STK		1.893	1.893	0	EUR 103,500	195.925,50	0,99
DE000NWRK013	New Work SE	STK		798	247	86	EUR 265,000	211.470,00	1,07
DE000A1H8BV3	NORMA Group SE	STK		9.095	2.865	1.030	EUR 43,180	392.722,10	1,99
DE000LED4000	OSRAM Licht AG	STK		6.911	8.459	1.548	EUR 53,300	368.556,30	1,86
DE000PAT1AG3	PATRIZIA AG	STK		11.884	3.571	1.236	EUR 22,000	261.448,00	1,32
DE0006916604	Pfeiffer Vacuum Technology AG	STK		1.120	347	121	EUR 160,200	179.424,00	0,91
DE000SAFH001	SAF-HOLLAND SE	STK		12.958	14.253	1.295	EUR 11,730	151.997,34	0,77
DE0006202005	Salzgitter AG	STK		9.178	2.995	1.813	EUR 25,060	230.000,68	1,16
DE000SHA0159	Schaeffler AG	STK		35.538	11.832	4.662	EUR 7,780	276.485,64	1,40
DE0007235301	SGL CARBON SE	STK		15.966	16.790	824	EUR 8,090	129.164,94	0,65
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK		2.546	2.546	0	EUR 142,200	362.041,20	1,83
DE0007231326	Sixt SE	STK		3.616	1.090	360	EUR 113,600	410.777,60	2,08
DE000A0DJ6J9	SMA Solar Technology AG	STK		5.365	2.108	514	EUR 48,380	259.558,70	1,31
DE000STRA555	STRATEC SE	STK		2.053	629	197	EUR 117,800	241.843,40	1,22
DE0007297004	Südzucker AG	STK		17.817	5.377	2.215	EUR 13,500	240.529,50	1,22
DE000A1K0235	SÜSS MicroTec SE	STK		4.637	4.877	240	EUR 27,700	128.444,90	0,65
DE0007446007	TAKKT AG	STK		9.317	3.569	1.689	EUR 14,020	130.624,34	0,66
DE000TLX1005	Talanx AG	STK		15.125	5.194	2.142	EUR 34,480	521.510,00	2,64
DE000TRAT0N7	TRATON SE	STK		14.672	5.152	2.192	EUR 26,740	392.329,28	1,99
DE000A3H3LL2	Vantage Towers AG	STK		27.359	27.359	0	EUR 27,160	743.070,44	3,76
DE000A0JL9W6	VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG	STK		5.099	5.382	283	EUR 42,720	217.829,28	1,10
DE0007667107	Vossloh AG	STK		2.502	808	303	EUR 42,550	106.460,10	0,54
DE000WACK012	Wacker Neuson SE	STK		8.203	2.722	1.231	EUR 24,240	198.840,72	1,01
DE000A2N4H07	Westwing Group AG	STK		3.673	3.862	189	EUR 46,140	169.472,22	0,86
DE000ZEAL241	Zeal Network SE	STK		4.217	1.357	506	EUR 41,900	176.692,30	0,89
DE0005111702	zooplus AG	STK		1.838	555	184	EUR 273,200	502.141,60	2,54
							EUR	17.030.275,53	86,17
Ausland									
LU1250154413	ADLER Group S.A.	STK		25.140	19.676	6.658	EUR 22,180	557.605,20	2,82
LU1704650164	BEFESA S.A.	STK		9.724	2.974	1.012	EUR 64,800	630.115,20	3,19
LU2010095458	Global Fashion Group S.A.	STK		24.259	25.676	1.417	EUR 12,770	309.787,43	1,57
LU0061462528	RTL Group S.A.	STK		10.142	11.727	1.585	EUR 50,250	509.635,50	2,58
AT0000A0E9W5	S&T AG	STK		13.233	4.219	1.771	EUR 19,300	255.396,90	1,29
LU1066226637	Stabilus S.A.	STK		7.051	2.181	758	EUR 68,550	483.346,05	2,45
							EUR	2.745.886,28	13,89
Summe Wertpapiervermögen							EUR	19.776.161,81	100,07

Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds			EUR	18.822,24	0,10
EUR-Guthaben bei:					
Verwahrstelle	EUR	18.822,24	%	100,000	0,10
Sonstige Vermögensgegenstände			EUR	12.302,22	0,06
Dividendenforderungen	EUR	11.724,00		11.724,00	0,06
Quellensteuererstattungsansprüche	EUR	578,22		578,22	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	-43.973,63	-0,22
Verbindlichkeiten Aktien	EUR	-11.574,88		-11.574,88	-0,06
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR	-32.398,75		-32.398,75	-0,16
Wert des Teilsondervermögens			EUR	19.763.312,64	100,00 ¹⁾
Anteilwert			EUR	73,94	
Umlaufende Anteile			STK	267.300	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2021

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE	STK	0	25.484	
DE0005104400	ATOSS Software AG	STK	0	772	
DE000A2LQ884	AUTO1 Group SE	STK	28.554	28.554	
DE0005232805	Bertrandt AG	STK	0	1.286	
DE000A0LAUP1	CropEnergies AG	STK	6.319	6.319	
DE000A1TNUT7	Deutsche Beteiligungs AG	STK	642	2.985	
DE000A254WR1	DIC Asset AG - Anrechte	STK	9.333	9.333	
DE000A3H3MA3	DIC Asset AG - Anrechte	STK	10.351	10.351	
DE0005878003	DMG MORI AG	STK	64	2.654	
DE0005157101	Dr. Höhle AG	STK	31	1.287	
DE0006095003	ENCAVIS AG	STK	5.749	28.993	
DE0006013006	HAMBORNER REIT AG	STK	0	15.903	
DE000A289V94	HAMBORNER REIT AG - Anrechte	STK	16.603	16.603	
DE000A3H3MZ0	HAMBORNER REIT AG - Anrechte	STK	20.126	20.126	
DE000A289VH0	Hamburger Hafen und Logistik AG - Anrechte	STK	5.042	5.042	
DE0006084403	HORNBAACH Baumarkt AG	STK	2.140	2.140	
DE000A289WQ9	Instone Real Estate Group AG	STK	8.428	8.428	
DE0007193500	Koenig & Bauer AG	STK	1.195	4.386	
DE0005408884	LEONI AG	STK	8.985	16.429	
DE0006569908	MLP SE	STK	0	12.897	
DE000A0D6554	Nordex SE	STK	5.954	21.411	
DE0007042301	RHÖN-KLINIKUM AG	STK	0	1.845	
DE000A12UKK6	Rocket Internet SE	STK	16.799	16.799	
DE0007276503	secunet Security Networks AG	STK	309	309	
DE0007203705	SNP Schneider-Neureither & Partner SE	STK	511	1.485	
DE000TCAG172	Tele Columbus AG	STK	17.234	17.234	
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG	STK	0	3.418	
DE0007507501	WashTec AG	STK	69	2.901	
DE0008051004	Wüstenrot& Württembergische AG	STK	123	5.179	
Ausland					
LU2199485652	ADO Properties S.A. - Anrechte	STK	12.122	12.122	
LU1296758029	Corestate Capital Holding S.A	STK	3.780	7.724	
LU0307018795	SAF HOLLAND S.A.	STK	0	10.343	
NL0012044747	Shop Apotheke Europe N.V.	STK	0	2.585	
NL0011375019	Steinhoff Internat'l Hldgs N.V.	STK	0	865.620	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 30.06.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		287.895,98	1,077
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		48.916,38	0,183
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-33.192,76	-0,124
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-11.045,76	-0,041
5. Sonstige Erträge		1,03	0,000
davon: Sonstiges	1,03		0,000
Summe der Erträge		292.574,87	1,095
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-123.103,66	-0,461
2. Sonstige Aufwendungen		-221,13	-0,001
davon: Verwahrtgelt	-221,13		-0,001
Summe der Aufwendungen		-123.324,79	-0,461
III. Ordentlicher Nettoertrag		169.250,08	0,633
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.301.470,97	4,869
2. Realisierte Verluste		-1.161.792,77	-4,346
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		139.678,20	0,523
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		308.928,28	1,156
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		2.130.444,40	7,970
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		1.652.095,04	6,181
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		3.782.539,44	14,151
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.091.467,72	15,307

Entwicklung des Teilsondervermögen

	2020 / 2021
	EUR
I. Wert des Teilsondervermögen am Beginn des Geschäftsjahres	10.547.357,72
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-78.420,00
2. Mittelzufluss (netto)	5.276.433,95
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	5.547.937,68
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-271.503,73
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-73.526,75
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	4.091.467,72
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	2.130.444,40
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	1.652.095,04
II. Wert des Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres	19.763.312,64

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		2.480.411,24	9,280
1. Vortrag aus dem Vorjahr		2.171.482,96	8,124
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		308.928,28	1,156
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		2.397.548,24	8,970
1. Vortrag auf neue Rechnung		2.397.548,24	8,970
III. Gesamtausschüttung		82.863,00	0,310
1. Endausschüttung		82.863,00	0,310

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2020/2021	19.763.312,64	73,94
2019/2020	10.547.357,72	54,16
2018/2019	9.213.184,65	54,53
2017/2018	9.613.749,14	58,44

Lyxor 1 SDAX[®] UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 SDAX[®] UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF9058
Anteilwert	EUR	73,94
Umlaufende Anteile	STK	267.300
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,70
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		100,07
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 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 Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	178,18
-------------------------	--------

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

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

0,70

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 SDAX[®] UCITS ETF

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	99.863,49
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	67,66
Davon für die Verwahrstelle	%	12,42
Davon für Dritte	%	19,92

Transaktionskosten

EUR

3.224,34

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 Teilsondervermögen über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 19.453.032,93 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 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 Teilsondervermögen.

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	0,142%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,985%

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

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S., der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%).

Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

--Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.

Lyxor 1 TecDAX[®] UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30.Juni 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		95.789.319,94	100,12
1. Aktien		95.505.541,70	99,82
- Büroausstattung		6.348.788,81	6,64
- Elektrik / Elektronik		23.356.135,78	24,41,
- Energieversorger		1.224.007,68	1,28
- Maschinenbau und Fahrzeugbau		936.697,04	0,98
- Pharmaindustrie / Biotech		28.451.238,73	29,74
- Software		18.808.089,53	19,66
- Telekommunikation		16.380.584,13	17,12
2. Forderungen		19.406,77	0,02
3. Bankguthaben		264.371,47	0,28
II. Verbindlichkeiten		-115.109,46	-0,12
III. Wert des Teilsondervermögens		95.674.210,48	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 TecDAX[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30.Juni 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE0005545503	1&1 AG	STK		33.131	5.480	5.603	EUR 25,800	854.779,80	0,89
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE	STK		85.236	14.175	14.401	EUR 22,850	1.947.642,60	2,04
DE0005158703	Bechtle AG	STK		20.777	3.439	3.516	EUR 156,650	3.254.717,05	3,40
DE0005419105	CANCOM SE	STK		29.777	6.050	5.728	EUR 51,000	1.518.627,00	1,59
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		27.821	4.601	4.705	EUR 162,950	4.533.431,95	4,74
DE000A288904	CompuGroup Medical SE & Co. KGaA	STK		19.697	6.869	3.593	EUR 66,050	1.300.986,85	1,36
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		531.392	139.826	148.450	EUR 17,812	9.465.154,30	9,89
DE0005550636	Drägerwerk AG & Co. KGaA	STK		6.547	1.082	1.106	EUR 79,800	522.450,60	0,55
DE0005659700	Eckert & Ziegler Str.-u.Med.AG	STK		10.778	9.972	1.874	EUR 96,350	1.038.460,30	1,09
DE0005664809	Evotec SE	STK		103.682	26.260	16.465	EUR 38,230	3.963.762,86	4,14
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG	STK		101.671	21.723	17.906	EUR 19,920	2.025.286,32	2,12
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		288.236	64.417	181.259	EUR 33,820	9.748.141,52	10,19
DE000A2NB601	JENOPTIK AG	STK		38.781	6.470	6.615	EUR 23,060	894.289,86	0,93
DE0006450000	LPKF Laser & Electronics AG	STK		18.649	21.322	2.673	EUR 24,560	458.019,44	0,48
DE0006632003	MorphoSys AG	STK		24.959	4.174	4.214	EUR 65,420	1.632.817,78	1,71
DE0006452907	Nemetschek SE	STK		42.584	9.688	9.273	EUR 64,520	2.747.519,68	2,87
DE000A0D6554	Nordex SE	STK		59.766	17.407	9.478	EUR 20,480	1.224.007,68	1,28
DE0006916604	Pfeiffer Vacuum Technology AG	STK		2.988	499	510	EUR 160,200	478.677,60	0,50
DE0007164600	SAP SE	STK		79.106	36.962	25.008	EUR 118,840	9.400.957,04	9,83
DE0007165631	Sartorius AG	STK		18.729	3.057	10.442	EUR 439,000	8.222.031,00	8,59
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	STK		187.045	100.001	26.199	EUR 51,680	9.666.485,60	10,10
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK		6.790	2.356	11.422	EUR 142,200	965.538,00	1,01
DE000A0DJ6J9	SMA Solar Technology AG	STK		14.307	14.944	637	EUR 48,380	692.172,66	0,72
DE000A2GS401	Software AG	STK		38.820	7.675	6.311	EUR 37,940	1.472.830,80	1,54
DE000A2YN900	TeamViewer AG	STK		122.503	46.349	17.069	EUR 31,720	3.885.795,16	4,06
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK		697.006	163.502	166.103	EUR 2,225	1.550.838,35	1,62
DE0005089031	United Internet AG	STK		72.057	11.181	19.144	EUR 34,480	2.484.525,36	2,60
DE000A0TGJ55	VARTA AG	STK		13.697	3.013	2.245	EUR 130,000	1.780.610,00	1,86
							EUR	87.730.557,16	91,70
Ausland									
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK		174.039	28.691	29.235	EUR 40,760	7.093.829,64	7,41
AT0000A0E9W5	S&T AG	STK		35.293	6.154	7.028	EUR 19,300	681.154,90	0,71
							EUR	7.774.984,54	8,13
							EUR	95.505.541,70	99,82
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:							EUR	264.371,47	0,28
Verwahrstelle							EUR	264.371,47	0,28
							%	100,000	
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenforderungen							EUR	18.982,84	0,02
Quellensteuererstattungsansprüche							EUR	423,93	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Aktien							EUR	-22.350,27	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung							EUR	-92.759,19	-0,10
Wert des Teilsondervermögens							EUR	95.674.210,48	100,00¹⁾
Anteilwert							EUR	27,69	
Umlaufende Anteile							STK	3.455.300	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2021

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE000NWRK013	New Work SE	STK	333	2.470	
DE0007472060	Wirecard AG	STK	2.108	88.879	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 30.06.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		1.295.896,49	0,375
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		10.749,60	0,003
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-95.547,26	-0,028
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-2.956,14	-0,001
Summe der Erträge		1.208.142,69	0,350
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-2,16	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-348.717,34	-0,101
3. Sonstige Aufwendungen		-1.200,48	0,000
davon: Verwahrtgelt	-1.200,48		0,000
Summe der Aufwendungen		-349.919,98	-0,101
III. Ordentlicher Nettoertrag		858.222,71	0,248
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		6.722.762,35	1,946
2. Realisierte Verluste		-8.672.652,44	-2,510
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.949.890,09	-0,564
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.091.667,38	-0,316
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		9.878.761,88	2,859
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		7.531.149,54	2,180
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		17.409.911,42	5,039
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		16.318.244,04	4,723

Entwicklung des Teilsondervermögen

	2020 / 2021 EUR	2020 / 2021 EUR
I. Wert des Teilsondervermögen am Beginn des Geschäftsjahres		81.729.503,55
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-527.482,50
2. Mittelzufluss (netto)		-1.807.646,79
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	11.112.550,21	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-12.920.197,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-38.407,82
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		16.318.244,04
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	9.878.761,88	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	7.531.149,54	
II. Wert des Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres		95.674.210,48

Verwendung der Erträge des Teilsondervermögen

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		6.050.514,37	1,751
1. Vortrag aus dem Vorjahr		7.142.181,75	2,067
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.091.667,38	-0,316
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		5.532.219,37	1,601
1. Vortrag auf neue Rechnung		5.532.219,37	1,601
III. Gesamtausschüttung		518.295,00	0,150
1. Endausschüttung		518.295,00	0,150

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2020/2021	95.674.210,48	27,69
2019/2020	81.729.503,55	23,21
2018/2019	80.138.846,81	22,93
2017/2018	64.708.795,23	21,75

Lyxor 1 TecDAX[®] UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 TecDAX[®] UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9082

Anteilwert	EUR	27,69
Umlaufende Anteile	STK	3.455.300
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,40
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		99,82
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 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 Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	1.222,43
-------------------------	----------

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 Aufwendungsersatzungen, 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[®] UCITS ETF

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	356.513,56
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	50,67
Davon für die Verwahrstelle	%	14,43
Davon für Dritte	%	34,90

Transaktionskosten

EUR

3.574,92

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 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 50.719.914,58 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 ein 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	0,076%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,602%

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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S., der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%).

Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausbezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

--Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.

Lyxor 1 STOXX[®] Europe 600 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		48.982.765,18	100,04
1. Aktien		48.782.064,53	99,63
- Aeronautik und Weltraum	828.158,19		1,69
- Audiovisuelle Industrie	384.523,09		0,79
- Banken	4.222.578,47		8,62
- Bau und Baustoffe	2.016.792,53		4,12
- Bergbau	1.335.759,20		2,73
- Büroausstattung	431.744,16		0,88
- Chemische Industrie	2.351.823,90		4,80
- Einzelhandel	1.677.760,05		3,43
- Elektrik / Elektronik	2.757.980,06		5,63
- Energieversorger	3.977.350,38		8,12
- Freizeit/Tourismus	112.471,86		0,23
- Holdinggesellschaften	555.380,50		1,13
- Landwirtschaft und Fischerei	498.563,51		1,02
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	2.575.194,52		5,26
- Papier und andere Basisprodukte	306.281,14		0,63
- Papier- und Verpackungsindustrie	100.046,12		0,20
- Pharmaindustrie / Biotech	8.022.762,84		16,39
- Real Estate	992.440,06		2,03
- Software	1.063.086,38		2,17
- Sonstige Dienstleistungen	50.697,30		0,10
- Sonstige Finanzdienstleistungen	942.780,26		1,93
- Sonstige industrielle Werte	1.062.096,62		2,17
- Sonstiges	944.595,40		1,93
- Telekommunikation	2.002.052,80		4,09
- Textilien und Kleidung	1.737.885,14		3,55
- Transportation	877.244,76		1,79
- Unterhaltungsindustrie	497.065,93		1,02
- Verbrauchsgüter	4.154.120,58		8,48
- Versicherungen	2.302.828,78		4,70
2. Forderungen		128.158,40	0,26
3. Bankguthaben		72.542,25	0,15
II. Verbindlichkeiten		-21.109,86	-0,04
III. Wert des Teilsondervermögens		48.961.655,32	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 STOXX[®] Europe 600 UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	911	280	1	EUR 313,900	285.962,90	0,58
DE0008404005	Allianz SE		STK	2.011	612	31	EUR 210,300	422.913,30	0,86
DE000A0LD2U1	alstria office REIT-AG		STK	823	263	49	EUR 15,590	12.830,57	0,03
DE000A2LQ884	AUTO1 Group SE		STK	515	515	0	EUR 37,050	19.080,75	0,04
DE000BASF111	BASF SE		STK	4.479	1.352	22	EUR 66,440	297.584,76	0,61
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	4.791	1.447	23	EUR 51,210	245.347,11	0,50
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	1.563	471	7	EUR 89,310	139.591,53	0,29
DE0005158703	Bechtle AG		STK	133	40	1	EUR 156,650	20.834,45	0,04
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	477	145	5	EUR 101,750	48.534,75	0,10
DE000A1DAH00	Brenntag SE		STK	753	227	4	EUR 78,420	59.050,26	0,12
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	178	54	1	EUR 162,950	29.005,10	0,06
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	4.849	1.463	23	EUR 5,982	29.006,72	0,06
DE0005439004	Continental AG		STK	527	159	2	EUR 123,980	65.337,46	0,13
DE0006062144	Covestro AG		STK	942	366	4	EUR 54,460	51.301,32	0,10
DE0005470306	CTS Eventim AG & Co. KGaA		STK	286	103	2	EUR 52,700	15.072,20	0,03
DE0007100000	Daimler AG		STK	4.094	1.236	20	EUR 75,300	308.278,20	0,63
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE		STK	918	475	47	EUR 111,400	102.265,20	0,21
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	10.079	3.041	48	EUR 10,986	110.727,89	0,23
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	927	280	4	EUR 147,200	136.454,40	0,28
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	1.458	639	1	EUR 9,490	13.836,42	0,03
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	4.805	1.458	22	EUR 57,360	275.614,80	0,56
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	15.814	4.771	74	EUR 17,812	281.678,97	0,58
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE		STK	1.633	493	8	EUR 51,580	84.230,14	0,17
DE000ENA9999	E.ON SE		STK	10.303	3.238	632	EUR 9,754	100.495,46	0,21
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	934	283	5	EUR 28,280	26.413,52	0,05
DE0005664809	Evotec SE		STK	665	245	2	EUR 38,230	25.422,95	0,05
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG		STK	625	188	2	EUR 19,920	12.450,00	0,03
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	968	303	55	EUR 70,040	67.798,72	0,14
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA		STK	2.006	605	9	EUR 43,995	88.253,97	0,18
DE0005790430	FUCHS PETROLUB SE		STK	339	102	1	EUR 41,020	13.905,78	0,03
DE0006602006	GEA Group AG		STK	723	219	3	EUR 34,160	24.697,68	0,05
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG		STK	138	41	0	EUR 93,250	12.868,50	0,03
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	293	88	1	EUR 141,100	41.342,30	0,08
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	721	216	2	EUR 72,340	52.157,14	0,11
DE000A161408	HelloFresh SE		STK	848	365	1	EUR 81,980	69.519,04	0,14
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	869	262	4	EUR 89,040	77.375,76	0,16
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	6.369	2.087	7	EUR 33,820	215.399,58	0,44
DE000KGX8881	KION GROUP AG		STK	350	161	34	EUR 89,880	31.458,00	0,06
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	322	158	1	EUR 97,000	31.234,00	0,06
DE0005470405	LANXESS AG		STK	404	122	2	EUR 57,820	23.359,28	0,05
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	352	115	0	EUR 121,450	42.750,40	0,09
DE0006599905	Merck KGaA		STK	630	190	3	EUR 161,700	101.871,00	0,21
DE0006632003	MorphoSys AG		STK	160	49	2	EUR 65,420	10.467,20	0,02
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG		STK	260	80	2	EUR 208,900	54.314,00	0,11
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	683	207	4	EUR 230,950	157.738,85	0,32
DE0006452907	Nemetschek SE		STK	273	101	16	EUR 64,520	17.613,96	0,04
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	747	226	4	EUR 90,360	67.498,92	0,14
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE		STK	996	352	3	EUR 16,775	16.707,90	0,03
DE0006969603	PUMA SE		STK	453	171	6	EUR 100,550	45.549,15	0,09
DE0007010803	RATIONAL AG		STK	25	8	0	EUR 764,000	19.100,00	0,04
DE0007030009	Rheinmetall AG		STK	212	64	1	EUR 83,300	17.659,60	0,04
DE0007037129	RWE AG		STK	3.298	1.194	4	EUR 30,560	100.786,88	0,21
DE0007164600	SAP SE		STK	5.327	1.608	33	EUR 118,840	633.060,68	1,29
DE0007165631	Sartorius AG		STK	120	45	42	EUR 439,000	52.680,00	0,11
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	414	91	46	EUR 71,120	29.443,68	0,06
DE0007236101	Siemens AG		STK	3.648	1.100	18	EUR 133,620	487.445,76	1,00
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	2.300	2.303	3	EUR 25,420	58.466,00	0,12
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	1.356	844	2	EUR 51,680	70.078,08	0,14
DE000SYM9999	Symrise AG		STK	593	186	33	EUR 117,500	69.677,50	0,14
DE0008303504	TAG Immobilien AG		STK	714	216	4	EUR 26,760	19.106,64	0,04
DE000A2YN900	TeamViewer AG		STK	785	370	3	EUR 31,720	24.900,20	0,05
DE0007500001	thyssenkrupp AG		STK	2.401	1.015	9	EUR 8,790	21.104,79	0,04
DE000TUA0000	TUI AG		STK	3.696	4.400	2.117	GBP 3,695	15.908,58	0,03
DE000UNSE018	Uniper SE		STK	446	155	91	EUR 31,060	13.852,76	0,03
DE0005089031	United Internet AG		STK	495	161	48	EUR 34,480	17.067,60	0,03
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	893	270	5	EUR 211,200	188.601,60	0,39
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	2.632	895	0	EUR 54,520	143.496,64	0,29
DE000ZAL1111	Zalando SE		STK	883	537	209	EUR 101,950	90.021,85	0,18
							EUR	6.555.661,10	13,39
Ausland									
GB00B1YW4409	3i Group PLC		STK	4.746	1.433	23	GBP 11,730	64.850,11	0,13
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S		STK	30	9	0	DKK 18.025,000	72.718,10	0,15
IT0001233417	A2A S.p.A.		STK	7.639	2.305	37	EUR 1,724	13.169,64	0,03
SE0011337708	AAK AB		STK	866	269	3	SEK 191,800	16.377,32	0,03
NL0000852564	Aalberts N.V.		STK	468	141	2	EUR 45,320	21.209,76	0,04
NL00150008U6	Aalberts N.V. - Anrechte		STK	420	420	0	EUR 0,000	0,00	0,00
SE0005127818	AB Sagax		STK	808	808	0	SEK 254,200	20.251,78	0,04

CH0012221716	ABB Ltd.	STK	8.578	3.162	703	CHF	31,390	245.633,48	0,50
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V.	STK	2.297	692	10	EUR	10,192	23.411,02	0,05
ES0125220311	Acciona S.A.	STK	120	46	0	EUR	127,300	15.276,00	0,03
FR0000120404	ACCOR S.A.	STK	806	273	130	EUR	31,490	25.380,94	0,05
BE0003764785	Ackermans & van Haaren N.V.	STK	109	34	2	EUR	142,400	15.521,60	0,03
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK	1.208	498	69	EUR	22,590	27.288,72	0,06
ES06670509J8	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA -								
	Anrechte	STK	1.208	1.208	0	EUR	1,180	1.425,44	0,00
SE0014781795	Addtech AB	STK	1.268	1.275	7	SEK	142,000	17.753,50	0,04
CH0012138605	Adecco Group AG	STK	796	239	3	CHF	62,860	45.645,47	0,09
NO0010844038	Adevinta ASA	STK	1.360	558	6	NOK	165,000	21.989,44	0,04
GB00B02J6398	Admiral Group PLC	STK	1.165	360	4	GBP	31,440	42.667,13	0,09
NL0012969182	Adyen N.V.	STK	137	47	0	EUR	2.060,500	282.288,50	0,58
BE0003851681	Aedifica S.A.	STK	161	69	1	EUR	111,300	17.919,30	0,04
BE6328934722	Aedifica S.A. - Anrechte	STK	162	162	0	EUR	0,000	0,00	0,00
NL0000303709	AEGON N.V.	STK	8.859	2.693	62	EUR	3,499	30.997,64	0,06
NL00150007X2	AEGON N.V. - Anrechte	STK	8.835	8.835	0	EUR	0,000	0,00	0,00
ES0105046009	Aena SME S.A.	STK	358	108	2	EUR	138,300	49.511,40	0,10
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.	STK	136	42	2	EUR	109,850	14.939,60	0,03
SE0005999836	AF Pöyry AB	STK	465	470	5	SEK	281,600	12.911,06	0,03
BE0974264930	AGEAS SA/NV	STK	882	303	18	EUR	46,800	41.277,60	0,08
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK	5.100	1.665	339	EUR	25,070	127.857,00	0,26
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét. Expl.P.G.CI.	STK	2.310	698	11	EUR	147,660	341.094,60	0,70
NL0000235190	Airbus SE	STK	2.839	861	10	EUR	108,440	307.861,16	0,63
NO0010345853	Aker BP ASA	STK	527	159	2	NOK	274,400	14.170,53	0,03
NL0013267909	Akzo Nobel N.V.	STK	929	283	16	EUR	104,200	96.801,80	0,20
CH0432492467	Alcon AG	STK	2.437	762	11	CHF	64,780	144.014,65	0,29
SE0000695876	Alfa Laval AB	STK	1.450	437	7	SEK	302,300	43.219,78	0,09
LU2237380790	Allegro.eu	STK	1.882	1.882	0	PLN	65,200	27.354,08	0,06
GB00BNTJ3546	Allfunds Group Ltd.	STK	1.690	1.690	0	EUR	14,678	24.805,82	0,05
CH0008837566	Allreal Holdings AG	STK	71	22	0	CHF	182,200	11.800,95	0,02
FR0010220475	Alstom S.A.	STK	1.496	836	0	EUR	42,590	63.714,64	0,13
FR0000071946	Alten S.A.	STK	142	43	1	EUR	111,800	15.875,60	0,03
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK	2.197	663	11	EUR	59,320	130.326,04	0,27
DK0060946788	Ambu A/S	STK	907	335	3	DKK	241,100	29.406,99	0,06
IT0004056880	Amplifon S.p.A.	STK	638	214	3	EUR	41,640	26.566,32	0,05
AT0000A18XM4	ams AG	STK	1.338	450	5	CHF	18,560	22.653,97	0,05
FR0004125920	Amundi S.A.	STK	300	105	15	EUR	74,350	22.305,00	0,05
AT0000730007	Andritz AG	STK	347	105	2	EUR	47,380	16.440,86	0,03
GB00B1XZS820	Anglo American PLC	STK	6.192	1.989	7	GBP	28,725	207.193,43	0,42
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	STK	4.131	1.256	18	EUR	60,810	251.206,11	0,51
GB0000456144	Antofagasta PLC	STK	1.891	571	10	GBP	14,355	31.621,31	0,06
LU1598757687	ArcelorMittal S.A.	STK	3.461	1.044	18	EUR	25,850	89.466,85	0,18
NL0010832176	argenx SE	STK	250	103	0	EUR	255,100	63.775,00	0,13
FR0010313833	Arkema S.A.	STK	321	102	24	EUR	105,800	33.961,80	0,07
LU1673108939	Aroundtown SA	STK	4.759	1.668	1.043	EUR	6,580	31.314,22	0,06
GB00B132NW22	Ashmore Group PLC	STK	2.398	862	28	GBP	3,250	10.754,62	0,02
GB0000536739	Ashtead Group PLC	STK	2.201	673	29	GBP	53,640	137.528,85	0,28
NL0000334118	ASM International N.V.	STK	230	71	8	EUR	277,000	63.710,00	0,13
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	2.046	623	36	EUR	579,400	1.185.452,40	2,42
NL0011872643	ASR Nederland N.V.	STK	688	208	3	EUR	32,590	22.421,92	0,05
SE0007100581	Assa-Abloj AB	STK	4.834	1.458	22	SEK	257,800	122.875,69	0,25
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK	6.280	1.898	51	EUR	16,905	106.163,40	0,22
GB0006731235	Associated British Foods PLC	STK	1.756	530	9	GBP	22,160	45.329,33	0,09
GB00BVGBWW93	Assura PLC	STK	13.048	3.965	37	GBP	0,741	11.255,22	0,02
GB0009895292	AstraZeneca PLC	STK	6.402	1.934	31	GBP	86,830	647.545,76	1,32
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	STK	2.253	747	234	EUR	15,270	34.403,31	0,07
SE0011166610	Atlas Copco AB	STK	3.143	948	15	SEK	524,000	162.387,30	0,33
FR0000051732	Atos SE	STK	536	205	1	EUR	51,300	27.496,80	0,06
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC	STK	4.726	1.426	22	GBP	6,334	34.870,38	0,07
SE0012454072	Avanza Bank Holding AB	STK	603	603	0	SEK	266,900	15.868,73	0,03
GB00BDD85M81	Avast Plc.	STK	3.280	999	1	GBP	4,898	18.714,47	0,04
GB00BBG9VN75	AVEVA Group PLC	STK	608	403	16	GBP	37,080	26.262,03	0,05
GB0002162385	Aviva PLC	STK	19.163	5.785	88	GBP	4,059	90.608,21	0,19
FR0000120628	AXA S.A.	STK	10.034	3.046	104	EUR	21,385	214.577,09	0,44
LU1072616219	B & M Europ.Value Retail S.A.	STK	4.345	1.448	20	GBP	5,732	29.012,22	0,06
GB0002634946	BAE Systems PLC	STK	15.742	4.767	48	GBP	5,220	95.722,80	0,20
FO0000000179	Bakkafrost P/F	STK	243	73	1	NOK	711,000	16.930,40	0,03
CH0012410517	Bâloise Holding AG	STK	238	80	1	CHF	144,300	31.329,50	0,06
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK	32.519	9.811	153	EUR	5,228	170.009,33	0,35
IT0005218380	Banco BPM S.p.A.	STK	7.389	2.230	36	EUR	2,713	20.046,36	0,04
ES0113860A34	Banco de Sabadell S.A.	STK	27.442	8.280	130	EUR	0,574	15.757,20	0,03
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK	84.569	27.981	388	EUR	3,220	272.269,90	0,56
IE00BD1RP616	Bank of Ireland Group PLC	STK	4.527	1.371	41	EUR	4,517	20.448,46	0,04
PLPEKAO00016	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	STK	860	259	4	PLN	93,000	17.715,27	0,04
ES0113679137	Bankinter S.A.	STK	3.135	949	28	EUR	4,239	13.289,27	0,03
GB0031348658	Barclays PLC	STK	77.911	24.091	2.133	GBP	1,711	155.304,68	0,32
GB0000811801	Barratt Developments PLC	STK	4.966	1.499	24	GBP	6,952	40.216,24	0,08
CH0009002962	Barry Callebaut AG	STK	17	7	0	CHF	2.150,000	33.342,46	0,07
AT0000BAWAG2	BAWAG Group AG	STK	340	130	0	EUR	44,880	15.259,20	0,03
NL0012866412	BE Semiconductor Inds N.V.	STK	352	106	1	EUR	71,540	25.182,08	0,05
SE0015949748	Beijer Ref AB	STK	1.205	1.205	0	SEK	152,500	18.118,96	0,04
CH1101098163	BELIMO Holding AG	STK	48	48	0	CHF	423,000	18.522,17	0,04

GB0000904986	Bellway PLC	STK	602	181	2	GBP	32,400	22.720,95	0,05
GB00B02L3W35	Berkeley Group Holdings PLC	STK	593	184	22	GBP	45,950	31.741,34	0,06
GB00BH0P3Z91	BHP Group PLC	STK	10.300	3.572	513	GBP	21,300	255.565,26	0,52
SE0000862997	BillerudKorsnäs AB	STK	894	288	1	SEK	169,850	14.971,99	0,03
FR0013280286	bioMerieux	STK	237	72	2	EUR	98,000	23.226,00	0,05
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK	5.624	1.697	27	EUR	52,870	297.340,88	0,61
SE0015811559	Boliden AB	STK	1.334	1.335	1	SEK	329,000	43.274,11	0,09
FR0000039299	Bolloré S.A.	STK	4.381	1.335	48	EUR	4,520	19.802,12	0,04
FR0000120503	Bouygues S.A.	STK	1.441	443	28	EUR	31,190	44.944,79	0,09
GB0007980591	BP PLC	STK	98.699	30.223	984	GBP	3,150	362.166,52	0,74
GB0002875804	British American Tobacco PLC	STK	10.454	3.312	724	GBP	28,000	340.977,34	0,70
GB0001367019	British Land Co. PLC, The	STK	4.209	1.296	136	GBP	4,949	24.265,06	0,05
GB00B0N8QD54	Britvic PLC	STK	1.303	394	6	GBP	9,370	14.222,27	0,03
GB0030913577	BT Group PLC	STK	42.780	12.908	203	GBP	1,940	96.677,97	0,20
CH0002432174	Bucher Industries AG	STK	32	32	0	CHF	483,800	14.122,97	0,03
GB00B0744B38	Bunzl PLC	STK	1.644	496	7	GBP	23,890	45.751,25	0,09
GB0031743007	Burberry Group PLC	STK	1.975	596	9	GBP	20,660	47.531,60	0,10
FR0006174348	Bureau Veritas SA	STK	1.422	429	5	EUR	26,680	37.938,96	0,08
ES0140690919	Caixabank S.A.	STK	21.153	9.149	301	EUR	2,594	54.870,88	0,11
FR0000125338	Capgemini SE	STK	823	249	7	EUR	162,000	133.926,00	0,27
DK0010181759	Carlsberg AS	STK	493	156	15	DKK	1.169,000	77.501,03	0,16
GB0031215220	Carnival PLC	STK	772	237	3	GBP	16,608	14.935,50	0,03
FR0000120172	Carrefour S.A.	STK	2.965	1.006	15	EUR	16,585	49.174,53	0,10
SE0000379190	Castellum AB	STK	1.111	378	86	SEK	217,800	23.858,79	0,05
PLOP0000011	CD Projekt S.A.	STK	344	116	3	PLN	185,020	14.097,54	0,03
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A.	STK	2.798	1.938	0	EUR	53,720	150.308,56	0,31
CH0225173167	Cembra Money Bank AG	STK	146	44	1	CHF	103,700	13.811,53	0,03
GB00B033F229	Centrica PLC	STK	28.678	8.758	101	GBP	0,515	17.191,10	0,04
CH0010570759	Chocoladef. Lindt & Sprüngli	STK	1	1	0	CHF	96,900	88.396,28	0,18
FR0000130403	Christian Dior SE	STK	22	27	20	EUR	679,000	14.938,00	0,03
DK0060227585	Christian Hansen Holding AS	STK	502	151	2	DKK	566,000	38.209,04	0,08
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	STK	2.546	768	12	CHF	111,950	260.011,59	0,53
FR0000121261	Cie Génle Étis Michelin SCpA	STK	826	264	50	EUR	134,500	111.097,00	0,23
CH0012142631	Clariant AG	STK	1.097	353	102	CHF	18,400	18.413,43	0,04
GB0007668071	Close Brothers Group PLC	STK	742	223	2	GBP	15,150	13.094,88	0,03
NL0010545661	CNH Industrial N.V.	STK	4.865	1.468	23	EUR	13,925	67.745,13	0,14
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG	STK	981	296	5	GBP	26,140	29.871,68	0,06
BE0003593044	Cofinimmo S.A.	STK	134	45	0	EUR	128,400	17.205,60	0,04
DK0060448595	Coloplast AS	STK	581	176	3	DKK	1.029,000	80.396,57	0,16
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.	STK	2.598	796	65	EUR	55,540	144.292,92	0,29
GB00BD6K4575	Compass Group PLC	STK	8.707	3.268	11	GBP	15,220	154.371,88	0,32
GB00BD3VFW73	ConvaTec Group PLC	STK	7.893	2.413	12	GBP	2,406	22.121,92	0,05
NL0010583399	Corbion N.V.	STK	246	284	38	EUR	48,200	11.857,20	0,02
GB00BYPHNG03	Countryside Properties PLC	STK	2.319	2.537	218	GBP	4,726	12.766,72	0,03
FR0000064578	Covivio S.A.	STK	229	103	55	EUR	72,120	16.515,48	0,03
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.	STK	6.360	2.027	29	EUR	11,814	75.137,04	0,15
CH0012138530	Credit Suisse Group AG	STK	11.790	3.999	516	CHF	9,692	104.240,72	0,21
IE0001827041	CRH PLC	STK	3.878	1.174	38	EUR	42,500	164.815,00	0,34
GB00BJFFLV09	Croda International PLC	STK	695	247	4	GBP	73,680	59.651,23	0,12
FR0000120644	Danone S.A.	STK	3.169	955	11	EUR	59,370	188.143,53	0,38
DK0010274414	Danske Bank AS	STK	3.309	1.009	50	DKK	110,350	49.103,80	0,10
FR0000121725	Dassault Aviation S.A.	STK	11	3	0	EUR	992,000	10.912,00	0,02
FR0000130650	Dassault Systemes SE	STK	694	213	0	EUR	204,500	141.923,00	0,29
NL0015435975	Davide Campari-Milano N.V.	STK	2.268	2.433	165	EUR	11,295	25.617,06	0,05
IE0002424939	DCC PLC	STK	494	149	2	GBP	59,180	34.055,47	0,07
GB0009633180	Dechra Pharmaceuticals PLC	STK	528	175	0	GBP	43,700	26.878,21	0,05
GB00BNC5T391	Deliveroo PLC	STK	5.416	5.416	0	GBP	2,884	18.195,28	0,04
DK0060738599	Demant AS	STK	492	221	14	DKK	353,000	23.355,32	0,05
GB0002652740	Derwent London PLC	STK	498	153	12	GBP	33,200	19.259,83	0,04
GB0002374006	Diageo PLC	STK	11.406	3.450	58	GBP	34,610	459.853,99	0,94
GB0059822006	Dialog Semiconductor PLC	STK	348	116	3	EUR	65,560	22.814,88	0,05
IT0003492391	Diasorin S.p.A.	STK	127	38	1	EUR	159,500	20.256,50	0,04
PLDINPL00011	Dino Polska S.A.	STK	234	234	0	PLN	279,900	14.507,25	0,03
GB0001826634	Diploma PLC	STK	607	222	3	GBP	29,400	20.533,85	0,04
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC	STK	6.588	2.311	401	GBP	2,850	21.871,75	0,04
NO0010031479	DNB ASA	STK	4.356	1.334	108	NOK	187,600	80.077,77	0,16
SE0007691613	Dometic Group AB	STK	1.443	435	6	SEK	145,750	20.737,26	0,04
GB00BL6NGV24	Dr. Martens PLC	STK	2.784	2.784	0	GBP	4,450	14.431,59	0,03
GB0008220112	DS Smith PLC	STK	6.697	2.262	28	GBP	4,179	32.601,50	0,07
DK0060079531	DSV Panalpina A/S	STK	972	304	34	DKK	1.462,500	191.164,90	0,39
CH0023405456	Dufry AG	STK	376	376	0	CHF	54,800	18.796,57	0,04
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC	STK	1.114	1.307	874	GBP	8,948	11.611,71	0,02
FR0010908533	Edenred S.A.	STK	1.203	370	1	EUR	48,050	57.804,15	0,12
PTEDP0AM0009	EDP - Energias de Portugal SA	STK	14.267	5.410	87	EUR	4,470	63.773,49	0,13
ES0127797019	EDP Renováveis S.A.	STK	1.172	1.172	0	EUR	19,540	22.900,88	0,05
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	489	157	9	EUR	85,800	41.956,20	0,09
FR0010242511	Electricité de France (E.D.F.)	STK	2.469	748	26	EUR	11,520	28.442,88	0,06
GB0003096442	Electrocomponents PLC	STK	2.292	768	6	GBP	10,290	27.473,56	0,06
SE0000103814	Electrolux, AB	STK	1.123	339	6	SEK	237,300	26.275,68	0,05
SE0000163628	Elektro AB	STK	1.798	542	8	SEK	124,000	21.983,04	0,04
BE0003822393	Elia Group	STK	161	49	1	EUR	89,000	14.329,00	0,03
FR0012435121	Elis S.A.	STK	885	272	0	EUR	15,890	14.062,65	0,03
FI0009007884	Elisa Oyj	STK	734	222	4	EUR	50,320	36.934,88	0,08

CH0016440353	Ems-Chemie Holding AG	STK	33	11	5	CHF	909,000	27.364,53	0,06
ES0130960018	Enagas S.A.	STK	1.150	347	5	EUR	19,485	22.407,75	0,05
ES0130670112	Endesa S.A.	STK	1.544	466	7	EUR	20,460	31.590,24	0,06
IT0003128367	ENEL S.p.A.	STK	37.886	11.431	179	EUR	7,832	296.723,15	0,61
FR0010208488	Engie S.A.	STK	9.069	2.736	43	EUR	11,554	104.783,23	0,21
IT0003132476	ENI S.p.A.	STK	12.251	3.724	182	EUR	10,270	125.817,77	0,26
IM00B5VQMV65	Entain PLC	STK	2.855	866	9	GBP	17,455	58.051,17	0,12
NO0010716418	Entra ASA	STK	799	244	18	NOK	196,800	15.408,60	0,03
SE0015658109	Epiroc AB	STK	3.067	3.071	4	SEK	195,000	58.969,14	0,12
SE0012853455	EQT AB	STK	3.082	931	19	SEK	310,600	94.386,63	0,19
NO0010096985	Equinor ASA	STK	5.243	1.847	381	NOK	182,180	93.599,13	0,19
AT0000652011	Erste Group Bank AG	STK	1.440	435	12	EUR	30,940	44.553,60	0,09
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK	1.454	442	5	EUR	155,640	226.300,56	0,46
FR0014002ZS9	EssilorLuxottica S.A. - Anrechte	STK	1.302	1.302	0	EUR	0,000	0,00	0,00
SE0009922164	Essity AB	STK	2.949	923	163	SEK	283,800	82.520,82	0,17
BE0974256852	Établissements Fr. Colruyt SA	STK	246	78	14	EUR	47,160	11.601,36	0,02
FR0000121121	Eurazeo SE	STK	227	73	12	EUR	73,500	16.684,50	0,03
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E.	STK	621	621	0	EUR	96,400	59.864,40	0,12
NL0006294274	Euronext N.V.	STK	375	191	0	EUR	91,700	34.387,50	0,07
SE0012673267	Evolution AB (publ)	STK	850	423	0	SEK	1.352,400	113.344,51	0,23
GB00B71N6K86	Evraz PLC	STK	2.840	858	15	GBP	5,920	19.585,07	0,04
NL0012059018	EXOR N.V.	STK	553	167	2	EUR	67,560	37.360,68	0,08
GB00B19NLV48	Experian PLC	STK	4.729	1.615	0	GBP	27,860	153.474,22	0,31
SE0011166974	Fabege AB	STK	1.365	413	10	SEK	137,300	18.479,05	0,04
SE0000455057	Fastighets AB Balder	STK	510	176	2	SEK	537,000	27.003,55	0,06
FR0000121147	Faurecia SE	STK	636	540	158	EUR	41,370	26.311,32	0,05
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC	STK	1.132	342	6	GBP	100,500	132.524,90	0,27
NL0011585146	Ferrari N.V.	STK	593	185	30	EUR	174,000	103.182,00	0,21
ES0118900010	Ferrovial S.A.	STK	2.559	834	82	EUR	24,750	63.335,25	0,13
IT0000072170	Fincobank Banca Fineco S.p.A.	STK	2.974	896	12	EUR	14,700	43.717,80	0,09
CH0001752309	Fischer AG, Georg	STK	20	6	0	CHF	1.373,000	25.050,17	0,05
CH0319416936	Flughafen Zürich AG	STK	92	27	0	CHF	153,000	12.840,72	0,03
ES0137650018	Fluidra S.A.	STK	473	473	0	EUR	33,450	15.821,85	0,03
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC	STK	818	362	0	EUR	152,700	124.908,60	0,26
FI0009007132	Fortum Oyj	STK	2.133	643	10	EUR	23,260	49.613,58	0,10
GB00BYZN9041	Future PLC	STK	554	554	0	GBP	31,320	20.212,34	0,04
BE0003818359	Galapagos N.V.	STK	214	66	0	EUR	58,480	12.514,72	0,03
CH0360674466	Galenica AG	STK	244	74	1	CHF	65,300	14.534,94	0,03
PTGAL0AM0009	Galp Energia SGPS S.A.	STK	2.393	722	12	EUR	9,152	21.900,74	0,04
GB0003718474	Games Workshop Group PLC	STK	160	49	1	GBP	114,000	21.247,60	0,04
CH0030170408	Geberit AG	STK	181	55	1	CHF	694,000	114.590,40	0,23
FR0010040865	Gecina S.A.	STK	231	70	1	EUR	129,200	29.845,20	0,06
DK0010272202	GENMAB AS	STK	320	97	1	DKK	2.566,000	110.421,25	0,23
GB0002074580	Genus PLC	STK	319	97	1	GBP	49,600	18.431,36	0,04
SE0000202624	Getinge AB	STK	1.062	319	4	SEK	322,800	33.801,38	0,07
FR0010533075	Getlink SE	STK	2.131	641	9	EUR	13,150	28.022,65	0,06
CH0010645932	Givaudan SA	STK	39	12	0	CHF	4.303,000	153.089,76	0,31
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA	STK	921	278	4	NOK	189,800	17.129,59	0,03
IE0000669501	Glanbia PLC	STK	966	297	26	EUR	13,690	13.224,54	0,03
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC	STK	24.539	7.451	113	GBP	14,194	405.738,91	0,83
JE00B4T3BW64	Glencore PLC	STK	53.117	16.033	258	GBP	3,095	191.473,66	0,39
DK0010272632	GN Store Nord AS	STK	632	193	2	DKK	547,800	46.557,01	0,10
IE00B00MZ448	Grafton Group PLC	STK	1.075	1.075	0	GBP	11,470	14.363,39	0,03
LU0775917882	Grand City Properties S.A.	STK	494	164	21	EUR	22,780	11.253,32	0,02
GB00B63QSB39	Greggs PLC	STK	495	593	445	GBP	25,950	14.963,31	0,03
ES0171996087	Grifols S.A.	STK	1.433	433	11	EUR	22,840	32.729,72	0,07
BE0003797140	Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL)	STK	474	154	47	EUR	94,340	44.717,16	0,09
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB	STK	3.646	1.117	96	SEK	203,000	72.977,52	0,15
GB0004052071	Halma PLC	STK	1.851	559	10	GBP	26,920	58.045,22	0,12
GB00B1VZ0M25	Hargreaves Lansdown PLC	STK	1.724	617	7	GBP	15,890	31.911,42	0,07
GB0004161021	Hays PLC	STK	8.204	2.475	38	GBP	1,586	15.157,02	0,03
NL0000008977	Heineken Holding N.V.	STK	493	174	1	EUR	84,950	41.880,35	0,09
NL0000009165	Heineken N.V.	STK	1.162	350	5	EUR	102,200	118.756,40	0,24
CH0466642201	Helvetia Holding AG	STK	170	59	1	CHF	99,500	15.430,58	0,03
IT0001250932	Hera S.p.A.	STK	3.922	1.291	373	EUR	3,484	13.664,25	0,03
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK	172	52	1	EUR	1.228,500	211.302,00	0,43
SE0015961909	Hexagon AB	STK	9.663	9.675	12	SEK	126,800	120.811,32	0,25
SE0007074281	Hexpol AB	STK	1.263	382	6	SEK	105,700	13.163,00	0,03
GB00B0LFCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC	STK	833	344	0	GBP	24,460	23.734,85	0,05
BMG4593F1389	Hiscox Ltd.	STK	1.726	521	8	GBP	8,316	16.720,16	0,03
CH0012214059	Holcim Ltd.	STK	2.760	1.031	9	CHF	55,500	139.737,27	0,29
SE0011090018	Holmen AB	STK	465	140	0	SEK	386,300	17.711,45	0,04
GB00BYTTFB60	Homeserve PLC	STK	1.440	433	2	GBP	9,555	16.027,96	0,03
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC	STK	2.940	888	15	GBP	8,166	27.966,73	0,06
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK	101.202	30.614	350	GBP	4,173	491.951,72	1,00
FI0009000459	Huhtamäki Oyj	STK	470	145	3	EUR	39,950	18.776,50	0,04
SE0001662230	Husqvarna AB	STK	2.025	611	8	SEK	113,700	22.701,88	0,05
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	28.581	9.761	1.410	EUR	10,280	293.812,68	0,60
SE0000652216	ICA Gruppen AB	STK	451	137	3	SEK	398,300	17.711,82	0,04
CH0363463438	Idorsia AG	STK	535	254	0	CHF	25,440	12.415,98	0,03
GB00B06QFB75	IG Group Holdings PLC	STK	1.806	544	5	GBP	8,470	17.819,12	0,04
NL0010801007	IMCD N.V.	STK	278	99	1	EUR	134,100	37.279,80	0,08
GB00BGLP8L22	IMI PLC	STK	1.316	422	88	GBP	17,200	26.367,52	0,05

GB0004544929	Imperial Brands PLC	STK	4.615	1.393	23	GBP	15,570	83.703,83	0,17
GB00B61TVQ02	Inchcape PLC	STK	1.792	566	122	GBP	7,685	16.042,31	0,03
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK	5.420	1.636	26	EUR	29,710	161.028,20	0,33
SE0000190126	Industrivärden AB	STK	841	254	4	SEK	332,800	27.596,61	0,06
SE0001515552	Indutrade AB	STK	1.303	1.000	1	SEK	219,000	28.136,17	0,06
GB00BMJ6DW54	Informa PLC	STK	7.331	2.614	63	GBP	5,016	42.835,69	0,09
IT0005090300	Infrastrutt. Wireless Italiane	STK	1.715	1.715	0	EUR	9,512	16.313,08	0,03
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK	19.032	5.740	81	EUR	11,140	212.016,48	0,43
ES0139140174	Inmobiliaria Colonial SOCIMI	STK	1.305	394	6	EUR	8,515	11.112,08	0,02
LU2290522684	InPost S.A.	STK	1.316	1.316	0	EUR	16,926	22.274,62	0,05
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group	STK	915	276	5	GBP	48,100	51.268,57	0,10
GB00BYT1DJ19	Intermediate Capital Grp PLC	STK	1.435	457	18	GBP	21,240	35.505,15	0,07
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA	STK	12.123	8.785	77	GBP	1,742	24.603,29	0,05
IT0001078911	Interpump Group S.p.A.	STK	402	125	9	EUR	49,940	20.075,88	0,04
GB0031638363	Intertek Group PLC	STK	787	237	3	GBP	55,300	50.697,30	0,10
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK	88.961	33.423	419	EUR	2,330	207.234,65	0,42
SE0015811963	Investor AB	STK	8.885	8.896	11	SEK	197,250	172.802,82	0,35
FR0010259150	Ipsen S.A.	STK	177	54	2	EUR	87,720	15.526,44	0,03
DK0060542181	ISS AS	STK	752	226	2	DKK	147,200	14.885,78	0,03
IT0005211237	Italgas S.P.A.	STK	2.387	865	2	EUR	5,512	13.157,14	0,03
GB0033986497	ITV PLC	STK	17.688	5.339	86	GBP	1,256	25.869,04	0,05
JE00BYVQYS01	IWG PLC	STK	3.757	1.625	3	GBP	3,006	13.155,73	0,03
GB00BYX91H57	JD Sports Fashion PLC	STK	2.420	930	12	GBP	9,190	25.906,93	0,05
NL0014332678	JDE Peet's N.V.	STK	539	539	0	EUR	30,600	16.493,40	0,03
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.	STK	1.193	360	5	EUR	15,380	18.348,34	0,04
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC	STK	970	307	1	GBP	30,730	34.723,16	0,07
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG	STK	1.092	330	5	CHF	60,380	60.148,66	0,12
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.V.	STK	878	493	72	EUR	77,870	68.369,86	0,14
BE0003565737	KBC Groep N.V.	STK	1.217	386	60	EUR	64,300	78.253,10	0,16
FR0000121485	Kering S.A.	STK	357	109	8	EUR	737,000	263.109,00	0,54
IE0004906560	Kerry Group PLC	STK	758	232	3	EUR	117,800	89.292,40	0,18
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	1.332	402	6	EUR	31,150	41.491,80	0,08
PLKGHM000017	KGHM Polska Miedz S.A.	STK	665	201	4	PLN	187,650	27.639,90	0,06
SE0007871645	Kindred Group PLC	STK	1.122	1.124	2	SEK	134,150	14.840,89	0,03
GB0033195214	Kingfisher PLC	STK	10.297	3.108	46	GBP	3,645	14.721,32	0,09
IE0004927939	Kingspan Group PLC	STK	763	230	2	EUR	79,640	60.765,32	0,12
SE0015810247	Kinnevik AB	STK	1.180	1.181	1	SEK	342,600	39.860,78	0,08
FR0000121964	Klépierre S.A.	STK	1.040	337	16	EUR	21,730	22.599,20	0,05
FI4000312251	Kojamo Oyj	STK	1.013	350	3	EUR	19,270	19.520,51	0,04
NL0000009082	Kon. KPN N.V.	STK	16.393	5.106	806	EUR	2,634	43.179,16	0,09
FI0009013403	KONE Oyj	STK	1.972	597	15	EUR	68,800	135.673,60	0,28
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.	STK	852	305	37	EUR	157,400	134.104,80	0,27
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK	4.443	1.406	38	EUR	41,790	185.672,97	0,38
NL0009432491	Koninklijke Vopak N.V.	STK	313	96	10	EUR	38,300	11.987,90	0,02
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG	STK	276	85	1	CHF	316,600	79.713,19	0,16
SE0000108847	L E Lundbergföretagen AB	STK	359	110	3	SEK	552,200	19.546,42	0,04
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX	STK	543	172	44	EUR	49,580	26.921,94	0,05
GB00BYW0PQ60	Land Securities Group PLC	STK	3.390	1.025	24	GBP	6,754	26.671,40	0,05
SE0010100958	Latour Investment AB	STK	710	251	3	SEK	280,800	19.657,66	0,04
GB0005603997	Legal & General Group PLC	STK	29.104	8.782	131	GBP	2,576	19.657,66	0,18
FR0010307819	Legrand S.A.	STK	1.304	395	6	EUR	89,260	116.395,04	0,24
IT0003856405	Leonardo S.p.A.	STK	1.968	593	9	EUR	6,812	13.406,02	0,03
SE0015949201	Lifco AB	STK	1.106	1.107	1	SEK	200,000	21.810,29	0,04
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	2.533	797	157	EUR	243,350	616.405,55	1,26
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK	346.078	104.525	0	GBP	0,467	188.227,41	0,38
CH0025751329	Logitech International S.A.	STK	844	254	4	CHF	112,100	86.309,43	0,18
GB00B0S0WJX34	London Stock Exchange Group PLC	STK	1.573	497	6	GBP	79,700	146.040,07	0,30
GB00B4WFW713	Londonmetric Property PLC	STK	4.437	4.442	5	GBP	2,314	11.960,18	0,02
CH0013841017	Lonza Group AG	STK	363	110	2	CHF	655,800	217.164,20	0,44
SE0000825820	Lundin Energy AB	STK	929	280	4	SEK	302,800	27.736,27	0,06
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK	1.293	390	8	EUR	661,300	855.060,90	1,75
GB00BKFB1C65	M&G PLC	STK	12.680	4.234	15	GBP	2,289	33.810,38	0,07
JE00B1DLW90	Man Group Ltd.	STK	7.048	2.591	829	GBP	1,800	14.774,16	0,03
GB0031274896	Marks & Spencer Group PLC	STK	9.542	2.886	30	GBP	1,465	16.278,48	0,03
IT0000062957	Mediobanca - Bea Cred.Fin. SpA	STK	3.201	1.073	25	EUR	9,850	17.529,85	0,06
GB0005758098	Meggitt PLC	STK	3.811	1.151	17	GBP	4,612	20.474,49	0,04
GB00BZ1G4322	Melrose Industries PLC	STK	22.445	6.772	106	GBP	1,551	40.552,39	0,08
ES0105025003	Merlin Properties SOCIMI S.A.	STK	1.637	522	137	EUR	8,736	14.300,83	0,03
FI0009014575	Metso Outotec Oyj	STK	3.440	5.888	2.448	EUR	9,796	33.698,24	0,07
SE0001174970	Millicom Intl Cellular S.A.	STK	496	496	0	SEK	338,800	16.569,20	0,03
IT0004965148	Moncler S.p.A.	STK	1.068	384	3	EUR	57,060	60.940,08	0,12
GB00B1CRLC47	Mondi PLC	STK	2.368	819	0	GBP	19,010	52.438,32	0,11
GB0006043169	Morrison Supermarkets PLC, Wm.	STK	11.752	3.548	42	GBP	2,467	33.772,71	0,07
NO0003054108	Mowi ASA	STK	2.202	675	15	NOK	219,000	47.255,53	0,10
GB00BDR05C01	National Grid PLC	STK	17.338	5.320	16	GBP	9,208	185.972,74	0,38
FR0000120685	Natixis S.A.	STK	4.539	1.371	16	EUR	4,000	18.156,00	0,04
ES0116870314	Naturgy Energy Group S.A.	STK	1.595	498	78	EUR	21,680	34.579,60	0,07
GB00B7T77214	NatWest Group PLC	STK	26.516	10.797	0	GBP	2,032	62.764,88	0,13
NO0010081235	NEL ASA - Anrechte	STK	7.107	7.116	9	NOK	20,080	13.984,32	0,03
FI0009013296	Neste Oyj	STK	2.093	632	9	EUR	51,640	108.082,52	0,22
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	14.050	4.331	484	CHF	115,220	1.476.775,22	3,02
DK0060952919	Netcompany Group A/S	STK	219	65	0	DKK	712,500	20.983,36	0,04
IT0005366767	Nexi S.p.A.	STK	2.450	1.429	3	EUR	18,510	45.349,50	0,09

GB0032089863	NEXT PLC	STK	648	195	3	GBP	78,560	59,300,93	0,12
SE0015988019	NIBE Industrier AB	STK	6.874	6.878	4	SEK	90,020	61.013,36	0,12
GB00B7FC0762	NMC HEALTH PLC	STK	261	0	0	GBP	0,000	0,00	0,00
NL0010773842	NN Group N.V.	STK	1.550	545	93	EUR	39,780	61.659,00	0,13
FI0009000681	Nokia Oyj	STK	26.212	8.242	1.415	EUR	4,516	118.360,29	0,24
FI0009005318	Nokia Renkaat Oyj	STK	618	190	17	EUR	34,050	21.042,90	0,04
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK	17.407	6.344	63	SEK	95,260	163.497,42	0,33
SE0012116390	Nordic Entertainment Group AB	STK	346	349	3	SEK	377,000	12.861,57	0,03
NO0003055501	Nordic Semiconductor ASA	STK	855	856	1	NOK	218,200	18.281,51	0,04
NO0005052605	Norsk Hydro ASA	STK	6.633	2.001	31	NOK	54,940	35.710,00	0,07
CH0012005267	Novartis AG	STK	12.032	3.630	56	CHF	84,320	925.504,69	1,89
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	8.077	2.512	208	DKK	525,400	570.671,48	1,17
DK0060336014	Novozymes A/S	STK	1.021	309	11	DKK	472,700	64.901,89	0,13
GB00B3MBS747	Ocado Group PLC	STK	3.102	1.047	11	GBP	20,030	72.387,19	0,15
AT0000743059	OMV AG	STK	696	210	3	EUR	47,970	33.387,12	0,07
FR0000133308	Orange S.A.	STK	9.996	3.253	45	EUR	9,615	96.111,54	0,20
FR0000120321	Oréal S.A., L'	STK	1.195	364	4	EUR	375,800	449.081,00	0,92
FI0009014377	Orion Corp.	STK	517	157	1	EUR	36,250	18.741,25	0,04
NO0003733800	Orkla ASA	STK	3.664	1.113	45	NOK	87,700	31.488,09	0,06
FR0000184798	Orpea	STK	254	76	0	EUR	107,250	27.241,50	0,06
DK0060094928	Orsted A/S	STK	920	310	4	DKK	880,000	108.872,08	0,22
DK0060252690	Pandora A/S	STK	488	147	2	DKK	843,000	55.321,43	0,11
CH0024608827	Partners Group Holding AG	STK	111	47	0	CHF	1.401,500	141.914,34	0,29
GB0006776081	Pearson PLC	STK	3.688	1.119	11	GBP	8,300	35.657,76	0,07
GB00B18V8630	Pennon Group PLC	STK	2.059	623	8	GBP	11,355	27.235,07	0,06
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	1.001	323	20	EUR	187,200	187.387,20	0,38
GB0006825383	Persimmon PLC	STK	1.556	471	8	GBP	29,580	53.615,80	0,11
GB00BGXQNP29	Phoenix Group Holdings PLC	STK	3.521	1.063	16	GBP	6,764	27.743,07	0,06
PLPKN0000018	Polski Koncern Naftowy Orlen	STK	1.512	457	8	PLN	76,780	25.713,80	0,05
JE00B6T5S470	Polymetal Intl PLC	STK	1.758	886	88	GBP	15,545	31.834,25	0,07
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.	STK	2.277	711	34	EUR	11,150	25.388,55	0,05
PLPKO0000016	Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski	STK	4.302	1.298	20	PLN	37,830	36.047,32	0,07
PLPZU0000011	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	STK	2.771	837	14	PLN	36,700	22.525,21	0,05
GB00BYRJ5J14	Primary Health Properties PLC	STK	6.487	2.313	0	GBP	1,539	11.629,67	0,02
NL0013654783	Prosus N.V.	STK	2.169	656	19	EUR	82,470	178.877,43	0,37
BE0003810273	Proximus S.A.	STK	766	231	4	EUR	16,290	12.478,14	0,03
GB0007099541	Prudential PLC	STK	12.756	3.857	46	GBP	13,735	204.093,03	0,42
IT0004176001	Prysmian S.p.A.	STK	1.308	396	6	EUR	30,230	39.540,84	0,08
CH0018294154	PSP Swiss Property AG	STK	224	81	0	CHF	117,500	24.010,22	0,05
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK	1.129	365	4	EUR	53,940	60.898,26	0,12
FR0014003307	Publicis Groupe S.A. - Anrechte	STK	1.128	1.128	0	EUR	0,000	0,00	0,00
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	1.126	340	5	EUR	40,760	45.895,76	0,09
GB00BDCXV269	Quilter PLC	STK	7.601	2.780	965	GBP	1,488	13.170,82	0,03
AT0000606306	Raiffeisen Bank Intl AG	STK	661	200	4	EUR	19,100	12.625,10	0,03
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	609	186	3	EUR	64,500	39.280,50	0,08
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	3.592	1.083	16	GBP	63,970	267.668,75	0,55
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA	STK	491	148	3	EUR	48,200	23.666,20	0,05
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	2.111	638	11	EUR	15,655	33.047,71	0,07
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	9.672	4.667	41	GBP	19,190	216.210,24	0,44
FR0000130395	Rémy Cointreau S.A.	STK	105	32	0	EUR	174,100	18.280,50	0,04
FR0000131906	Renault S.A.	STK	1.009	305	6	EUR	34,085	34.391,77	0,07
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC	STK	9.068	2.760	32	GBP	4,950	52.287,96	0,11
IT0005282865	Reply S.p.A.	STK	110	110	0	EUR	138,600	15.246,00	0,03
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	6.866	3.010	818	EUR	10,554	72.463,76	0,15
FR0010451203	Rexel S.A.	STK	1.191	362	4	EUR	17,640	21.009,24	0,04
GB00BGDT3G23	Rightmove PLC	STK	4.267	1.304	76	GBP	6,494	32.278,99	0,07
GB0007188757	Rio Tinto PLC	STK	5.234	1.581	26	GBP	59,490	362.712,63	0,74
DK0010219153	Rockwool International A/S	STK	42	13	2	DKK	3.053,000	17.243,37	0,04
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC	STK	40.808	34.270	82	GBP	0,989	47.023,44	0,10
GB00BVFNZH21	Rotork PLC	STK	4.263	1.291	20	GBP	3,404	16.904,01	0,03
GB00B03MLX29	Royal Dutch Shell	STK	20.001	6.054	182	EUR	17,004	340.097,00	0,69
GB00BDVZYZ77	Royal Mail PLC	STK	4.116	1.332	400	GBP	5,774	27.684,52	0,06
DK0060634707	Royal Unibrew AS	STK	205	61	0	DKK	798,800	22.021,05	0,04
FR0013269123	Rubis S.C.A.	STK	479	154	1	EUR	37,490	17.957,71	0,04
FR0014003EX2	Rubis S.C.A. - Anrechte	STK	480	480	0	EUR	0,000	0,00	0,00
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings PLC	STK	2.751	894	10	EUR	15,960	43.905,96	0,09
GB00BFZM640	S4 Capital PLC	STK	2.239	2.239	0	GBP	6,280	16.379,43	0,03
FR0000073272	SAFRAN	STK	1.850	652	21	EUR	116,920	216.302,00	0,44
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The	STK	5.466	1.648	25	GBP	6,842	43.565,00	0,09
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.	STK	8.184	2.566	337	GBP	2,718	25.911,95	0,05
NO0010310956	Salmar ASA	STK	263	79	1	NOK	571,200	14.720,93	0,03
SE0009554454	Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB	STK	5.170	1.858	22	SEK	35,860	18.280,04	0,04
FI0009003305	Sampo OYJ	STK	2.487	751	12	EUR	38,760	96.396,12	0,20
SE0000667891	Sandvik AB	STK	5.339	1.613	35	SEK	218,600	115.076,45	0,24
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	5.572	1.678	7	EUR	88,360	492.341,92	1,01
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.	STK	118	37	0	EUR	398,900	47.070,20	0,10
NO0010715139	Scatec ASA	STK	578	579	1	NOK	228,000	12.913,80	0,03
NO0003028904	Schibsted ASA	STK	370	116	18	NOK	415,600	15.068,45	0,03
CH0024638196	Schindler Holding AG	STK	199	60	1	CHF	283,000	51.374,75	0,10
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	2.766	890	13	EUR	132,680	366.992,88	0,75
GB0002405495	Schroders PLC	STK	627	189	3	GBP	35,130	25.658,47	0,05
FR0010411983	SCOR SE	STK	835	252	3	EUR	26,820	22.394,70	0,05
FR0000121709	SEB S.A.	STK	158	75	0	EUR	152,400	24.079,20	0,05

SE0000163594	Securitas AB	STK	1.564	472	8	SEK	135,100	20.833,80	0,04
GB00B5ZN1N88	Segro PLC	STK	5.853	2.055	0	GBP	10,945	74.624,14	0,15
LU0088087324	SES S.A.	STK	1.870	563	8	EUR	6,442	12.046,54	0,02
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC	STK	1.235	409	2	GBP	25,010	35.980,37	0,07
CH0002497458	SGS S.A.	STK	30	9	1	CHF	2.854,000	78.106,19	0,16
CH0014284498	Siegfried Holding AG	STK	21	21	0	CHF	867,500	16.618,77	0,03
ES0143416115	Siemens Gamesa Renew. En. S.A.	STK	1.094	330	5	EUR	28,160	30.807,04	0,06
CH0435377954	SIG Combibloc Services AG	STK	1.561	771	77	CHF	25,140	35.799,62	0,07
NL0011821392	Signify N.V.	STK	626	189	3	EUR	53,340	33.390,84	0,07
CH0418792922	Sika AG	STK	655	255	34	CHF	302,500	180.749,41	0,37
DK0060495240	SimCorp A/S	STK	198	60	1	DKK	787,200	20.960,24	0,04
SE0016101844	Sinch AB	STK	4.707	4.707	0	SEK	144,000	66.831,79	0,14
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	7.819	2.359	37	SEK	110,550	85.228,80	0,17
SE0000113250	Skanska AB	STK	1.952	589	9	SEK	227,000	43.690,00	0,09
SE0000108227	SKF AB	STK	1.845	560	8	SEK	217,900	39.639,67	0,08
GB0009223206	Smith & Nephew PLC	STK	4.316	1.303	20	GBP	15,625	78.557,28	0,16
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC	STK	1.933	583	8	GBP	15,900	35.802,55	0,07
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC	STK	1.194	437	4	EUR	45,750	54.625,50	0,11
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	10.029	3.347	486	EUR	4,875	48.891,38	0,10
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	4.146	1.241	21	EUR	24,860	103.069,56	0,21
FR0000121220	Sodexo S.A.	STK	412	125	5	EUR	78,700	32.424,40	0,07
BE0003470755	Sofina S.A.	STK	76	23	0	EUR	363,800	27.648,80	0,06
GB00BYZDVK82	Softcat PLC	STK	654	654	0	GBP	17,760	13.530,25	0,03
FR0013227113	Soitec S.A.	STK	112	112	0	EUR	185,900	20.820,80	0,04
BE0003470755	Solvay S.A.	STK	358	107	1	EUR	107,200	38.377,60	0,08
CH0012549785	Sonova Holding AG	STK	263	79	3	CHF	348,000	83.492,06	0,17
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A.	STK	78	23	0	EUR	162,200	12.651,60	0,03
GB0003308607	Spectris PLC	STK	584	179	10	GBP	32,380	22.027,98	0,04
FR0012757854	Spie S.A.	STK	740	336	43	EUR	19,400	14.356,00	0,03
GB00BWFQGN14	Spirax-Sarco Engineering PLC	STK	359	109	2	GBP	136,150	56.937,33	0,12
GB0007908733	SSE PLC	STK	5.117	1.549	19	GBP	15,005	89.440,96	0,18
GB0007669376	St. James's Place PLC	STK	2.630	799	9	GBP	14,770	45.250,28	0,09
CH0002178181	Stadler Rail AG	STK	285	286	1	CHF	40,680	10.576,35	0,02
GB0004082847	Standard Chartered PLC	STK	12.721	3.894	244	GBP	4,610	68.313,60	0,14
GB00BF8Q6K64	Standard Life Aberdeen PLC	STK	10.635	3.307	494	GBP	2,710	33.573,13	0,07
NL00150001Q9	Stellantis N.V.	STK	10.135	10.216	81	EUR	16,554	167.774,79	0,34
NL0000226223	STMicroelectronics N.V.	STK	3.222	972	15	EUR	30,605	98.609,31	0,20
FI0009005961	Stora Enso Oyj	STK	2.986	901	15	EUR	15,385	45.939,61	0,09
NO0003053605	Storebrand ASA	STK	2.281	688	11	NOK	78,000	17.434,57	0,04
CH0012280076	Straumann Holding AG	STK	56	17	0	CHF	1.475,000	75.351,21	0,15
FR0010613471	Suez S.A.	STK	2.030	693	7	EUR	20,050	40.701,50	0,08
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB	STK	2.716	820	13	SEK	140,250	37.558,57	0,08
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB	STK	7.468	2.262	69	SEK	96,560	71.101,37	0,15
CH0012255151	Swatch Group AG, The	STK	141	42	0	CHF	317,400	40.825,94	0,08
SE0014960373	Sweco AB	STK	1.008	1.031	23	SEK	155,700	15.474,82	0,03
SE0000242455	Swedbank AB	STK	4.512	1.602	269	SEK	159,240	70.843,12	0,14
SE0015812219	Swedish Match AB	STK	7.706	7.920	214	SEK	72,980	55.450,90	0,11
SE0000872095	Swedish Orphan Biovitrum AB	STK	957	302	5	SEK	156,050	14.724,89	0,03
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	156	47	0	CHF	449,600	63.982,48	0,13
CH0008038389	Swiss Prime Site AG	STK	371	112	1	CHF	91,800	31.068,97	0,06
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	1.409	425	7	CHF	83,480	107.300,97	0,22
CH0008742519	Swisscom AG	STK	124	38	1	CHF	528,200	59.748,95	0,12
GB0008754136	Tate & Lyle PLC	STK	2.285	689	10	GBP	7,384	19.654,54	0,04
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC	STK	17.781	6.541	19	GBP	1,590	32.923,18	0,07
CH0012100191	Tecan Group AG	STK	47	15	4	CHF	458,400	19.654,08	0,04
GB00BDSFG982	TechnipFMC PLC	STK	2.070	644	91	EUR	7,560	15.657,48	0,03
SE0005190238	Tele2 AB	STK	2.443	735	3	SEK	116,600	28.086,55	0,06
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A.	STK	49.671	15.413	233	EUR	0,419	20.807,18	0,04
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics.	STK	14.984	4.521	71	SEK	107,560	158.911,36	0,32
ES0178430E18	Telefónica S.A.	STK	26.548	13.601	2.375	EUR	3,941	104.625,67	0,20
NO0010063308	Telenor ASA	STK	3.142	1.068	202	NOK	145,100	44.675,03	0,09
FR0000051807	Téléperformance SE	STK	286	87	2	EUR	342,300	97.897,80	0,20
SE0000667925	Telia Company AB	STK	12.067	3.641	57	SEK	37,980	45.188,79	0,09
CH0012453913	Temenos AG	STK	325	99	0	CHF	148,600	44.056,74	0,09
LU0156801721	Tenaris S.A.	STK	2.277	687	11	EUR	9,192	20.930,18	0,04
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA	STK	6.876	2.075	33	EUR	6,284	43.208,78	0,09
GB00BLGZ9862	Tesco PLC	STK	37.707	37.752	45	GBP	2,230	97.929,71	0,20
FR0000121329	THALES S.A.	STK	517	157	3	EUR	86,040	44.482,68	0,09
GB00BMTV7393	THG PLC - Anrechte	STK	4.169	4.169	0	GBP	6,100	29.624,21	0,06
SE0006422390	Thule Group AB (publ)	STK	510	157	1	SEK	379,400	19.078,49	0,04
NO0005668905	Tomra Systems ASA	STK	570	196	0	NOK	475,000	26.531,37	0,05
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	12.826	4.022	117	EUR	38,155	489.376,03	1,00
GB00BK9RKT01	Travis Perkins PLC	STK	1.097	1.099	2	GBP	16,890	21.583,47	0,04
SE0000114837	Trelleborg AB	STK	1.183	356	5	SEK	198,700	23.177,10	0,05
GB00BG49KP99	Tritax Big Box REIT PLC	STK	8.388	2.572	36	GBP	1,963	19.180,66	0,04
DK0060636678	Tryg AS	STK	1.759	1.347	2	DKK	153,950	36.415,94	0,07
FR0000054470	Ubisoft Entertainment S.A.	STK	505	157	0	EUR	59,040	29.815,20	0,06
CH0244767585	UBS Group AG	STK	16.976	5.292	582	CHF	14,160	219.284,95	0,45
BE0003739530	UCB S.A.	STK	617	187	3	EUR	88,160	54.394,72	0,11
IE0033024807	UDG Healthcare PLC	STK	1.265	384	5	GBP	10,690	15.752,64	0,03
BE0974320526	Umicore S.A.	STK	988	299	8	EUR	51,500	50.882,00	0,10
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE	STK	571	234	137	EUR	72,990	41.677,29	0,09
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	10.942	3.309	38	EUR	9,950	108.872,90	0,22

GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	12.823	8.852	35	GBP	42,305	631.926,17	1,29
GB0006928617	Unite Group PLC	STK	1.592	594	0	GBP	10,740	19.917,39	0,04
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC	STK	3.326	1.003	15	GBP	9,744	37.752,39	0,08
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.	STK	2.603	785	12	EUR	31,900	83.035,70	0,17
FR0013176526	Valéo S.E.	STK	1.058	354	62	EUR	25,370	26.841,46	0,05
FI4000074984	Valmet Oyj	STK	649	195	3	EUR	36,780	23.870,22	0,05
CH0311864901	VAT Group AG	STK	132	40	0	CHF	307,600	37.039,96	0,08
FR0000124141	Veolia Environnement S.A.	STK	2.655	839	15	EUR	25,470	67.622,85	0,14
AT0000746409	Verbund AG	STK	322	97	1	EUR	77,650	25.003,30	0,05
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS	STK	4.925	4.931	6	DKK	244,800	162.130,11	0,33
GB0009292243	Victrix PLC	STK	424	129	2	GBP	25,460	12.575,04	0,03
CH0364749348	Vifor Pharma AG	STK	230	69	1	CHF	119,750	25.125,43	0,05
FR0000125486	VINCI S.A.	STK	2.885	982	3	EUR	89,990	259.621,15	0,53
GB00BD6GN030	Virgin Money UK PLC	STK	6.105	6.107	2	GBP	1,986	14.120,19	0,03
GB0001859296	Vistry Group PLC	STK	1.084	1.295	958	GBP	11,765	14.856,15	0,03
FR0000127771	Vivendi S.A.	STK	3.712	1.277	531	EUR	28,330	105.160,96	0,21
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC	STK	140.538	48.980	234	GBP	1,213	198.647,34	0,41
AT0000937503	voestalpine AG	STK	541	164	3	EUR	34,340	18.577,94	0,04
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	7.747	2.426	344	SEK	205,900	157.277,39	0,32
SE0007074844	Wallenstam AB	STK	1.018	307	5	SEK	135,400	13.590,73	0,03
BE0974349814	Warehouses De Pauw N.V.	STK	682	236	0	EUR	32,200	21.960,40	0,04
FI0009003727	Wärtsilä Corp.	STK	2.375	716	11	EUR	12,515	29.723,13	0,06
GB0009465807	Weir Group PLC, The	STK	1.266	382	6	GBP	18,510	27.297,64	0,06
FR0000121204	Wendel SE	STK	132	40	2	EUR	113,400	14.968,80	0,03
GB00B2PDGW16	WH Smith PLC	STK	638	639	1	GBP	16,085	11.954,37	0,02
GB00B1KJJ408	Whitbread PLC	STK	985	297	3	GBP	31,220	35.822,35	0,07
AT0000831706	Wienerberger AG	STK	562	169	2	EUR	32,500	18.265,00	0,04
SE0011205194	Wihlborgs Fastigheter AB	STK	671	203	5	SEK	185,700	12.286,01	0,03
JE00BN574F90	Wizz Air Holdings PLC	STK	209	209	0	GBP	46,690	11.367,24	0,02
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.	STK	1.305	399	30	EUR	84,720	110.559,60	0,23
FR0011981968	Worldline S.A.	STK	1.141	766	149	EUR	78,940	90.070,54	0,18
JE00B8KF9B49	WPP PLC	STK	5.873	1.804	132	GBP	9,742	66.648,93	0,14
NO0010208051	Yara International ASA	STK	834	254	16	NOK	453,200	37.037,97	0,08
CH0042615283	Zur Rose Group AG	STK	47	47	0	CHF	354,500	15.199,32	0,03
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	734	221	3	CHF	371,200	248.550,26	0,51
						EUR		41.137.065,44	84,02
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	3.426	1.033	16	CHF	348,550	1.089.337,99	2,22
						EUR		1.089.337,99	2,22
						EUR		48.782.064,53	99,63
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle		EUR	75.468,50			%	100,000	75.468,50	0,15
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		CHF	-9,26			%	100,000	-8,45	0,00
Verwahrstelle		NOK	0,02			%	100,000	0,00	0,00
Verwahrstelle		PLN	0,01			%	100,000	0,00	0,00
Verwahrstelle		SEK	-29.601,19			%	100,000	-2.918,67	-0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		GBP	0,75			%	100,000	0,87	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenforderungen Aktien		EUR	21.460,61					21.460,61	0,04
Dividendenforderungen Aktien		GBP	20.044,87					23.350,07	0,05
Dividendenforderungen Aktien		SEK	69.885,29					6.890,68	0,01
Dividendenforderungen Aktien		USD	1.866,43					1.573,85	0,00
Dividendenforderungen REITS		EUR	241,67					241,67	0,00
Dividendenforderungen REITS		GBP	648,89					755,89	0,00
Forderungen Aktien		CHF	767,90					700,51	0,00
Quellensteuererstattungsansprüche		CHF	73.308,14					66.874,79	
Quellensteuererstattungsansprüche		DKK	26.449,26					3.556,80	0,01
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR	2.753,53					2.753,53	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-21.109,86					-21.109,86	-0,04
Wert des Teilsondervermögens									
Anteilwert								48.961.655,32	100,00 ¹⁾
Umlaufende Anteile								46,28	
								1.057.920	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte:	Kurse per 30.06.2021		
Devisenkurse (in Mengennotiz)	30.06.2021		
Britisches Pfund	(GBP)	0,858400	= 1 EUR
Dänische Krone	(DKK)	7,436250	= 1 EUR
Norwegische Krone	(NOK)	10,20490	= 1 EUR
Polnischer Zloty	(PLN)	4,514750	= 1 EUR
Schwedische Krone	(SEK)	10,14200	= 1 EUR
Schweizer Franken	(CHF)	1,096200	= 1 EUR
US-Dollar	(USD)	1,185900	= 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					
DE0005419105	CANCOM SE	STK	37	169	
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG	STK	35	162	
DE000A161N30	GRENKE AG	STK	27	121	
DE000A289A57	GRENKE AG - Anrechte	STK	121	121	
DE0006070006	HOCHTIEF AG	STK	22	98	
DE000A3H22F2	KION GROUP AG - Anrechte	STK	283	283	
DE000LEG1201	LEG Immobilien AG - Anrechte	STK	303	303	
DE000LEG1227	LEG Immobilien SE - Anrechte	STK	316	316	
ES0178430106	Telefónica S.A.	STK	1.147	1.147	
DE000A3H3LS7	Scout24 AG	STK	56	56	
DE000A3H3LQ1	Scout24 AG	STK	56	56	
DE000A3H3LR9	Scout24 AG - Anrechte	STK	428	428	
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK	91	91	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	885	4.024	
DE000TUA6109	TUI AG - Anrechte	STK	1.673	1.673	
DE000A0TGJ55	VARTA AG	STK	74	74	
DE000A2888C9	Vonovia SE - Anrechte	STK	1.737	1.737	
DE000A3H3L51	Vonovia SE - Anrechte	STK	2.322	2.322	
Ausland					
ES06670509H2	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte	STK	0	830	
ES0167050170	ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A.	STK	51	51	
ES0167050188	ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A.	STK	16	16	
ES06670509I0	ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. - Anrechte	STK	1.013	1.013	
SE0005568136	Addtech AB	STK	63	286	
LU1250154413	ADLER Group S.A.	STK	386	386	
BE6321623363	Aedifica S.A. - Anrechte	STK	0	74	
BE0970176799	Aedifica S.A. - Anrechte	STK	120	120	
BE6324764735	Aedifica S.A. - Anrechte	STK	120	120	
NL0015524109	AEGON N.V. - Anrechte	STK	7.984	7.984	
FR0014000IN0	Alstom S.A. - Anrechte	STK	846	846	
NL0011333752	Altice Europe N.V.	STK	729	2.845	
LU2264048211	Aroundtown SA - Anrechte	STK	5.250	5.250	
GB00BMC45202	AVEVA Group PLC	STK	219	219	
GB00BMC45194	AVEVA Group PLC - Anrechte	STK	219	219	
SE0006993770	Axfood AB	STK	102	461	
ES0113902342	Banco Santander S.A.	STK	3.163	3.163	
ES0613900985	Banco Santander S.A. - Anrechte	STK	72.753	72.753	
CH0531751755	Banque Cantonale Vaudoise	STK	41	139	
GB00BYQ0JC66	Beazley PLC	STK	896	2.982	
SE0011116508	Beijer Ref AB	STK	1.074	1.074	
CH0001503199	BELIMO Holding AG	STK	0	2	
SE0012455673	Boliden AB	STK	311	1.197	
SE0015811567	Boliden AB	STK	1.197	1.197	
ES0105066049	Cellnex Telecom S.A.	STK	608	608	
ES0105066031	Cellnex Telecom S.A.	STK	290	290	
ES0605066937	Cellnex Telecom S.A. - Anrechte	STK	1.555	1.555	
ES0605066929	Cellnex Telecom S.A. - Anrechte	STK	1.103	1.103	
JE00B5TT1872	Centamin PLC	STK	1.118	5.081	
FR0000120222	CNP Assurances S.A.	STK	325	1.216	
BE6328407307	Cofinimmo S.A. - Anrechte	STK	118	118	
CH0559601544	Compagnie Financière Richemont AG	STK	4.570	4.570	
GB0002318888	Cranswick PLC	STK	51	230	
FR0014003323	Crédit Agricole S.A. - Anrechte	STK	5.709	5.709	
CH1111011453	Credit Suisse Group AG - Anrechte	STK	10.133	10.133	
GB00BJQZC279	Daily Mail & General Trust PLC	STK	0	1	
IT0005252207	Davide Campari-Milano S.p.A.	STK	0	1.672	
IT0005408635	Davide Campari-Milano S.p.A. - Anrechte	STK	0	1.655	
FR0014003968	Edenred S.A. - Anrechte	STK	1.080	1.080	
PTEDP4AM0013	EDP - Energias de Portugal S.A.	STK	842	842	

PTEDP0AMS010	EDP - Energias de Portugal S.A. - Anrechte	STK	9.905	9.905
FR0014002ZT7	Electricité de France (E.D.F.) - Anrechte	STK	2.215	2.215
SE0011166933	Epiroc AB	STK	0	2.156
SE0015658125	Epiroc AB	STK	2.753	2.753
FR0000038259	Eurofins Scientific S.E.	STK	0	43
NL0015000A04	Euronext N.V. - Anrechte	STK	236	236
ES0118900150	Ferrovial S.A.	STK	23	23
ES0118900168	Ferrovial S.A.	STK	19	19
ES06189009H7	Ferrovial S.A. - Anrechte	STK	2.297	2.297
ES06189009G9	Ferrovial S.A. - Anrechte	STK	2.334	2.334
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	STK	1.090	4.946
IE00BWT6H894	Flutter Entertainment PLC	STK	0	41
GB00B2QPKJ12	Fresnillo PLC	STK	807	807
GB00B01FLG62	G4S PLC	STK	1.500	6.820
GB00B04V1276	Grainger PLC	STK	994	3.309
LU2181585527	Grand City Properties S.A. - Anrechte	STK	0	351
GB00BF5H9P87	Great Portland Estates PLC	STK	218	991
DK0010287234	H. Lundbeck A/S	STK	60	272
SE0000103699	Hexagon AB	STK	274	1.244
ES06445809L2	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	25.379	25.379
ES0144583236	Iberdrola S.A.	STK	362	362
ES0144583228	Iberdrola S.A.	STK	459	459
ES06445809K4	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	20.230	20.230
FR0000035081	Icade S.A.	STK	30	137
CH0572852298	Idorsia AG - Anrechte	STK	427	427
FR0004035913	Iliad S.A.	STK	29	83
FR0000125346	Ingenico Group S.A.	STK	58	265
ES0177542125	Internat. Cons. Airl. Group SA	STK	6.567	6.567
ES0677542906	International Consolidated Airlines Group S.A. - Anrechte	STK	4.378	4.378
SE0000107419	Investor AB	STK	440	2.002
GB00B0HZPV38	KAZ Minerals PLC	STK	1.290	1.290
SE0013256682	Kinnevik AB	STK	234	1.063
SE0014684528	Kinnevik AB	STK	1.063	1.063
SE0015797600	Kinnevik AB	STK	1.059	1.059
NL00000852580	Kon. Boskalis Westminster N.V.	STK	0	6
NL0015000AE1	Koninklijke DSM N.V. - Anrechte	STK	794	794
NL0015476987	Koninklijke DSM N.V. - Anrechte	STK	748	748
NL0015031550	Koninklijke Philips N.V. - Anrechte	STK	0	3.075
NL0015000AH4	Koninklijke Philips N.V. - Anrechte	STK	3.989	3.989
SE0006370730	Lifco AB	STK	44	199
ES0105546008	Linea Directa Aseguradora S.A.	STK	2.814	2.814
SE0014504817	Loomis AB	STK	73	331
PLLP0000011	LPP S.A.	STK	2	6
ES0124244E34	Mapfre S.A.	STK	961	4.369
ES0184696104	Masmovil Ibercom S.A.	STK	469	469
FI0009007835	Metso Corp.	STK	0	439
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International PLC	STK	324	1.471
GB00B1ZBKY84	Moneysupermarket.com Group PLC	STK	519	2.359
FI4000440664	Neles Corp.	STK	562	562
GB00BH3VJ782	Network International Holdings PLC	STK	619	2.064
SE0008321293	NIBE Industrier AB	STK	365	1.542
NL0015000A00	NN Group N.V. - Anrechte	STK	1.359	1.359
NL0014779977	NN Group N.V. - Anrechte	STK	1.408	1.408
ZAE000255360	Old Mutual Ltd.	STK	3.758	17.086
FR0000121501	Peugeot S.A.	STK	542	2.444
NL0015436106	Prosus N.V. - Anrechte	STK	1.947	1.947
FR0013509114	Publicis Groupe S.A. - Anrechte	STK	985	985
GB00BG11K365	Redrow PLC	STK	286	1.300
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	0	1.747
NL0015476904	Relx PLC - Anrechte	STK	1.747	1.747
FR0013525938	Rémy Cointreau S.A. - Anrechte	STK	94	94
ES0173516180	Repsol S.A.	STK	274	274
ES0173516198	Repsol S.A.	STK	227	227
ES06735169G0	Repsol S.A. - Anrechte	STK	0	4.948
ES06735169H8	Repsol S.A. - Anrechte	STK	6.583	6.583
GB00B669WX96	Rolls Royce Holdings PLC	STK	0	193.292
GB00BJP49W43	Rolls Royce Holdings PLC - Anrechte	STK	28.180	28.180
GB00BL5C3V96	Royal Dutch Shell PLC - Anrechte	STK	17.955	17.955
NL00150001W7	Royal Dutch Shell PLC - Anrechte	STK	17.955	17.955
NL0015000D92	Royal Dutch Shell PLC - Anrechte	STK	17.955	17.955
NL0015476953	Royal Dutch Shell PLC - Anrechte	STK	18.113	18.113
GB00BKKMKR23	RSA Insurance Group Ltd.	STK	1.004	4.551
FR0013517471	Rubis S.C.A. - Anrechte	STK	0	326
SE0000112385	Saab AB	STK	78	354
NL0000360618	SBM Offshore N.V.	STK	229	736
NL00150008I1	SBM Offshore N.V. - Anrechte	STK	649	649
NL0012044747	Shop Apotheke Europe N.V.	STK	64	64
GB00BKDM7X41	Signature Aviation PLC	STK	3.368	5.654
SE0007439112	Sinch AB	STK	91	235
IT0005436909	Snam S.p.A. - Anrechte	STK	9.003	9.003
CH0496451508	SoftwareONE Holding AG	STK	489	489
CH0267291224	Sunrise Communications Gr. AG	STK	33	150
SE0000489098	Sweco AB	STK	73	309

SE0000310336	Swedish Match AB	STK	157	713
NL0014559478	Technip Energies N.V.	STK	387	387
ES0178430072	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	665	665
ES0178430098	Telefónica S.A.	STK	1.228	1.228
ES06784309C1	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	0	15.970
ES06784309E7	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	22.941	22.941
ES06784309D9	Telefónica S.A. - Anrechte	STK	22.119	22.119
GB0008847096	Tesco PLC	STK	9.468	43.045
NO0003078800	TGS Nopec Geophysical Co. ASA	STK	115	523
ZAE000296554	THUNGELA RESOURCES	STK	619	619
DK0060477503	Topdanmark AS	STK	46	210
FR0013517257	Total S.A. - Anrechte	STK	0	8.921
GB00B1H0DZ51	TP ICAP PLC	STK	545	2.476
GB00BKDTK925	Trainline PLC	STK	708	2.356
GB0007739609	Travis Perkins PLC	STK	244	1.108
DK0061534534	Tryg AS	STK	725	725
DK0061534450	Tryg AS - Anrechte	STK	4.354	4.354
NL0000388619	Unilever N.V.	STK	1.326	6.029
IT0003487029	Unio.di Banche Italiane S.p.A.	STK	898	4.085
DK0010268606	Vestas Wind Systems AS	STK	213	888
FR0013508132	VINCI S.A. - Anrechte	STK	0	1.906
ES0184262212	Viscofan S.A.	STK	56	186
BE6328179930	Warehouses De Pauw N.V. - Anrechte	STK	605	605
GB00BL6C2002	Wickes Group PLC	STK	1.104	1.104
GB0031698896	William Hill PLC	STK	4.709	4.709
NL00150008J9	Wolters Kluwer N.V. - Anrechte	STK	1.171	1.171

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 30.06.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		167.953,79	0,159
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		1.031.661,27	0,975
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-21.303,52	-0,020
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-74.555,86	-0,070
5. Sonstige Erträge		622,86	0,001
davon: Erstattete Quellensteuer für Vorjahre	618,06		0,001
davon: Sonstiges	4,80		0,000
Summe der Erträge		1.104.378,54	1,044
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-4,90	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-84.216,02	-0,080
3. Sonstige Aufwendungen		-1.226,33	-0,001
davon: Verwahrtgelt	-1.133,33		-0,001
davon: Sonstiges	-93,00		0,000
Summe der Aufwendungen		-85.447,25	-0,081
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.018.931,29	0,963
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		193.627,89	0,183
2. Realisierte Verluste		-246.288,69	-0,233
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-52.660,80	-0,050
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		966.270,49	0,913
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		6.023.168,58	5,693
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.584.748,39	2,443
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		8.607.916,97	8,137
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		9.574.187,46	9,050

Entwicklung des Teilsondervermögen

	2020 / 2021
	EUR
I. Wert des Teilsondervermögen am Beginn des Geschäftsjahres	27.459.918,18
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-802.842,60
2. Mittelzufluss (netto)	12.832.939,40
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	13.618.248,34
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-785.308,94
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-102.547,12
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	9.574.187,46
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	6.023.168,58
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	2.584.748,39
II. Wert des Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres	48.961.655,32

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		966.270,49	0,913
1. Vortrag aus dem Vorjahr		0,00	0,000
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		966.270,49	0,913
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		35.300,89	0,033
1. Vortrag auf neue Rechnung		35.300,89	0,033
III. Gesamtausschüttung		930.969,60	0,880
1. Endausschüttung		930.969,60	0,880

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre
Geschäftsjahr

	Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2020/2021	48.961.655,32	46,28
2019/2020	27.459.918,18	36,85
2018/2019	15.600.332,88	39,67
2018	15.258.736,63	38,85

Lyxor 1 STOXX[®] Europe 600 UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 STOXX[®] Europe 600 UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF9603
Anteilwert	EUR	46,28
Umlaufende Anteile	STK	1.057.920
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,19
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,63

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 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:

Erstattete Quellensteuer für Vorjahre -558,36

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

Negative Einlagenzinsen -1.028,58

Korrekturen von Dividendenansprüchen -83,89

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

0,20

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 STOXX[®] Europe 600 UCITS ETF

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut) EUR 76.074,86

Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft % -47,28

Davon für die Verwahrstelle % 73,79

Davon für Dritte % 73,49

Transaktionskosten

EUR

6.877,30

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 99,79 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 15.730.119,47 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und 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	0,209%
Höhe der Annual Tracking Difference	0,555%

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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S., der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%). Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

--Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.

Lyxor 1 DAX[®] 50 ESG UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		194.116.369,86	100,02
1. Aktien		194.008.778,78	99,97
- Audiovisuelle Industrie	549.867,73		0,28
- Banken	4.756.925,77		2,45
- Bau und Baustoffe	1.775.006,58		0,91
- Bergbau	718.485,81		0,37
- Büroausstattung	709.937,80		0,37
- Chemische Industrie	31.694.596,28		16,33
- Einzelhandel	5.570.255,27		2,87
- Elektrik / Elektronik	9.101.749,36		4,69
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	23.674.164,30		12,20
- Pharmaindustrie / Biotech	19.781.798,80		10,19
- Real Estate	10.619.883,68		5,47
- Software	13.556.673,00		6,99
- Sonstige Finanzdienstleistungen	4.485.920,00		2,31
- Sonstige industrielle Werte	14.540.443,00		7,49
- Telekommunikation	11.514.043,70		5,93
- Textilien und Kleidung	10.980.443,30		5,66
- Transportation	10.149.812,40		5,23
- Versicherungen	19.828.772,00		10,22
2. Bankguthaben		107.591,08	0,06
II. Verbindlichkeiten		-42.889,98	-0,02
III Wert des Teilsondervermögens		194.073.479,88	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 DAX[®] 50 ESG UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK		30.106	30.093	769	EUR 313,900	9.450.273,40	4,87
DE0008404005	Allianz SE	STK		62.051	62.329	1.720	EUR 210,300	13.049.325,30	6,72
DE000BASF111	BASF SE	STK		152.520	155.750	7.248	EUR 66,440	10.133.428,80	5,22
DE000BAY0017	Bayer AG	STK		163.138	165.603	6.234	EUR 51,210	8.354.296,98	4,30
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		53.212	53.205	1.395	EUR 89,310	4.752.363,72	2,45
DE0005158703	Bechtle AG	STK		4.532	4.531	118	EUR 156,650	709.937,80	0,37
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK		16.249	16.251	432	EUR 101,750	1.653.335,75	0,85
DE000A1DAHH0	Brenntag SE	STK		25.656	25.647	667	EUR 78,420	2.011.943,52	1,04
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		6.069	6.068	159	EUR 162,950	988.943,55	0,51
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK		165.102	165.042	4.290	EUR 5,982	987.640,16	0,51
DE0005439004	Continental AG	STK		17.935	17.945	483	EUR 123,980	2.223.581,30	1,15
DE0006062144	Covestro AG	STK		32.076	32.126	789	EUR 54,460	1.746.858,96	0,90
DE0007100000	Daimler AG	STK		139.423	139.196	3.446	EUR 75,300	10.498.551,90	5,41
DE0005140008	Deutsche Bank AG	STK		343.099	342.976	8.917	EUR 10,986	3.769.285,61	1,94
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		30.475	30.462	789	EUR 147,200	4.485.920,00	2,31
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG	STK		83.328	83.375	1.814	EUR 9,490	790.782,72	0,41
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		163.163	164.123	5.259	EUR 57,360	9.359.029,68	4,82
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		535.365	540.991	20.304	EUR 17,812	9.535.921,38	4,91
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE	STK		49.682	52.281	4.008	EUR 51,580	2.562.597,56	1,32
DE000EVNK013	Evonik Industries AG	STK		31.796	32.250	1.292	EUR 28,280	899.190,88	0,46
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG	STK		22.177	22.224	607	EUR 19,920	441.765,84	0,23
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA	STK		32.968	33.739	771	EUR 70,040	2.309.078,72	1,19
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK		68.320	68.333	1.812	EUR 43,995	3.005.738,40	1,55
DE00060602006	GEA Group AG	STK		24.610	24.638	676	EUR 34,160	840.677,60	0,43
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK		9.969	10.025	319	EUR 141,100	1.406.625,90	0,72
DE0006047004	HeidelbergCement AG	STK		24.537	24.656	765	EUR 72,340	1.775.006,58	0,91
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA	STK		28.973	28.964	754	EUR 89,040	2.579.755,92	1,33
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		216.098	216.187	5.779	EUR 33,820	7.308.434,36	3,77
DE000KGX8881	KION GROUP AG	STK		11.913	12.010	381	EUR 89,880	1.070.740,44	0,55
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG	STK		10.978	11.048	280	EUR 97,000	1.064.866,00	0,55
DE0005470405	LANXESS AG	STK		13.576	13.570	332	EUR 57,820	784.964,32	0,40
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE	STK		11.972	12.064	394	EUR 121,450	1.453.999,40	0,75
DE0006599905	Merck KGaA	STK		21.462	21.454	557	EUR 161,700	3.470.405,40	1,79
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		23.264	23.576	924	EUR 230,950	5.372.820,80	2,77
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE	STK		25.427	25.957	530	EUR 90,360	2.297.583,72	1,18
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	STK		32.779	32.845	864	EUR 16,775	549.867,73	0,28
DE0006969603	PUMA SE	STK		15.218	15.208	352	EUR 100,550	1.530.169,90	0,79
DE0007164600	SAP SE	STK		114.075	123.643	11.687	EUR 118,840	13.556.673,00	6,99
DE0007165631	Sartorius AG	STK		4.085	4.195	260	EUR 439,000	1.793.315,00	0,92
DE000A12DM80	Scout24 AG	STK		13.982	15.738	2.206	EUR 71,120	994.399,84	0,51
DE0007236101	Siemens AG	STK		100.850	102.343	4.013	EUR 133,620	13.475.577,00	6,94
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK		78.311	81.174	2.863	EUR 25,420	1.990.665,62	1,03
DE000SYM9999	Symrise AG	STK		20.186	20.298	673	EUR 117,500	2.371.855,00	1,22
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK		24.327	25.242	915	EUR 26,760	650.990,52	0,34
DE0007500001	thyssenkrupp AG	STK		81.739	81.711	2.126	EUR 8,790	718.485,81	0,37
DE0005089031	United Internet AG	STK		15.718	16.086	368	EUR 34,480	541.956,64	0,28
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK		89.622	91.872	2.250	EUR 54,520	4.886.191,44	2,52
DE000ZAL1111	Zalando SE	STK		29.333	29.323	735	EUR 101,950	2.990.499,35	1,54
							EUR	179.196.319,22	92,33
Ausland									
LU1673108939	Aroundtown SA	STK		162.022	164.292	7.541	EUR 6,580	1.066.104,76	0,55
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK		56.488	56.698	1.617	EUR 243,350	13.746.354,80	7,08
							EUR	14.812.459,56	7,63
							EUR	194.008.778,78	99,97
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
							EUR	107.591,08	0,06
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
		EUR		107.591,08			% 100,000	107.591,08	0,06
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
		EUR		-42.889,98			EUR	-42.889,98	-0,02
Wert des Teilsondervermögens									
							EUR	194.073.479,88	100,00 ¹⁾
							EUR	39,29	
Umlaufende Anteile							STK	4.939.674	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Teilsondervermögen sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2021

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG	STK	0	161	
DE0005790430	FUCHS PETROLUB SE	STK	0	304	
DE0006070006	HOCHTIEF AG	STK	241	333	
DE000A3H22F2	KION GROUP AG - Anrechte	STK	878	878	
DE000LEG1201	LEG Immobilien AG - Anrechte	STK	311	311	
DE000LEG1227	LEG Immobilien SE - Anrechte	STK	8.023	8.023	
DE0007010803	RATIONAL AG	STK	90	112	
DE000A3H3LR9	Scout24 AG - Anrechte	STK	1.748	1.748	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	16.110	20.116	
DE000A3H3L51	Vonovia SE - Anrechte	STK	9.640	9.640	
Ausland					
LU2264048211	Aroundtown SA - Anrechte	STK	18.943	18.943	
QS0491798ATT	AROUNDTOWN SA - Anrechte	STK	0	0	
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	2.678	3.678	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 30.06.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		4.777.285,24	0,967
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		218.910,04	0,044
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-607.913,17	-0,123
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-4.225,82	-0,001
5. Sonstige Erträge		55,93	0,000
davon: Sonstiges	55,93		0,000
Summe der Erträge		4.384.112,22	0,888
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-38,87	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-367.043,47	-0,074
3. Sonstige Aufwendungen		-313,84	0,000
davon: Verwahrensgeld	-313,84		0,000
Summe der Aufwendungen		-367.396,18	-0,074
III. Ordentlicher Nettoertrag		4.016.716,04	0,813
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		7.473.743,76	1,513
2. Realisierte Verluste		-217.787,31	-0,044
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		7.255.956,45	1,469
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		11.272.672,49	2,282
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		5.970.234,08	1,209
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-2.373.605,55	-0,481
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		3.596.628,53	0,728
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		14.869.301,02	3,010

Entwicklung des Teilsndervermögen

	2020 / 2021
	EUR
I. Wert des Teilsndervermögen am Beginn des Geschäftsjahres	3.726.906,74
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-16.217,50
2. Mittelzufluss (netto)	184.197.281,38
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	188.153.183,32
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-3.955.901,94
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-8.703.791,76
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	14.869.301,02
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	5.970.234,08
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-2.373.605,55
II. Wert des Teilsndervermögen am Ende des Geschäftsjahres	194.073.479,88

Verwendung der Erträge des Teilsndervermögen

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		13.920.883,78	2,818
1. Vortrag aus dem Vorjahr		2.648.211,29	0,536
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		11.272.672,49	2,282
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		10.660.698,94	2,158
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		10.660.698,94	2,158
III. Gesamtausschüttung		3.260.184,84	0,660
1. Endausschüttung		3.260.184,84	0,660

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Teilsndervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2020/2021	194.073.479,88	39,29
2020	3.726.906,74	30,93

Lyxor 1 DAX[®] 50 ESG UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 DAX 50 ESG UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF9090
Anteilwert	EUR	39,29
Umlaufende Anteile	STK	4.939.674
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,23
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,97

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2021 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 Aufwendungen setzen sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	75,98
-------------------------	-------

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

0,18

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 UCITS ETF

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	63.017,55
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	-44,98
Davon für die Verwahrstelle	%	63,91
Davon für Dritte	%	81,07

Transaktionskosten

EUR

12.283,90

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 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 200.770.564,17 EUR.

Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen 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 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	0,137%
Höhe der Annual Tracking Difference	-1,421%

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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S., der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%).

Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

–Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.

Lyxor 1 DAX[®] UCITS ETF*

Vermögensübersicht zum 22. April 2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		101.367.002,83	100,13
1. Forderungen		101.313.032,08	100,08
2. Bankguthaben		53.970,75	0,05
II. Verbindlichkeiten		-130.341,83	-0,13
III. Wert des Teilsondervermögens		101.236.661,00	100,00 ¹⁾

* Im Berichtszeitraum wurde der Lyxor 1 DAX[®] UCITS ETF auf den Lyxor 1 DAX 50 ESG UCITS ETF verschmolzen.

Lyxor 1 DAX[®] UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 22. April 2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 22.04.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktfonds und Geldmarktfonds							EUR	53.970,75	0,05
EUR-Guthaben bei:									
	Verwahrstelle		EUR	53.970,75			% 100,000	53.970,75	0,05
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	101.313.032,08	100,08
	Dividendenforderungen Aktien		EUR	4.743,00				4.743,00	0,00
	Forderungen Aktien		EUR	101.221.316,09				101.221.316,09	99,98
	Forderungen Rechte AG		EUR	76.699,81				76.699,81	0,08
	Sonstige Forderungen		EUR	10.273,18				10.273,18	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-130.341,83	-0,13
	Verbindlichkeiten Aktien		EUR	-82.260,68				-82.260,68	-0,08
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-48.081,15				-48.081,15	-0,05
Wert des Teilsondervermögens							EUR	101.236.661,00	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	131,89	
Umlaufende Anteile							STK	767.600	

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 22.04.2021

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					
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK	452	18.296	
DE0008404005	Allianz SE	STK	507	41.593	
DE000BASF111	BASF SE	STK	1.131	92.789	
DE000BAY0017	Bayer AG	STK	1.209	99.249	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK	394	32.372	
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK	121	9.929	
DE0005439004	Continental AG	STK	385	11.163	
DE0006062144	Covestro AG	STK	2.789	19.645	
DE0007100000	Daimler AG	STK	3.420	87.208	
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE	STK	20.276	20.276	
DE0005140008	Deutsche Bank AG	STK	2.542	208.731	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK	226	18.523	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK	2.835	100.897	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK	10.276	345.092	
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE	STK	84	32.222	
DE000ENAG999	E.ON SE	STK	2.721	223.369	
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA	STK	319	20.117	
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK	861	41.892	
DE0006047004	HeidelbergCement AG	STK	182	14.928	
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA	STK	491	17.902	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK	2.372	132.173	
DE0006599905	Merck KGaA	STK	160	13.058	
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	STK	109	5.387	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK	173	14.154	
DE0007037129	RWE AG	STK	5.202	68.149	
DE0007164600	SAP SE	STK	25.716	101.990	
DE0007236101	Siemens AG	STK	9.820	84.500	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK	80.695	80.695	
DE0007664039	Volkswagen AG	STK	879	19.148	
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK	4.283	54.848	
DE000A2888C9	Vonovia SE - Anrechte	STK	52.063	52.063	
DE0007472060	Wirecard AG	STK	0	11.332	
DE000A3H3L51	Vonovia SE - Anrechte	STK	45.392	45.392	
Ausland					
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	2.231	52.894	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis zum 22.04.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		1.189.670,00	1,550
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		133.768,11	0,174
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-134.526,59	-0,175
Summe der Erträge		1.188.911,52	1,549
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-2,65	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-134.029,50	-0,175
3. Sonstige Aufwendungen		-199,95	0,000
davon: Verwahrentgelt	-199,95		0,000
Summe der Aufwendungen		-134.232,10	-0,175
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.054.679,42	1,374
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		4.824.594,93	6,285
2. Realisierte Verluste		-3.069.463,66	-3,999
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.755.131,27	2,287
V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		2.809.810,69	3,661
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		12.502.027,03	16,287
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		6.787.016,78	8,842
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		19.289.043,81	25,129
VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		22.098.854,50	28,790

Entwicklung des Teilsondervermögens

	2020 / 2021
	EUR
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres	94.031.897,06
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-2.343.743,50
2. Mittelzufluss (netto)	-12.450.726,68
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	309.885,52
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-12.760.612,20
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-99.620,38
4. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	22.098.854,50
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	12.502.027,03
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	6.787.016,78
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres	101.236.661,00

Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		11.906.515,08	15,511
1. Vortrag aus dem Vorjahr		3.029.923,65	3,947
2. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		2.809.810,69	3,661
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ²⁾		6.066.780,74	7,904
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		11.906.515,08	15,511
2. Vortrag auf neue Rechnung		11.906.515,08	15,511
III. Gesamtausschüttung		0,00	0,000
1. Endausschüttung		0,00	0,000

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

2) Die Zuführung aus dem Teilsondervermögen 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	Teilsondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2020/2021	101.236.661,00	131,89
2019/2020	94.031.897,06	113,21
2018/2019	84.111.768,89	113,21
2017/2018	74.686.225,99	116,01

Lyxor 1 DAX[®] UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Lyxor 1 DAX[®] UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)		DE000ETF9017
Anteilwert	EUR	131,89
Umlaufende Anteile	STK	767.600
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,15
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

0,00

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Rumpfgeschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 22.04.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 22.04.2021 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 Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	182,29
-------------------------	--------

Gesamtkostenquote (in %)

0,15

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens 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

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	121.214,66
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	-26,97
Davon für die Verwahrstelle	%	33,86
Davon für Dritte	%	93,11

Transaktionskosten

EUR

12.660,62

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 verbundenen Unternehmen und Personen sind, betrug 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 134.126.611,50 EUR. Bei dem eng verbunden Unternehmen handelt es sich um die Societe Generale.

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 Teilsendvermögens 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 Teilsendvermögen erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilsendvermögens.

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	0,130%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,010%

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

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

Wesentliche Änderungen

Der Fonds Lyxor 1 DAX® UCITS ETF (I) wurde zum 23.04.2021 auf den Fonds Lyxor 1 DAX® 50 ESG UCITS ETF verschmolzen.

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. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

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. (bis zum 27.Mai 2019, der Commerzbank AG), übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der LFS durch die Lyxor International Asset Management S.A.S., der am 27.05.2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft.

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 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%).

Die Gesamtvergütung betrug 1.407 TEUR.

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausbezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor 1:

- Geschäftsleiter: TEUR 27,90
- Mitarbeiter mit Risikoverantwortung gemäß Vergütungsrichtlinie (Risikoträger): TEUR 39,46
- Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen: TEUR 47,78
- Mitarbeiter mit einer Gesamtvergütung wie Geschäftsleiter oder Risikoträger: nicht anwendbar.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor 1:

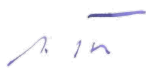
--Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): TEUR 287,87

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
- 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 der selbigen, erfolgte turnusmäßig zum 30. Juni 2019.

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.



Mathias Turra
Managing Director



Martine Capus
Managing Director

Lyxor 1

Vermerk des Abschlussprüfers

An die Lyxor Funds Solutions 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 sowie des verschmolzenen Teilsondervermögens Lyxor 1 DAX® UCITS ETF – bestehend aus den Tätigkeitsberichten für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 30. Juni 2021 (für das Teilsondervermögen Lyxor 1 DAX® UCITS ETF: Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 22. April 2021), den Vermögensübersichten und den Vermögensaufstellungen zum 30. Juni 2021 (für das Teilsondervermögen Lyxor 1 DAX® UCITS ETF: Vermögensübersicht und Vermögensaufstellung zum 22. April 2021), den Ertrags- und Aufwandsrechnungen, der Verwendungsrechnungen, der Entwicklungsrechnungen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 30. Juni 2021 (für das Teilsondervermögen Lyxor 1 DAX® UCITS ETF: Ertrags- und Aufwandsrechnung, Verwendungsrechnung, Entwicklungsrechnung für das Rumpfgeschäftsjahr vom 1. Juli 2020 bis zum 22. April 2021), 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 Lyxor Funds Solutions 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.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für die Jahresberichte

Die gesetzlichen Vertreter der Lyxor Funds Solutions 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 Lyxor Funds Solutions S.A. zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Ereignisse oder Gegebenheiten im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens - sofern einschlägig - anzugeben.

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, wobei 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 Lyxor Funds Solutions S.A. abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Lyxor Funds Solutions 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 Lyxor Funds Solutions 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 Lyxor Funds Solutions 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.

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, 26. Oktober 2021

Ernst & Young GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Heist
Wirtschaftsprüfer

Arlt
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.