

Lyxor 1

**Ein richtlinienkonformes Sondervermögen (Umbrella-Konstruktion)
deutschen Rechts**

Ungeprüfter Halbjahresbericht

zum 31.12.2022



Es können keine Anteile auf der Basis von Finanzberichten gezeichnet werden. Anteilszeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Basis des Verkaufsprospektes und den wesentlichen Anlegerinformationen mit dem letzten erhältlichen Jahresbericht und dem eventuell danach veröffentlichten Halbjahresbericht vorgenommen werden.

Inhaltsverzeichnis:

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF.....	1
Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF*.....	4
Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF.....	8
Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF.....	12
Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF.....	23

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
I. Vermögensgegenstände		51.277.339,63	100,06
1. Aktien		50.725.536,10	98,98
- Bau und Baustoffe	1.000.118,88		1,95
- Chemische Industrie	6.100.340,63		11,90
- Energieversorger	2.645.992,99		5,16
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	14.106.561,68		27,53
- Pharmaindustrie / Biotech	4.797.077,78		9,36
- Real Estate	2.122.970,22		4,14
- Telekommunikation	5.054.793,34		9,86
- Transportation	4.544.059,88		8,87
- Versicherungen	10.353.620,70		20,20
2. Forderungen		505.811,42	0,99
3. Bankguthaben		45.992,11	0,09
II. Verbindlichkeiten		-31.512,11	-0,06
III. Teilsondervermögen		51.245.827,52	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondervermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE0008404005	Allianz SE		STK	25.703	5.891	4.565	EUR	200,900	5.163.732,70	10,08
DE000BASF111	BASF SE		STK	111.132	22.458	8.248	EUR	46,390	5.155.413,48	10,06
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	99.267	30.700	2.923	EUR	48,325	4.797.077,78	9,36
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	41.820	8.804	1.408	EUR	83,380	3.486.951,60	6,80
DE0005439004	Continental AG		STK	14.719	14.719	0	EUR	55,980	823.969,62	1,61
DE0006062144	Covestro AG		STK	25.853	6.218	837	EUR	36,550	944.927,15	1,84
DE0007100000	Daimler AG		STK	82.927	89.095	6.168	EUR	61,400	5.091.717,80	9,94
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	129.166	29.422	4.253	EUR	35,180	4.544.059,88	8,87
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	271.209	52.254	28.155	EUR	18,638	5.054.793,34	9,86
DE000ENAG999	E.ON SE		STK	283.479	69.139	9.138	EUR	9,334	2.645.992,99	5,16
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	18.771	4.178	622	EUR	53,280	1.000.118,88	1,95
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	17.072	3.632	1.610	EUR	304,000	5.189.888,00	10,13
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	20.866	5.089	673	EUR	51,240	1.069.173,84	2,09
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	31.221	9.975	906	EUR	116,420	3.634.748,82	7,09
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	96.411	22.505	3.151	EUR	22,020	2.122.970,22	4,14
							EUR	50.725.536,10	98,98	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	50.725.536,10	98,98
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	45.992,11	0,09
EUR-Guthaben bei:										
	Verwahrstelle	EUR		45.992,11			%	100,000	45.992,11	0,09
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	505.811,42	0,99
	Dividendenforderungen Aktien	EUR		505.811,42					505.811,42	0,99
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-31.512,11	-0,06
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR		-31.512,11					-31.512,11	-0,06
Wert des Teilsondervermögens								EUR	51.245.827,52	100,00¹⁾
Anteilwert								EUR	161,84	
Umlaufende Anteile								STK	316.650	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.12.2022

Keine Fremdwährungskurse

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE0007037129	RWE AG	STK	8.839	81.483	
DE0007236101	Siemens AG	STK	5.251	48.406	

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 DivDAX (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

	EUR	DE000ETF9033
Anteilwert		161,84
Umlaufende Anteile	STK	316.650
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,25
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)		98,98
Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben für Indexfonds

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 (annualisiert)

0,47%

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.

Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
I. Vermögensgegenstände		103.115.906,28	100,07
1. Aktien		103.031.200,79	99,99
- Audiovisuelle Industrie	2.717.233,65		2,64
- Banken	8.762.723,05		8,50
- Bau und Baustoffe	4.083.344,50		3,96
- Bergbau	2.160.529,84		2,10
- Büroausstattung	2.538.908,82		2,46
- Chemische Industrie	8.021.318,30		7,78
- Einzelhandel	2.952.424,08		2,87
- Elektrik / Elektronik	3.907.052,84		3,79
- Energieversorger	3.207.993,62		3,11
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	11.139.404,93		10,81
- Papier- und Verpackungsindustrie	1.611.762,00		1,56
- Pharmaindustrie / Biotech	6.155.357,60		5,97
- Real Estate	6.940.712,60		6,74
- Software	5.543.494,83		5,38
- Sonstige Dienstleistungen	1.512.303,72		1,47
- Sonstige industrielle Werte	3.166.164,32		3,07
- Telekommunikation	8.983.618,96		8,72
- Textilien und Kleidung	5.367.051,90		5,21
- Transportation	7.402.242,50		7,18
- Unterhaltungsindustrie	1.324.528,92		1,29
- Verbrauchsgüter	3.317.340,05		3,22
- Versicherungen	2.215.689,76		2,15
2. Forderungen		733,85	0,00
3. Bankguthaben		83.971,64	0,08
II. Verbindlichkeiten		-75.096,07	-0,07
III. Teilsondervermögen		103.040.810,21	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsonder- ver- mögens	
							im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE		STK	105.422	32.368	8.078	EUR	26,970	2.843.231,34	2,76
DE0006766504	Aurubis AG		STK	28.294	8.694	2.218	EUR	76,360	2.160.529,84	2,10
DE0005158703	Bechtle AG		STK	76.797	23.590	5.992	EUR	33,060	2.538.908,82	2,46
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	34.293	11.434	3.565	EUR	117,900	4.043.144,70	3,92
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	991.707	314.361	86.908	EUR	8,836	8.762.723,05	8,50
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	953.283	327.082	29.268	EUR	7,765	7.402.242,50	7,18
DE0006095003	ENCAVIS AG		STK	112.972	34.752	8.719	EUR	18,485	2.088.287,42	2,03
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	192.400	108.678	64.532	EUR	17,935	3.450.694,00	3,35
DE0005664809	Evotec SE		STK	138.415	44.700	12.966	EUR	15,260	2.112.212,90	2,05
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG		STK	34.204	10.489	2.661	EUR	38,050	1.301.462,20	1,26
DE000A02ZZZ5	freenet AG		STK	111.474	34.245	8.707	EUR	20,420	2.276.299,08	2,21
DE0006602006	GEA Group AG		STK	136.787	75.440	47.546	EUR	38,200	5.225.263,40	5,07
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG		STK	25.665	7.934	1.837	EUR	62,800	1.611.762,00	1,56
DE000A13SX22	HELLA GmbH & Co. KGaA		STK	19.182	20.406	1.224	EUR	76,050	1.458.791,10	1,42
DE000A161408	HelloFresh SE		STK	161.585	289.136	127.551	EUR	20,530	3.317.340,05	3,22
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG		STK	54.513	16.746	4.253	EUR	54,160	2.952.424,08	2,87
DE0006219934	Jungheinrich AG		STK	45.003	14.313	4.016	EUR	26,580	1.196.179,74	1,16
DE000KGX8881	KION GROUP AG		STK	67.327	21.453	5.997	EUR	26,770	1.802.343,79	1,75
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	62.033	22.679	8.445	EUR	51,040	3.166.164,32	3,07
DE0005470405	LANXESS AG		STK	76.685	55.053	37.479	EUR	37,700	2.891.024,50	2,81
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	69.524	35.060	18.203	EUR	60,860	4.231.230,64	4,11
DE0006452907	Nemetschek SE		STK	58.883	19.814	1.376	EUR	47,690	2.808.130,27	2,73
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE		STK	162.863	48.822	8.723	EUR	8,350	1.359.906,05	1,32
DE0006969603	PUMA SE		STK	94.657	94.657	0	EUR	56,700	5.367.051,90	5,21
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	69.433	24.175	8.144	EUR	46,930	3.258.490,69	3,16
DE000WAF3001	Silttronic AG		STK	15.610	4.788	1.217	EUR	68,150	1.063.821,50	1,03
DE000A2GS401	Software AG		STK	47.850	14.663	3.684	EUR	24,220	1.158.927,00	1,12
DE000STAB1L8	Stabilus SE		STK	23.161	24.510	1.349	EUR	62,900	1.456.826,90	1,41
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA		STK	30.407	9.456	4.218	EUR	43,560	1.324.528,92	1,29
DE0008303504	TAG Immobilien AG		STK	164.671	85.816	27.071	EUR	6,045	995.436,20	0,97
DE000TLX1005	Talanx AG		STK	49.993	17.621	6.169	EUR	44,320	2.215.689,76	2,15
DE000A2YN900	TeamViewer AG		STK	130.879	40.898	16.680	EUR	12,045	1.576.437,56	1,53
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	822.944	276.601	100.601	EUR	2,303	1.895.240,03	1,84
DE0005089031	United Internet AG		STK	82.244	25.272	6.445	EUR	18,890	1.553.589,16	1,51
DE000A3H3LL2	Vantage Towers AG		STK	86.663	32.007	12.122	EUR	32,100	2.781.882,30	2,70
DE000A0JL9W6	VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG		STK	18.477	18.477	0	EUR	60,600	1.119.706,20	1,09
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG		STK	14.067	4.322	1.100	EUR	119,400	1.679.599,80	1,63
								EUR	98.447.523,71	95,54
Ausland										
LU1673108939	Aroundtown SA		STK	785.179	253.245	181.740	EUR	2,183	1.714.045,76	1,66
LU1704650164	BEFESA S.A.		STK	33.562	11.800	4.117	EUR	45,060	1.512.303,72	1,47
LU0061462528	RTL Group S.A.		STK	34.415	10.555	2.679	EUR	39,440	1.357.327,60	1,32
								EUR	4.583.677,08	4,45
Summe Wertpapiervermögen								EUR	103.031.200,79	99,99
Bankguthaben, nicht verbrieft										
Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds										
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	80.843,40			%	100,000	80.843,40	0,08
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Verwahrstelle			USD	3.336,74			%	100,000	3.128,24	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände										
Quellensteuererstattungsansprüche			EUR	733,85			EUR		733,85	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten										
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-75.096,07			EUR		-75.096,07	-0,07
Wert des Teilsondervermögens								EUR	103.040.810,21	100,00 ¹⁾
Anteilwert								EUR	129,56	
Umlaufende Anteile								STK	795.300	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
 Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.12.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.12.2022
 US-Dollar (GBP) 1,06725 = 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	1.112	27.531	
DE0005470306	CTS Eventim AG & Co. KGaA	STK	2.305	44.730	
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE	STK	27.523	147.582	
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE	STK	59.372	94.943	
DE0005565204	Dürr AG	STK	14.478	49.669	
DE000A3E5D64	Fuchs Petrolub SE	STK	2.728	52.980	
DE000KSAG888	K+S Aktiengesellschaft	STK	7.520	145.911	
DE0007010803	RATIONAL AG	STK	1.597	5.284	
DE0007030009	Rheinmetall AG	STK	33.069	43.585	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK	295.284	627.967	
DE0007231326	Sixt SE	STK	490	9.648	
DE000A31C3C0	TAG Immobilien AG - Anrechte	STK	106.364	106.364	
DE0007500001	thyssenkrupp AG	STK	194.694	550.604	
DE000UNSE018	Uniper SE	STK	5.174	63.493	
DE000A0TGJ55	VARTA AG	STK	2.131	15.534	
Ausland					
US00486H1059	ADTRAN Holdings Inc.	STK	53.130	53.130	
LU2489901806	Aroundtown SA - Anrechte	STK	0	713.674	
LU0775917882	Grand City Properties S.A.	STK	2.480	61.429	
LU2489676689	Grand City Properties S.A. - Anrechte	STK	0	58.949	

Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

	EUR	DE000ETF9074
Anteilwert		129,56
Umlaufende Anteile	STK	795.300
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,30
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)		99,99
Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

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

Angaben für Indexfonds

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 (annualisiert)

0,36%

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.

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
I. Vermögensgegenstände		86.750.135,51	100,10
1. Aktien		86.651.724,40	99,99
- Bau und Baustoffe	2.616.374,70		3,02
- Büroausstattung	5.146.110,82		5,94
- Elektrik / Elektronik	22.334.898,12		25,77
- Energieversorger	2.506.815,60		2,89
- Pharmaindustrie / Biotech	23.761.633,66		27,42
- Software	15.111.316,78		17,44
- Telekommunikation	15.174.574,72		17,51
2. Bankguthaben		98.411,11	0,11
II. Verbindlichkeiten		-85.792,85	-0,10
III. Teilsondervermögen		86.664.342,66	100,00¹⁾

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondervermögens	
							im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE		STK	99.183	9.834	3.414	EUR	26,970	2.674.965,51	3,09
DE0005158703	Bechtle AG		STK	72.257	7.147	2.576	EUR	33,060	2.388.816,42	2,76
DE0005419105	CANCOM SE		STK	31.217	3.100	2.090	EUR	27,360	854.097,12	0,99
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	32.253	3.195	1.154	EUR	117,900	3.802.628,70	4,39
DE000A288904	CompuGroup Medical SE &Co.KGaA		STK	22.369	2.169	776	EUR	35,980	804.836,62	0,93
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	467.580	22.175	5.839	EUR	18,638	8.714.756,04	10,06
DE0005664809	Evotec SE		STK	130.243	12.914	4.646	EUR	15,260	1.987.508,18	2,29
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG		STK	104.892	10.381	3.746	EUR	20,420	2.141.894,64	2,47
DE000HAG0005	HENSOLDT AG		STK	46.148	4.519	1.599	EUR	22,100	1.019.870,80	1,18
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	286.713	15.499	72.823	EUR	28,430	8.151.250,59	9,41
DE000A2NB601	JENOPTIK AG		STK	44.958	4.401	1.557	EUR	25,560	1.149.126,48	1,33
DE0006632003	MorphoSys AG		STK	30.153	2.962	1.044	EUR	13,210	398.321,13	0,46
DE000A3H2200	Nagarro SE		STK	6.818	575	241	EUR	110,600	754.070,80	0,87
DE0006452907	Nemetschek SE		STK	55.400	10.918	1.761	EUR	47,690	2.642.026,00	3,05
DE000A0D6554	Nordex SE		STK	110.359	110.359	0	EUR	13,200	1.456.738,80	1,68
DE0007164600	SAP SE		STK	88.145	12.146	15.730	EUR	96,390	8.496.296,55	9,80
DE0007165631	Sartorius AG		STK	21.712	2.156	782	EUR	369,400	8.020.412,80	9,25
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	182.530	11.914	11.046	EUR	46,730	8.529.626,90	9,84
DE000WAF3001	Siltronic AG		STK	14.694	1.438	509	EUR	68,150	1.001.396,10	1,16
DE000A0DJ6J9	SMA Solar Technology AG		STK	16.586	1.623	574	EUR	66,850	1.108.774,10	1,28
DE000A2GS401	Software AG		STK	45.003	4.406	1.560	EUR	24,220	1.089.972,66	1,26
DE000A2YN900	TeamViewer AG		STK	123.093	10.419	9.278	EUR	12,045	1.482.655,19	1,71
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	774.398	62.965	28.259	EUR	2,303	1.783.438,59	2,06
DE0005089031	United Internet AG		STK	77.405	7.671	2.774	EUR	18,890	1.462.180,45	1,69
DE000A3H3LL2	Vantage Towers AG		STK	81.507	9.749	4.593	EUR	32,100	2.616.374,70	3,02
DE000A0TGJ55	VARTA AG		STK	15.893	1.563	994	EUR	22,540	358.228,22	0,41
DE000A0JL9W6	VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG		STK	17.328	1.503	430	EUR	60,600	1.050.076,80	1,21
							EUR	75.940.340,89	87,63	
Ausland										
US00486H1059	ADTRAN Holdings Inc.		STK	63.450	63.450	0	EUR	16,900	1.072.305,00	1,24
NL0012169213	Qiagen N.V.		STK	192.375	11.399	7.066	EUR	47,010	9.043.548,75	10,44
LU2333210958	SUSE S.A.		STK	35.364	3.516	1.223	EUR	16,840	595.529,76	0,69
							EUR	10.711.383,51	12,36	
							EUR	86.651.724,40	99,99	
Summe Wertpapiervermögen										
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds										
							EUR	98.411,11	0,11	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	94.920,72			%	100,000	94.920,72	0,11
Verwahrstelle			USD	3.723,02			%	100,000	3.490,39	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten										
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-85.792,85			EUR		-85.792,85	-0,10
Wert des Teilsondervermögens										
Anteilwert							EUR	86.664.342,66	100,00 ¹⁾	
Umlaufende Anteile							EUR	22,16		
							STK	3.910.000		

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.12.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.12.2022
US-Dollar (GBP) 1,06725 = 1 EUR

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					
DE0005545503	1&1 AG	STK	374	31.676	
Ausland					
AT0000A0E9W5	Kontron AG	STK	422	35.703	

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

	EUR	DE000ETF9082
Anteilwert	22,16	
Umlaufende Anteile	STK	3.910.000
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,40
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)		99,99
Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

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

Angaben für Indexfonds

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 (annualisiert)

0,08%

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.

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
I. Vermögensgegenstände		47.505.666,31	
1. Aktien		47.277.349,29	99,57
- Audiovisuelle Industrie	334.107,38		0,70
- Banken	4.971.692,75		10,47
- Bau und Baustoffe	1.919.114,09		4,04
- Bergbau	764.762,73		1,61
- Büroausstattung	351.808,45		0,74
- Chemische Industrie	2.233.274,60		4,70
- Einzelhandel	1.636.008,80		3,45
- Elektrik / Elektronik	2.779.774,25		5,85
- Energieversorger	3.958.241,63		8,34
- Freizeit/Tourismus	118.980,81		0,25
- Holdinggesellschaften	267.812,65		0,56
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	2.459.749,05		5,18
- Papier und andere Basisprodukte	425.683,70		0,90
- Papier- und Verpackungsindustrie	92.746,22		0,20
- Pharmaindustrie / Biotech	9.216.916,02		19,41
- Real Estate	638.438,07		1,34
- Software	798.638,91		1,68
- Sonstige Dienstleistungen	1.313.030,23		2,77
- Sonstige Finanzdienstleistungen	517.456,98		1,09
- Sonstige industrielle Werte	907.371,81		1,91
- Telekommunikation	1.700.404,76		3,58
- Textilien und Kleidung	1.757.901,10		3,70
- Transportation	647.765,48		1,36
- Unterhaltungsindustrie	238.331,47		0,50
- Verbrauchsgüter	4.352.927,10		9,17
- Versicherungen	2.874.410,25		6,05
2. Forderungen		185.489,42	0,39
3. Bankguthaben		42.827,60	0,09
II. Verbindlichkeiten		-22.157,24	-0,05
III. Teilsondervermögen		47.483.509,07	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw.	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondervermögens
			Whg. in 1.000		im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	951	182	337	EUR 127,460	121.214,46	0,26
DE000A0WMPJ6	AI XTRON SE		STK	523	103	293	EUR 26,970	14.105,31	0,03
DE0008404005	Allianz SE		STK	2.372	438	662	EUR 200,900	476.534,80	1,00
DE0006766504	Aurubis AG		STK	528	17	0	EUR 76,360	40.318,08	0,08
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	5.837	1.207	1.631	EUR 48,325	282.073,03	0,59
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	1.929	458	604	EUR 83,380	160.840,02	0,34
DE0005158703	Bechtle AG		STK	498	0	0	EUR 33,060	16.463,88	0,03
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	555	146	202	EUR 107,200	59.496,00	0,13
DE000A1DAH00	Brenntag SE		STK	876	286	349	EUR 59,720	52.314,72	0,11
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	195	96	88	EUR 117,900	22.990,50	0,05
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	5.555	1.388	2.421	EUR 8,836	49.083,98	0,10
DE0005439004	Continental AG		STK	594	194	257	EUR 55,980	33.252,12	0,07
DE0006062144	Covestro AG		STK	1.096	158	237	EUR 36,550	40.058,80	0,08
DE0007100000	Daimler AG		STK	4.670	932	1.276	EUR 61,400	286.738,00	0,60
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG		STK	2.510	2.510	0	EUR 28,945	72.651,95	0,15
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	11.723	1.610	2.768	EUR 10,588	124.123,12	0,26
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	1.110	248	318	EUR 161,400	179.154,00	0,38
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	3.390	2.065	2.046	EUR 7,765	26.323,35	0,06
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	5.755	1.301	1.650	EUR 35,180	202.460,90	0,43
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	20.510	4.370	5.899	EUR 18,638	382.265,38	0,81
DE0006095003	ENCAVIS AG		STK	593	593	0	EUR 18,485	10.961,61	0,02
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	1.221	0	0	EUR 17,935	21.898,64	0,05
DE0005664809	Evotec SE		STK	553	553	0	EUR 15,260	8.438,78	0,02
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	1.046	337	499	EUR 30,570	31.976,22	0,07
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA		STK	2.272	626	935	EUR 26,250	59.640,00	0,13
DE0006602006	GEA Group AG		STK	872	180	289	EUR 38,200	33.310,40	0,07
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	351	52	66	EUR 185,500	65.110,50	0,14
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	821	320	404	EUR 53,280	43.742,88	0,09
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	891	252	444	EUR 65,020	57.932,82	0,12
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG		STK	348	233	157	EUR 54,160	18.847,68	0,04
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	7.631	1.252	1.720	EUR 28,430	216.949,33	0,46
DE000KGX8881	KION GROUP AG		STK	437	0	0	EUR 26,770	11.698,49	0,02
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	296	114	153	EUR 51,040	15.107,84	0,03
DE0005470405	LANXESS AG		STK	497	0	0	EUR 37,700	18.736,90	0,04
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	420	0	23	EUR 60,860	25.561,20	0,05
DE0006599905	Merck KGaA		STK	781	159	219	EUR 180,900	141.282,90	0,30
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	819	167	218	EUR 304,000	248.976,00	0,52
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	869	155	217	EUR 51,240	44.527,56	0,09
DE0006969603	PUMA SE		STK	595	249	219	EUR 56,700	33.736,50	0,07
DE0007164600	SAP SE		STK	6.026	1.114	2.003	EUR 96,390	580.846,14	1,22
DE0007165631	Sartorius AG		STK	138	18	30	EUR 369,400	50.977,20	0,11
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	398	67	149	EUR 46,930	18.678,14	0,04
DE0007236101	Siemens AG		STK	4.354	971	1.388	EUR 129,640	564.452,56	1,19
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	2.756	1.803	1.711	EUR 17,575	48.436,70	0,10
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	1.675	318	496	EUR 46,730	78.272,75	0,16
DE000SYM9999	Symrise AG		STK	779	148	203	EUR 101,650	79.185,35	0,17
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	3.558	0	2.058	EUR 2,303	8.194,07	0,02
DE0007500001	thyssenkrupp AG		STK	2.918	0	0	EUR 5,696	16.620,93	0,04
DE0005089031	United Internet AG		STK	386	309	540	EUR 18,890	7.291,54	0,02
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	1.243	350	290	EUR 116,420	144.710,06	0,30
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	4.069	674	1.086	EUR 22,020	89.599,38	0,19
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG		STK	102	122	130	EUR 119,400	12.178,80	0,03
DE000ZAL1111	Zalando SE		STK	1.237	509	595	EUR 33,110	40.957,07	0,09
							EUR	5.491.299,34	11,56
Ausland									
GB00B1YW4409	3i Group PLC		STK	5.539	725	1.306	GBP 13,415	83.748,31	0,18
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S		STK	30	7	13	DKK 15.620,000	63.013,94	0,13
IT0001233417	A2A S.p.A.		STK	9.525	0	0	EUR 1,245	11.858,63	0,02
SE0011337708	AAK AB		STK	765	173	194	SEK 177,850	12.234,91	0,03
NL0000852564	Aalberts N.V.		STK	504	123	244	EUR 36,230	18.259,92	0,04
CH0012221716	ABB Ltd.		STK	9.475	2.326	2.713	CHF 28,060	269.247,56	0,57
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V.		STK	2.628	1.453	1.306	EUR 12,925	33.966,90	0,07
ES0125220311	Acciona S.A.		STK	140	32	42	EUR 171,900	24.066,00	0,05
FR0000120404	ACCOR S.A.		STK	1.106	0	0	EUR 23,350	25.825,10	0,05
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA		STK	1.305	355	511	EUR 26,770	34.934,85	0,07
SE0014781795	Addtech AB		STK	1.174	655	1.108	SEK 148,700	15.698,73	0,03
CH0012138605	Adecco Group AG		STK	885	141	279	CHF 30,460	27.299,71	0,06
BE0003851681	Aedifica S.A.		STK	174	21	77	EUR 75,800	13.189,20	0,03
BE6336384530	Aedifica S.A. - Anrechte		STK	230	0	0	EUR 0,000	0,00	0,00

NL0000303709	AEGON N.V.	STK	9.690	4.675	6.023	EUR	4,738	45.911,22	0,10
ES0105046009	Aena SME S.A.	STK	394	0	53	EUR	117,300	46.216,20	0,10
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.	STK	170	0	0	EUR	125,200	21.284,00	0,04
BE0974264930	AGEAS SA/NV	STK	1.008	346	337	EUR	41,420	41.751,36	0,09
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK	5.634	969	1.834	EUR	26,840	151.216,56	0,32
IE00BF0L3536	AIB Group PLC	STK	6.735	6.735	0	EUR	3,616	24.353,76	0,05
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.CI.	STK	3.093	3.119	26	EUR	132,400	409.513,20	0,86
NO0010345853	Aker BP ASA	STK	1.670	1.250	371	NOK	304,100	48.304,28	0,10
NL0013267909	Akzo Nobel N.V.	STK	1.030	289	398	EUR	62,560	64.436,80	0,14
CH0432492467	Alcon AG	STK	2.920	551	709	CHF	63,180	186.830,32	0,39
SE0000695876	Alfa Laval AB	STK	1.655	243	396	SEK	301,100	44.811,99	0,09
NL0012817175	Alfen N.V.	STK	123	123	0	EUR	84,200	10.356,60	0,02
DK0061802139	ALK-Abelló AS	STK	755	614	424	DKK	96,050	9.571,66	0,02
FR0010220475	Alstom S.A.	STK	1.816	393	453	EUR	22,820	41.441,12	0,09
FR0000071946	Alten S.A.	STK	178	0	0	EUR	116,800	20.790,40	0,04
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK	2.555	365	582	EUR	48,550	124.045,25	0,26
DK0060946788	Ambu A/S	STK	983	1.116	1.215	DKK	89,000	11.764,62	0,02
IT0004056880	Amplifon S.p.A.	STK	742	742	0	EUR	27,820	20.642,44	0,04
AT0000A18XM4	ams AG	STK	1.222	358	371	CHF	6,750	8.353,33	0,02
FR0004125920	Amundi S.A.	STK	323	37	91	EUR	53,000	17.119,00	0,04
AT0000730007	Andritz AG	STK	325	338	461	EUR	53,550	17.403,75	0,04
GB00B1XZS820	Anglo American PLC	STK	8.028	2.328	2.834	GBP	32,365	292.844,43	0,62
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	STK	5.295	1.136	1.520	EUR	56,270	297.949,65	0,63
GB0000456144	Antofagasta PLC	STK	3.882	2.126	2.336	GBP	15,455	67.620,52	0,14
NL0006237562	Arcadis N.V.	STK	451	0	0	EUR	36,700	16.551,70	0,03
LU1598757687	ArcelorMittal S.A.	STK	3.882	624	1.305	EUR	24,575	95.400,15	0,20
FR0010313833	Arkema S.A.	STK	333	68	136	EUR	83,880	27.932,04	0,06
LU1673108939	Aroundtown SA	STK	5.662	0	0	EUR	2,183	12.360,15	0,03
GB0000536739	Ashtead Group PLC	STK	2.738	566	794	GBP	47,200	145.656,35	0,31
NL0000334118	ASM International N.V.	STK	258	49	85	EUR	235,650	60.797,70	0,13
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	2.363	460	665	EUR	503,800	1.190.479,40	2,51
NL0011872643	ASR Nederland N.V.	STK	876	596	559	EUR	44,350	38.850,60	0,08
SE0007100581	Assa-Abloy AB	STK	5.622	896	1.443	SEK	223,700	113.094,71	0,24
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK	6.578	1.242	1.381	EUR	16,615	109.293,47	0,23
GB00BVBGWW93	Assura PLC	STK	24.902	36.612	11.710	GBP	0,546	15.310,27	0,03
GB0009895292	AstraZeneca PLC	STK	9.090	1.833	2.534	GBP	112,180	1.149.299,75	2,42
SE0017486889	Atlas Copco AB	STK	15.064	2.796	3.744	SEK	123,100	166.756,90	0,35
GB00BBG9VN75	AVEVA Group PLC	STK	850	850	0	GBP	32,130	30.781,07	0,06
GB00BPQY8M80	Aviva PLC	STK	16.448	1.518	3.646	GBP	4,428	82.087,06	0,17
FR0000120628	AXA S.A.	STK	11.804	2.660	3.467	EUR	26,055	307.553,22	0,65
SE0006993770	Axfood AB	STK	633	191	238	SEK	285,900	16.274,34	0,03
GB0000961622	Balfour Beatty PLC	STK	4.675	5.289	614	GBP	3,376	17.788,45	0,04
CH0012410517	Báloise Holding AG	STK	268	141	129	CHF	142,700	38.729,66	0,08
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK	35.237	6.792	10.445	EUR	5,634	198.525,26	0,42
IT0005218380	Banco BPM S.p.A.	STK	8.854	8.854	0	EUR	3,334	29.519,24	0,06
ES0113860A34	Banco de Sabadell S.A.	STK	34.215	0	0	EUR	0,881	30.136,57	0,06
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK	98.137	22.705	33.807	EUR	2,803	275.028,94	0,58
IE00BD1RP616	Bank of Ireland Group PLC	STK	6.254	880	539	EUR	8,900	55.660,60	0,12
ES0113679137	Bankinter S.A.	STK	3.908	0	0	EUR	6,268	24.495,34	0,05
GB0031348658	Barclays PLC	STK	90.351	18.837	30.112	GBP	1,585	161.425,09	0,34
GB0000811801	Barratt Developments PLC	STK	6.173	0	962	GBP	3,968	27.607,17	0,06
CH0009002962	Barry Callebaut AG	STK	21	6	5	CHF	1.829,000	38.897,16	0,08
NL0012866412	BE Semiconductor Inds N.V.	STK	460	117	118	EUR	56,560	26.017,60	0,05
GB00BYQ0JC66	Beazley PLC	STK	3.800	1.185	1.213	GBP	6,795	29.102,28	0,06
CH1101098163	BELIMO Holding AG	STK	53	30	37	CHF	440,000	23.616,39	0,05
GB0000904986	Bellway PLC	STK	815	65	0	GBP	19,075	17.521,70	0,04
GB00BLJNL82	Berkeley Group Holdings PLC	STK	668	59	74	GBP	37,730	28.406,47	0,06
GB0002869419	Big Yellow Group PLC	STK	1.373	316	373	GBP	11,470	17.749,57	0,04
SE0000862997	BillerudKorsnäs AB	STK	2.352	1.091	628	SEK	127,100	26.882,42	0,06
FR0013280286	bioMerieux	STK	296	0	0	EUR	97,920	28.984,32	0,06
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK	6.738	1.541	2.047	EUR	53,250	358.798,50	0,76
SE0017768716	Boliden AB	STK	2.356	579	719	SEK	391,250	82.892,47	0,17
FR0000039299	Bolloré S.A.	STK	5.463	0	0	EUR	5,220	28.516,86	0,06
FR0000120503	Bouygues S.A.	STK	1.611	207	403	EUR	28,040	45.172,44	0,10
GB0007980591	BP PLC	STK	107.199	19.733	35.342	GBP	4,749	573.781,97	1,21
GB0001367019	British Land Co. PLC, The	STK	6.121	1.356	1.374	GBP	3,951	27.257,33	0,06
GB00B0N8QD54	Britvic PLC	STK	1.866	905	665	GBP	7,770	16.341,30	0,03
GB0030913577	BT Group PLC	STK	44.477	12.860	14.552	GBP	1,121	56.169,60	0,12
GB00B0744B38	Bunzl PLC	STK	2.117	464	600	GBP	27,590	65.830,41	0,14
GB0031743007	Burberry Group PLC	STK	2.298	0	452	GBP	20,300	52.577,51	0,11
FR0006174348	Bureau Veritas SA	STK	1.703	309	382	EUR	24,610	41.910,83	0,09
ES0140609019	Caixabank S.A.	STK	22.458	3.398	7.774	EUR	3,672	82.465,78	0,17
FR0000125338	Caggemini SE	STK	1.007	185	240	EUR	155,950	157.041,65	0,33
FR0000120172	Carrefour S.A.	STK	3.288	386	816	EUR	15,640	51.424,32	0,11
SE0000379190	Castellum AB	STK	1.266	693	1.266	SEK	126,250	14.373,10	0,03
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A.	STK	3.304	676	696	EUR	30,920	102.159,68	0,22
CH0225173167	Cembra Money Bank AG	STK	175	175	0	CHF	76,900	13.628,54	0,03

GB00B033F229	Centrica PLC	STK	34.334	2.904	9.971	GBP	0,965	37.350,44	0,08
CH0010570767	Chocoladef. Lindt & Sprüngli	STK	6	6	0	CHF	9.430,000	57.299,10	0,12
DK0060227585	Christian Hansen Holding AS	STK	622	34	122	DKK	499,700	41.795,94	0,09
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	STK	3.089	669	897	CHF	119,900	375.078,33	0,79
FR001400AJ45	Cie Génle Éts Michelin SCPA	STK	4.051	669	1.100	EUR	25,985	105.265,24	0,22
CH0012142631	Clariant AG	STK	1.431	847	784	CHF	14,650	21.230,59	0,04
NL0010545661	CNH Industrial N.V.	STK	6.064	650	872	EUR	14,965	90.747,76	0,19
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG	STK	1.281	354	298	GBP	19,730	28.485,92	0,06
BE0003593044	Cofinimmo S.A.	STK	156	0	25	EUR	83,700	13.057,20	0,03
DK0060448595	Coloplast AS	STK	747	187	187	DKK	812,000	81.566,34	0,17
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.	STK	2.950	388	676	EUR	45,650	134.667,50	0,28
GB00BD6K4575	Compass Group PLC	STK	10.648	2.148	2.985	GBP	19,175	230.121,61	0,48
GB00BV9FP302	Computacenter PLC	STK	658	658	0	GBP	19,110	14.172,31	0,03
GB00BD3VFW73	ConvaTec Group PLC	STK	9.492	1.020	3.657	GBP	2,326	24.884,07	0,05
FR0000064578	Covivio S.A.	STK	286	0	0	EUR	55,450	15.858,70	0,03
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.	STK	7.224	1.968	3.287	EUR	9,831	71.019,14	0,15
CH0012138530	Credit Suisse Group AG	STK	19.414	9.648	5.743	CHF	2,764	54.342,30	0,11
IE0001827041	CRH PLC	STK	4.524	841	1.339	EUR	37,010	167.433,24	0,35
GB00BJFFLV09	Croda International PLC	STK	894	189	254	GBP	66,040	66.542,42	0,14
FR0000120644	Danone S.A.	STK	3.736	821	1.095	EUR	49,230	183.923,28	0,39
DK0010274414	Danske Bank AS	STK	4.133	313	660	DKK	137,300	76.308,04	0,16
FR0014003TT8	Dassault Systemes SE	STK	4.177	944	1.333	EUR	33,495	139.908,62	0,29
NL0015435975	Davide Campari-Milano N.V.	STK	2.971	559	846	EUR	9,484	28.176,96	0,06
IE0002424939	DCC PLC	STK	612	59	139	GBP	40,800	28.142,69	0,06
GB0009633180	Dechra Pharmaceuticals PLC	STK	684	117	237	GBP	26,180	20.182,72	0,04
DK0060738599	Demant AS	STK	587	0	149	DKK	192,550	15.199,03	0,03
GB0002652740	Derwent London PLC	STK	746	213	250	GBP	23,680	19.910,15	0,04
GB0002374006	Diageo PLC	STK	13.398	2.733	3.852	GBP	36,500	551.171,60	1,16
BE0974259880	D'leteren Group S.A.	STK	125	149	171	EUR	179,200	22.400,00	0,05
GB0001826634	Diploma PLC	STK	776	286	278	GBP	27,760	24.279,24	0,05
CH0126673539	DKSH Holding AG	STK	144	57	138	CHF	70,200	10.237,28	0,02
NO0010161896	DNB Bank ASA	STK	5.066	1.254	1.782	NOK	194,450	93.697,03	0,20
GB0008220112	DS Smith PLC	STK	8.481	435	1.781	GBP	3,215	30.731,38	0,06
DK0060079531	DSV Panalpina A/S	STK	1.062	217	398	DKK	1.096,500	156.591,25	0,33
FR0010908533	Edenred S.A.	STK	1.458	346	406	EUR	50,880	74.183,04	0,16
ES0127797019	EDP Renováveis S.A.	STK	1.363	536	634	EUR	20,580	28.050,54	0,06
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	556	80	128	EUR	91,920	51.107,52	0,11
FR0010242511	Electricité de France (E.D.F.)	STK	3.523	510	581	EUR	12,000	42.276,00	0,09
GB0003096442	Electrocomponents PLC	STK	2.851	155	643	GBP	8,955	28.775,10	0,06
SE0016589188	Electrolux, AB	STK	982	306	371	SEK	140,780	12.431,91	0,03
SE0000163628	Elekta AB	STK	1.296	275	564	SEK	62,800	7.318,97	0,02
BE0003822393	Elia Group	STK	160	52	74	EUR	132,800	21.248,00	0,04
FR0012435121	Elis S.A.	STK	1.142	0	0	EUR	13,820	15.782,44	0,03
FI0009007884	Elisa Oyj	STK	854	251	248	EUR	49,460	42.238,84	0,09
ES0130960018	Enagas S.A.	STK	1.434	0	0	EUR	15,525	22.262,85	0,05
GB00BG12Y042	Energie PLC	STK	1.130	1.130	0	GBP	13,090	16.671,40	0,04
FR0010208488	Engie S.A.	STK	10.866	2.056	2.646	EUR	13,388	145.474,01	0,31
IT0003132476	ENI S.p.A.	STK	14.449	2.961	4.111	EUR	13,286	191.969,41	0,40
IM00B5VQMV65	Entain PLC	STK	3.751	790	909	GBP	13,215	55.868,66	0,12
SE0015658109	Epiroc AB	STK	3.567	476	875	SEK	189,850	60.897,46	0,13
SE0012853455	EQT AB	STK	4.428	1.299	1.079	SEK	220,600	87.841,26	0,18
NO0010096985	Equinor ASA	STK	6.123	1.184	1.930	NOK	351,800	204.886,23	0,43
AT0000652011	Erste Group Bank AG	STK	1.736	516	693	EUR	29,900	51.906,40	0,11
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK	1.803	356	473	EUR	169,200	305.067,60	0,64
SE0009922164	Essity AB	STK	3.418	689	1.074	SEK	273,300	84.003,45	0,18
FR0000121121	Eurazeo SE	STK	345	30	0	EUR	58,100	20.044,50	0,04
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E.	STK	683	55	169	EUR	67,060	45.801,98	0,10
NL0006294274	Euronext N.V.	STK	486	0	0	EUR	69,160	33.611,76	0,07
GB00B19NLV48	Experian PLC	STK	5.526	1.172	1.607	GBP	28,130	175.200,20	0,37
SE0011166974	Fabege AB	STK	1.056	547	921	SEK	88,700	8.423,12	0,02
SE0017832488	Fastighets AB Balder	STK	2.851	0	1.175	SEK	48,520	12.439,52	0,03
FR0000121147	Faurecia SE	STK	1.030	0	0	EUR	14,130	14.553,90	0,03
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC	STK	1.255	326	465	GBP	104,400	147.672,02	0,31
NL0011585146	Ferrari N.V.	STK	677	164	235	EUR	200,200	135.535,40	0,29
ES0118900010	Ferrovial S.A.	STK	3.060	244	480	EUR	24,470	74.878,20	0,16
IT0000072170	FincoBank Banca Fineco S.p.A.	STK	3.358	483	834	EUR	15,520	52.116,16	0,11
PTGALOAM0009	Galp Energia SGPS S.A.	STK	2.697	1.765	2.245	EUR	12,610	34.009,17	0,07
FR0011726835	Gaztransport Technigaz	STK	185	115	72	EUR	99,800	18.463,00	0,04
CH0030170408	Geberit AG	STK	203	29	47	CHF	435,500	89.530,10	0,19
FR0010040865	Gecina S.A.	STK	288	0	0	EUR	95,150	27.403,20	0,06
CH1169151003	Georg Fischer AG	STK	394	230	336	CHF	56,600	22.583,83	0,05
SE000202624	Getinge AB	STK	1.145	250	429	SEK	216,300	22.271,40	0,05
FR0010533075	Getlink SE	STK	2.027	543	1.172	EUR	14,975	30.354,33	0,06
CH0010645932	Givaudan SA	STK	46	9	12	CHF	2.833,000	131.974,28	0,28
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA	STK	1.210	62	0	NOK	192,200	22.120,32	0,05
IE0000669501	Glanbia PLC	STK	1.150	1.150	1.210	EUR	11,920	13.708,00	0,03
DK0010272632	GN Store Nord AS	STK	446	631	983	DKK	159,750	9.580,98	0,02

IE00B00MZ448	Grafton Group PLC	STK	1.470	1.169	1.039	GBP	7,886	13.065,56	0,03
GB00B63QSB39	Greggs PLC	STK	619	0	0	GBP	23,460	16.367,13	0,03
ES0171996087	Grifols S.A.	STK	1.785	0	0	EUR	10,770	19.224,45	0,04
BE0003797140	Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL)	STK	555	358	403	EUR	74,580	41.391,90	0,09
GB00BN7SWP63	GSK PLC	STK	24.051	30.152	6.101	GBP	14,376	389.695,33	0,82
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB	STK	3.711	443	1.373	SEK	112,240	37.456,23	0,08
NL0000008977	Heineken Holding N.V.	STK	574	208	249	EUR	72,050	41.356,70	0,09
NL0000009165	Heineken N.V.	STK	1.445	308	414	EUR	87,880	126.986,60	0,27
CH0466642201	Helvetia Holding AG	STK	204	119	90	CHF	107,800	22.270,70	0,05
IT0001250932	Hera S.p.A.	STK	4.900	0	0	EUR	2,519	12.343,10	0,03
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK	203	36	58	EUR	1.445,000	293.335,00	0,62
SE0015961909	Hexagon AB	STK	12.075	1.995	3.163	SEK	109,000	118.358,40	0,25
GB00BOLCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC	STK	978	131	420	GBP	15,520	17.107,42	0,04
BMG4593F1389	Hiscox Ltd.	STK	2.247	2.247	0	GBP	10,895	27.592,08	0,06
CH0012214059	Holcim Ltd.	STK	3.200	459	737	CHF	47,880	155.163,30	0,33
SE0011090018	Holmen AB	STK	1.232	306	338	SEK	413,900	45.855,52	0,10
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK	119.400	24.512	34.147	GBP	5,157	693.993,58	1,46
FI0009000459	Huhtamäki Oyj	STK	468	195	194	EUR	32,000	14.976,00	0,03
SE0001662230	Husqvarna AB	STK	1.727	1.029	1.278	SEK	73,120	11.355,70	0,02
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	34.381	7.288	10.400	EUR	10,930	375.784,33	0,79
NL0010801007	IMCD N.V.	STK	324	35	58	EUR	133,150	43.140,60	0,09
GB00BLP8L22	IMI PLC	STK	1.629	586	542	GBP	12,880	23.647,81	0,05
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK	6.688	1.421	1.950	EUR	24,850	166.196,80	0,35
SE0000107203	Industrivärden AB	STK	1.020	1.020	0	SEK	253,000	23.206,31	0,05
SE0001515552	Indutrade AB	STK	1.625	0	0	SEK	211,100	30.848,00	0,06
GB00BMJ6DW54	Informa PLC	STK	8.351	559	2.137	GBP	6,196	58.318,17	0,12
IT0005090300	Infrastrutt. Wireless Italiane	STK	2.139	0	0	EUR	9,414	20.136,55	0,04
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK	21.368	2.986	5.840	EUR	11,388	243.338,78	0,51
ES0139140174	Inmobiliaria Colonial SOCIMI	STK	1.818	0	0	EUR	6,010	10.926,18	0,02
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group	STK	1.090	173	311	GBP	47,440	58.280,76	0,12
GB00BYT1DJ19	Intermediate Capital Grp PLC	STK	2.019	875	801	GBP	11,480	26.123,55	0,06
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA	STK	15.475	6.341	5.981	GBP	1,238	21.599,59	0,05
IT0001078911	Interpump Group S.p.A.	STK	502	0	0	EUR	42,160	21.164,32	0,04
GB0031638363	Intertek Group PLC	STK	1.048	181	204	GBP	40,340	47.648,71	0,10
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK	98.400	15.892	29.870	EUR	2,078	204.475,20	0,43
GB00B17BBQ50	Investec PLC	STK	4.352	907	1.254	GBP	5,114	25.084,40	0,05
SE0015811963	Investor AB	STK	10.646	2.111	2.771	SEK	188,560	180.518,40	0,38
FR0010259150	Ipsen S.A.	STK	164	1	65	EUR	100,500	16.482,00	0,03
DK0060542181	ISS AS	STK	821	685	767	DKK	147,300	16.262,24	0,03
IT0005211237	Italgas S.P.A.	STK	2.781	1.045	1.242	EUR	5,190	14.433,39	0,03
GB0033986497	ITV PLC	STK	24.021	0	4.479	GBP	0,752	20.348,47	0,04
GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC	STK	17.998	4.460	1.551	GBP	1,262	25.589,72	0,05
NL0014332678	JDE Peet's N.V.	STK	682	682	0	EUR	27,020	18.427,64	0,04
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.	STK	1.613	902	967	EUR	20,180	32.550,34	0,07
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC	STK	1.241	286	406	GBP	21,270	29.750,43	0,06
DK0010307958	Jyske Bank A/S	STK	265	265	0	DKK	451,300	16.082,20	0,03
BE0003565737	KBC Groep N.V.	STK	1.384	222	473	EUR	60,080	83.150,72	0,18
FR0000121485	Kering S.A.	STK	421	75	119	EUR	475,500	200.185,50	0,42
IE0004906560	Kerry Group PLC	STK	887	125	202	EUR	84,240	74.720,88	0,16
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	1.596	688	582	EUR	20,620	32.909,52	0,07
SE0007871645	Kindred Group PLC	STK	875	158	166	SEK	108,600	8.545,22	0,02
GB0033195214	Kingfisher PLC	STK	11.549	2.521	3.671	GBP	2,361	30.732,25	0,06
IE0004927939	Kingspan Group PLC	STK	839	0	129	EUR	50,580	42.436,62	0,09
SE0015810247	Kinnevik AB	STK	1.065	171	620	SEK	143,200	13.714,44	0,03
FR0000121964	Klépierre S.A.	STK	962	176	483	EUR	21,530	20.711,86	0,04
FI4000312251	Kojamo Oyj	STK	931	564	548	EUR	13,800	12.847,80	0,03
NL0000009082	Kon. KPN N.V.	STK	19.303	3.413	4.936	EUR	2,890	55.785,67	0,12
FI0009013403	KONE Oyj	STK	2.280	385	628	EUR	48,300	110.124,00	0,23
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.	STK	991	197	283	EUR	114,300	113.271,30	0,24
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK	5.044	1.013	1.472	EUR	14,004	70.636,18	0,15
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG	STK	322	58	91	CHF	215,200	70.175,10	0,15
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX	STK	693	0	0	EUR	37,580	26.042,94	0,05
GB00BYW0PQ60	Land Securities Group PLC	STK	4.560	966	1.169	GBP	6,214	31.936,70	0,07
GB0005603997	Legal & General Group PLC	STK	36.569	8.239	10.308	GBP	2,495	102.834,22	0,22
FR0010307819	Legrand S.A.	STK	1.507	261	402	EUR	74,820	112.753,74	0,24
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	2.894	567	837	EUR	305,450	883.972,30	1,86
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK	402.155	77.649	119.950	GBP	0,454	205.825,40	0,43
CH0025751329	Logitech International S.A.	STK	876	292	469	CHF	57,060	50.619,84	0,11
GB00B0SWJX34	London Stock Exchange Group PLC	STK	2.121	431	568	GBP	71,360	170.588,40	0,36
GB00B4WFW713	Londonmetric Property PLC	STK	7.785	2.397	1.920	GBP	1,723	15.118,13	0,03
CH0013841017	Lonza Group AG	STK	435	92	116	CHF	453,100	199.603,52	0,42
BE0003604155	Lotus Bakeries S.A.	STK	2	2	0	EUR	6.320,000	12.640,00	0,03
PLLPP0000011	LPP S.A.	STK	7	0	0	PLN	10.650,000	15.925,23	0,03
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK	1.531	311	440	EUR	679,900	1.040.926,90	2,19
GB00BKFB1C65	M&G PLC	STK	14.864	0	3.067	GBP	1,879	31.470,30	0,07
JE00BJ1DLW90	Man Group Ltd.	STK	9.302	4.022	3.231	GBP	2,137	22.404,47	0,05

GB0031274896	Marks & Spencer Group PLC	STK	11.908	0	0	GBP	1,233	16.548,39	0,03
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA	STK	3.161	1.694	2.257	EUR	8,984	28.398,42	0,06
ES0105025003	Merlin Properties SOCIMI S.A.	STK	2.041	0	0	EUR	8,775	17.909,78	0,04
FI0009014575	Metso Outotec Oyj	STK	3.637	1.516	2.015	EUR	9,612	34.958,84	0,07
SE0001174970	Millicom Intl Cellular S.A.	STK	627	147	603	SEK	132,150	7.451,10	0,02
IT0004965148	Moncler S.p.A.	STK	1.183	317	467	EUR	49,500	58.558,50	0,12
GB00B1CRLC47	Mondi PLC	STK	2.678	262	682	GBP	14,095	42.543,15	0,09
NO0003054108	Mowi ASA	STK	2.674	713	802	NOK	167,200	42.525,59	0,09
GB00BDR05C01	National Grid PLC	STK	21.800	4.557	5.876	GBP	9,974	245.064,19	0,52
ES0116870314	Naturgy Energy Group S.A.	STK	966	0	222	EUR	24,310	23.483,46	0,05
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC	STK	32.286	42.338	10.052	GBP	2,652	96.503,21	0,20
SE0005034550	Neobo Fastigheter AB	STK	405	405	0	SEK	19,550	712,01	0,00
FI0009013296	Neste Oyj	STK	2.434	561	776	EUR	43,020	104.710,68	0,22
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	16.110	3.268	4.917	CHF	107,140	1.747.962,33	3,68
FR0000044448	Nexans S.A.	STK	185	70	0	EUR	84,450	15.623,25	0,03
IT0005366767	Nexi S.p.A.	STK	3.791	724	1.198	EUR	7,366	27.924,51	0,06
GB0032089863	NEXT PLC	STK	729	0	155	GBP	58,060	47.704,41	0,10
SE0015988019	NIBE Industrier AB	STK	8.720	1.565	1.980	SEK	97,100	76.141,45	0,16
GB00B7FC0762	NMC HEALTH PLC	STK	261	0	0	GBP	0,000	0,00	0,00
NL0010773842	NN Group N.V.	STK	1.468	604	872	EUR	38,160	56.018,88	0,12
FI0009000681	Nokia Oyj	STK	30.603	6.479	9.443	EUR	4,327	132.419,18	0,28
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK	20.990	4.923	7.776	EUR	10,030	210.529,70	0,44
NO0003055501	Nordic Semiconductor ASA	STK	740	497	854	NOK	163,900	11.536,22	0,02
NO0005052605	Norsk Hydro ASA	STK	12.250	2.774	3.625	NOK	73,320	85.430,16	0,18
CH0012005267	Novartis AG	STK	13.099	2.535	4.586	CHF	83,590	1.108.861,62	2,34
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	9.622	1.924	2.622	DKK	938,000	1.213.675,34	2,56
DK0060336014	Novozymes A/S	STK	1.322	155	158	DKK	351,900	62.558,32	0,13
GB00B3MBS747	Ocado Group PLC	STK	3.547	3.547	0	GBP	6,168	24.658,10	0,05
NL0010558797	OCI N.V.	STK	621	0	0	EUR	33,420	20.753,82	0,04
AT0000743059	OMV AG	STK	798	321	456	EUR	48,100	38.383,80	0,08
FR0000133308	Orange S.A.	STK	11.625	2.325	3.327	EUR	9,281	107.891,63	0,23
FR0000120321	Oréal S.A., L'	STK	1.436	298	403	EUR	333,600	479.049,60	1,01
FI0009014377	Orion Corp.	STK	529	194	203	EUR	51,240	27.105,96	0,06
NO0003733800	Orkla ASA	STK	4.496	988	1.060	NOK	70,940	30.336,83	0,06
DK0060252690	Pandora A/S	STK	542	249	359	DKK	488,100	35.574,80	0,07
CH0024608827	Partners Group Holding AG	STK	129	28	39	CHF	816,800	106.706,36	0,22
GB0006776081	Pearson PLC	STK	4.251	297	1.236	GBP	9,392	44.999,03	0,09
GB00BNNTLN49	Pennon Group PLC	STK	1.687	0	371	GBP	8,885	16.893,77	0,04
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	1.172	264	356	EUR	183,750	215.355,00	0,45
GB00BGXQNP29	Phoenix Group Holdings PLC	STK	5.057	0	960	GBP	6,086	34.687,97	0,07
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.	STK	2.838	0	0	EUR	9,126	25.899,59	0,05
PLPZU0000011	Powszechny Zakład Ubezpieczeni	STK	3.223	963	1.461	PLN	35,420	24.386,36	0,05
NL0013654783	Prosus N.V.	STK	4.992	920	1.638	EUR	64,450	321.734,40	0,68
GB0007099541	Prudential PLC	STK	16.454	3.380	4.660	GBP	11,275	209.094,22	0,44
IT0004176001	Prysmian S.p.A.	STK	1.521	222	331	EUR	34,660	52.717,86	0,11
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK	1.337	204	330	EUR	59,420	79.444,54	0,17
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	1.349	551	534	EUR	47,010	63.416,49	0,13
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	709	132	221	EUR	56,960	40.384,64	0,09
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	4.375	917	1.246	GBP	57,540	283.727,81	0,60
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA	STK	559	0	73	EUR	38,750	21.661,25	0,05
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	2.371	431	600	EUR	16,260	38.552,46	0,08
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	11.669	2.452	3.323	GBP	22,880	300.914,87	0,63
FR0000130395	Rémy Cointreau S.A.	STK	138	0	0	EUR	157,600	21.748,80	0,05
FR0000131906	Renault S.A.	STK	1.209	181	231	EUR	31,275	37.811,48	0,08
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC	STK	15.365	6.325	3.307	GBP	5,080	87.973,18	0,19
IT0005282865	Reply S.p.A.	STK	141	0	0	EUR	107,000	15.087,00	0,03
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	8.238	1.166	1.830	EUR	14,850	122.334,30	0,26
FR0010451203	Rexel S.A.	STK	1.435	482	532	EUR	18,440	26.461,40	0,06
DK0010219153	Rockwool International A/S	STK	58	27	22	DKK	1.633,000	12.736,45	0,03
GB00BVFNZH21	Rotork PLC	STK	5.367	1.527	1.388	GBP	3,066	18.546,32	0,04
GB00BDVZY77	Royal Mail PLC	STK	6.217	2.181	888	GBP	2,130	14.925,00	0,03
DK0060634707	Royal Unibrew AS	STK	181	79	158	DKK	495,300	12.055,39	0,03
FR0013269123	Rubis S.C.A.	STK	589	0	0	EUR	24,600	14.489,40	0,03
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings PLC	STK	2.983	586	736	EUR	12,210	36.422,43	0,08
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.	STK	10.873	3.121	3.036	GBP	2,177	26.678,52	0,06
NO0010310956	Salmar ASA	STK	303	303	0	NOK	384,800	11.089,97	0,02
SE0009554454	Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB	STK	4.059	3.282	4.690	SEK	17,380	6.343,87	0,01
FI0009003305	Sampo OYJ	STK	2.921	729	1.053	EUR	48,820	142.603,22	0,30
SE0000667891	Sandvik AB	STK	6.149	1.065	1.683	SEK	188,400	104.176,76	0,22
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	6.715	1.308	1.808	EUR	89,840	603.275,60	1,27
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.	STK	141	23	29	EUR	302,500	42.652,50	0,09
CH0024638196	Schindler Holding AG	STK	231	32	49	CHF	173,900	40.681,45	0,09
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	3.372	769	1.022	EUR	130,720	440.787,84	0,93
GB00BP9LHF23	Schroders PLC	STK	5.985	5.985	0	GBP	4,360	29.410,65	0,06
FR0010411983	SCOR SE	STK	667	154	528	EUR	21,490	14.333,83	0,03
FR0000121709	SEB S.A.	STK	149	0	0	EUR	78,250	11.659,25	0,02
SE0000163594	Securitas AB	STK	2.944	3.791	2.351	SEK	86,960	23.021,99	0,05

GB00B5ZN1N88	Segro PLC	STK	7.501	2.171	2.229	GBP	7,636	64.556,37	0,14
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC	STK	1.436	82	369	GBP	26,510	42.906,01	0,09
CH0002497458	SGS S.A.	STK	34	6	9	CHF	2.150,000	74.029,06	0,16
CH0435377954	SIG Combibloc Services AG	STK	1.824	600	955	CHF	20,200	37.313,08	0,08
NL0011821392	Signify N.V.	STK	728	200	301	EUR	31,380	22.844,64	0,05
CH0418792922	Sika AG	STK	871	124	201	CHF	221,700	195.554,91	0,41
DK0060495240	SimCorp A/S	STK	215	36	67	DKK	478,200	13.825,55	0,03
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	9.656	1.564	2.648	SEK	119,950	104.155,68	0,22
SE0000113250	Skanska AB	STK	2.174	0	592	SEK	165,000	32.257,37	0,07
SE0000108227	SKF AB	STK	3.755	843	1.220	SEK	159,150	53.740,54	0,11
GB0009223206	Smith & Nephew PLC	STK	5.444	1.176	1.603	GBP	11,095	68.076,84	0,14
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC	STK	2.318	438	527	GBP	15,985	41.761,88	0,09
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC	STK	1.394	83	406	EUR	34,560	48.176,64	0,10
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	11.017	1.165	2.653	EUR	4,527	49.873,96	0,11
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	4.767	846	1.268	EUR	23,480	111.929,16	0,24
FR0000121220	Sodexo S.A.	STK	481	84	116	EUR	89,480	43.039,88	0,09
GB00BYZDVK82	Softcat PLC	STK	1.128	1.128	0	GBP	11,840	15.052,71	0,03
FR0013227113	Soitec S.A.	STK	153	0	0	EUR	152,850	23.386,05	0,05
BE0003470755	Solvay S.A.	STK	416	61	114	EUR	94,460	39.295,36	0,08
CH0012549785	Sonova Holding AG	STK	299	58	85	CHF	219,300	66.404,07	0,14
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A.	STK	97	0	0	EUR	141,200	13.696,40	0,03
GB0003308607	Spectris PLC	STK	671	208	240	GBP	30,020	22.703,21	0,05
FR0012757854	Spie S.A.	STK	922	0	0	EUR	24,360	22.459,92	0,05
GB00BWFQGN14	Spirax-Sarco Engineering PLC	STK	437	47	100	GBP	106,150	52.282,39	0,11
SE0000120669	SSAB AB	STK	9.264	5.698	6.179	SEK	54,200	45.152,65	0,10
GB0007908733	SSE PLC	STK	6.583	1.515	1.668	GBP	17,120	127.022,78	0,27
GB0007669376	St. James's Place PLC	STK	3.123	711	1.228	GBP	10,950	38.542,52	0,08
GB0004082847	Standard Chartered PLC	STK	14.689	2.818	4.286	GBP	6,224	103.042,37	0,22
GB00BF8Q6K64	Standard Life Aberdeen PLC	STK	12.483	8.824	9.601	GBP	1,893	26.626,18	0,06
NL00150001Q9	Stellantis N.V.	STK	14.012	3.214	3.251	EUR	13,264	185.855,17	0,39
NL0000226223	STMicronics N.V.	STK	3.860	728	938	EUR	33,005	127.399,30	0,27
FI0009005961	Stora Enso Oyj	STK	4.992	1.338	1.574	EUR	13,150	65.644,80	0,14
NO0003053605	Storebrand ASA	STK	2.157	1.214	2.011	NOK	85,400	17.521,07	0,04
CH1175448666	Straumann Holding AG	STK	664	133	189	CHF	105,600	71.009,57	0,15
LU0075646355	Subsea 7 S.A.	STK	1.345	1.345	0	NOK	113,050	14.462,57	0,03
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB	STK	5.475	1.896	1.724	SEK	131,950	64.964,93	0,14
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB	STK	8.681	1.822	2.798	SEK	105,100	82.046,10	0,17
CH0012255151	Swatch Group AG, The	STK	169	169	0	CHF	263,000	45.011,90	0,09
SE0014960373	Sweco AB	STK	679	579	781	SEK	99,850	6.096,82	0,01
SE0000242455	Swedbank AB	STK	5.223	609	1.216	SEK	177,300	83.274,92	0,18
SE0000872095	Swedish Orphan Biovitrum AB	STK	1.132	292	373	SEK	215,700	21.957,46	0,05
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	175	23	43	CHF	476,800	84.500,48	0,18
CH0008038389	Swiss Prime Site AG	STK	448	185	199	CHF	80,150	36.363,56	0,08
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	1.639	284	425	CHF	86,480	143.542,17	0,30
CH0008742519	Swisscom AG	STK	144	25	36	CHF	506,600	73.877,56	0,16
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC	STK	21.943	1.236	1.955	GBP	1,017	25.139,54	0,05
CH0012100191	Tecan Group AG	STK	63	29	28	CHF	412,400	26.311,41	0,06
SE0005190238	Tele2 AB	STK	3.005	632	673	SEK	85,100	22.996,38	0,05
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A.	STK	61.930	0	0	EUR	0,216	13.395,46	0,03
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics.	STK	17.427	3.283	4.984	SEK	60,900	95.438,89	0,20
ES0178430E18	Telefónica S.A.	STK	32.757	4.633	7.275	EUR	3,385	110.882,45	0,23
NO0010063308	Telenor ASA	STK	4.325	4.325	0	NOK	91,600	37.682,03	0,08
FR0000051807	Téléperformance SE	STK	335	63	90	EUR	222,700	74.604,50	0,16
SE0000667925	Telia Company AB	STK	13.378	1.396	3.063	SEK	26,660	32.072,79	0,07
CH0012453913	Temenos AG	STK	349	139	208	CHF	50,740	17.933,32	0,04
LU0156801721	Tenaris S.A.	STK	2.501	0	338	EUR	16,285	40.728,79	0,09
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA	STK	8.902	2.147	1.819	EUR	6,900	61.423,80	0,13
GB00BLGZ9862	Tesco PLC	STK	45.122	9.696	13.698	GBP	2,242	114.019,18	0,24
SE0006422390	Thule Group AB (publ)	STK	380	165	269	SEK	217,700	7.439,22	0,02
FI0009000277	TietoEVRY Oyj	STK	383	383	0	EUR	26,520	10.157,16	0,02
NO0012470089	Tomra Systems ASA	STK	1.491	269	288	NOK	165,600	23.485,01	0,05
DK0060477503	Topdanmark AS	STK	264	264	0	DKK	365,400	12.972,00	0,03
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	15.387	3.128	4.259	EUR	58,650	902.447,55	1,90
GB00BK9RKT01	Travis Perkins PLC	STK	1.370	232	230	GBP	8,894	13.733,20	0,03
SE0000114837	Trelleborg AB	STK	1.475	0	0	SEK	240,800	31.939,93	0,07
GB00BG49KP99	Tritax Big Box REIT PLC	STK	13.258	3.686	4.380	GBP	1,386	20.710,72	0,04
DK0060636678	Tryg AS	STK	2.085	48	264	DKK	165,350	46.360,12	0,10
FR0000054470	Ubisoft Entertainment S.A.	STK	581	581	0	EUR	26,410	15.344,21	0,03
CH0244767585	UBS Group AG	STK	18.643	3.570	6.002	CHF	17,205	324.829,43	0,68
BE0003739530	UCB S.A.	STK	709	108	193	EUR	73,560	52.154,04	0,11
BE0974320526	Umicore S.A.	STK	1.100	157	377	EUR	34,320	37.752,00	0,08
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE	STK	533	75	189	EUR	48,630	25.919,79	0,05
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	11.470	2.091	4.335	EUR	13,272	152.229,84	0,32
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	15.461	3.141	4.341	GBP	41,820	728.745,02	1,53
GB0006928617	Unite Group PLC	STK	2.377	673	585	GBP	9,100	24.379,49	0,05
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC	STK	3.894	221	863	GBP	9,914	43.510,98	0,09
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.	STK	3.768	386	769	EUR	34,930	131.616,24	0,28

FR0013176526	Valéo S.E.	STK	984	0	340	EUR	16,700	16.432,80	0,03
FI4000074984	Valmet Oyj	STK	797	358	418	EUR	25,160	20.052,52	0,04
FR0000124141	Veolia Environnement S.A.	STK	3.691	840	1.437	EUR	24,000	88.584,00	0,19
FR0013447729	Verallia SA	STK	307	307	0	EUR	31,680	9.725,76	0,02
AT0000746409	Verbund AG	STK	445	238	194	EUR	78,650	34.999,25	0,07
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS	STK	6.082	1.259	1.659	DKK	202,100	165.290,19	0,35
FR0000125486	VINCI S.A.	STK	3.345	692	933	EUR	93,290	312.055,05	0,66
GB00BD6GN030	Virgin Money UK PLC	STK	8.643	0	1.962	GBP	1,821	17.738,97	0,04
ES0184262212	Viscofan S.A.	STK	228	228	0	EUR	60,200	13.725,60	0,03
GB0001859296	Vistry Group PLC	STK	2.172	820	0	GBP	6,255	15.312,32	0,03
FR0000127771	Vivendi S.A.	STK	4.079	793	1.142	EUR	8,914	36.360,21	0,08
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC	STK	157.219	37.259	64.238	GBP	0,842	149.271,67	0,31
AT0000937503	voestalpine AG	STK	1.553	107	343	EUR	24,780	38.483,34	0,08
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	9.010	1.457	2.325	SEK	188,480	152.712,83	0,32
SE0016844831	Volvo Car AB	STK	3.040	1.009	846	SEK	47,380	12.952,51	0,03
SE0017780133	Wallenstam AB	STK	1.495	659	982	SEK	43,900	5.901,89	0,01
BE0974349814	Warehouses De Pauw N.V.	STK	930	189	73	EUR	26,700	24.831,00	0,05
FI0009003727	Wärtsilä Corp.	STK	2.382	799	901	EUR	7,868	18.741,58	0,04
GB00BJDQQ870	Watches Of Switzerland Group PLC	STK	1.273	1.901	628	GBP	8,205	11.772,30	0,02
GB0009465807	Weir Group PLC, The	STK	1.594	78	346	GBP	16,690	29.984,63	0,06
FR0000121204	Wendel SE	STK	103	46	109	EUR	87,200	8.981,60	0,02
GB00B1KJJ408	Whitbread PLC	STK	1.204	155	346	GBP	25,700	34.874,95	0,07
AT0000831706	Wienerberger AG	STK	527	581	775	EUR	22,560	11.889,12	0,03
SE0018012635	Wihlborgs Fastigheter AB	STK	960	625	715	SEK	78,500	6.776,83	0,01
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.	STK	1.489	273	418	EUR	97,760	145.564,64	0,31
FR0011981968	Worldline S.A.	STK	1.472	368	323	EUR	36,530	53.772,16	0,11
JE00B8KF9B49	WPP PLC	STK	6.295	388	1.200	GBP	8,202	58.192,83	0,12
NO0010208051	Yara International ASA	STK	1.066	220	270	NOK	430,600	43.660,02	0,09
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	889	178	242	CHF	442,300	398.202,14	0,84
						EUR		40.573.978,45	85,45
									0,00
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genuss-scheine	STK	4.120	824	1.141	CHF	290,500	1.212.071,50	2,55
						EUR		1.212.071,50	2,55
						EUR		47.277.349,29	99,57
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
	Verwahrstelle	EUR	29.971,95			%	100,000	29.971,95	0,06
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	Verwahrstelle	CHF	2.421,63			%	100,000	2.452,41	0,01
	Verwahrstelle	DKK	2.225,21			%	100,000	299,23	0,00
	Verwahrstelle	NOK	5.466,93			%	100,000	519,99	0,00
	Verwahrstelle	PLN	5.078,12			%	100,000	1.084,78	0,00
	Verwahrstelle	SEK	5.359,82			%	100,000	481,99	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	Verwahrstelle	GBP	4.104,64			%	100,000	4.626,25	0,01
	Verwahrstelle	USD	3.619,04			%	100,000	3.391,00	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Dividendenforderungen Aktien	EUR	26.319,68			EUR		185.489,42	0,39
	Dividendenforderungen Aktien	GBP	15.654,60					26.319,68	0,06
	Dividendenforderungen Aktien	SEK	2.424,11					17.643,96	0,04
	Dividendenforderungen Aktien	USD	925,50					217,99	0,00
	Dividendenforderungen REITS	EUR	354,72					867,18	0,00
	Dividendenforderungen REITS	GBP	1.187,54					354,72	0,00
	Quellensteuererstattungsansprüche	CHF	120.077,56					1.338,45	0,00
	Quellensteuererstattungsansprüche	DKK	62.284,37					121.603,69	0,26
	Quellensteuererstattungsansprüche	EUR	8.768,20					8.375,55	0,02
								8.768,20	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR	-22.157,24			EUR		-22.157,24	-0,05
								-22.157,24	-0,05
Wert des Teilsondervermögens									
Anteilwert									
Umlaufende Anteile									
						EUR		47.483.509,07	100,00 ¹⁾
						EUR		42,76	
						STK		1.110.400	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.12.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)		Kurse per 30.12.2022
Britisches Pfund	(GBP)	0,88725 = 1 EUR
Dänische Krone	(DKK)	7,43645 = 1 EUR
Norwegische Krone	(NOK)	10,5135 = 1 EUR
Polnischer Zloty	(PLN)	4,68125 = 1 EUR
Schwedische Krone	(SEK)	11,12025 = 1 EUR
Schweizer Franken	(CHF)	0,98745 = 1 EUR
US-Dollar	(USD)	1,06725 = 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					
DE000BASF111	BASF SE	STK	939	6.627	
DE000A161408	HelloFresh SE	STK	164	1.079	
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	STK	0	637	
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK	715	1.606	
DE000A31C3C0	TAG Immobilien AG - Anrechte	STK	974	974	
Ausland					
NL0015000W81	Aalberts N.V. - Anrechte	STK	0	625	
NL00150010Z1	ABN AMRO Bank N.V. - Anrechte	STK	3.385	3.385	
CH1169360919	Accelleron Industries Ltd.	STK	420	420	
BE0003764785	Ackermans & van Haaren N.V.	STK	183	183	
ES0167050220	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK	0	0	
ES06670509L4	ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. - Anrechte	STK	1.461	1.461	
NL0015000SA1	AEGON N.V. - Anrechte	STK	0	11.038	
NL00150011D6	AEGON N.V. - Anrechte	STK	11.409	11.409	
SE0017615644	Alleima AB	STK	1.443	1.443	
FR001400AXF0	Alstom S.A. - Anrechte	STK	1.876	1.876	
LU2489901806	Aroundtown SA - Anrechte	STK	0	5.662	
GB0006731235	Associated British Foods PLC	STK	356	2.546	
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	STK	288	3.374	
FR0000051732	Atos SE	STK	0	673	
GB00BYVFW23	Auto Trader Group PLC	STK	1.367	8.089	
GB00BDD85M81	Avast Plc.	STK	688	5.714	
FO0000000179	Bakkafrost P/F	STK	20	251	
AT0000BAWAG2	BAWAG Group AG	STK	77	525	
CH0002432174	Bucher Industries AG	STK	0	29	
DK0010181759	Carlsberg AS	STK	191	805	
CH0010570759	Chocoladef. Lindt & Sprüngli	STK	0	1	
CH1228538257	Credit Suisse Group AG - Anrechte	STK	17.049	17.049	
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC	STK	0	9.453	
SE0007691613	Dometic Group AB	STK	0	1.279	
CH0023405456	Dufry AG	STK	193	638	
ES0118900192	Ferrovial S.A.	STK	0	0	
ES06189009K1	Ferrovial S.A. - Anrechte	STK	3.007	3.007	
ES0137650018	Fluidra S.A.	STK	0	591	
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC	STK	0	32.239	
GB00BMX86B70	Haleon PLC	STK	34.045	34.045	
GB0004052071	Halma PLC	STK	216	2.709	
GB0004161021	Hays PLC	STK	1.931	12.455	
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC	STK	884	5.191	
ES0144583269	Iberdrola S.A.	STK	0	0	
ES06445809O6	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	0	0	
SE0000190126	Industrivärden AB	STK	0	1.037	
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG	STK	358	1.747	
GB00B7T77214	NatWest Group PLC	STK	3.468	39.272	
DK0060952919	Netcompany Group A/S	STK	252	525	
NL00150010L1	NN Group N.V. - Anrechte	STK	2.074	2.074	
SE0012116390	Nordic Entertainment Group AB	STK	162	380	
US6687711084	NortonLifeLock Inc.	STK	158	158	
PLPKO0000016	Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski	STK	0	5.215	
NL00150011T2	Prosus N.V. - Anrechte	STK	6.034	6.034	
BE0003810273	Proximus S.A.	STK	795	1.751	
AT000606306	Raiffeisen Bank Intl AG	STK	70	480	

FR001400BQC9	Rémy Cointreau S.A. - Anrechte	STK	138	138
GB0002405495	Schroders PLC	STK	3.990	4.771
SE0018689234	Securitas AB	STK	0	0
SE0018689226	Securitas AB - Anrechte	STK	0	0
GB00BP6MXD84	Shell PLC	STK	41.609	41.609
NL00150016P9	Shell PLC - Anrechte	STK	41.476	41.476
ES0143416115	Siemens Gamesa Renew. En. S.A.	STK	0	1.364
GB00BP92CJ43	Tate & Lyle PLC	STK	383	2.825
SE0011205202	Vitrolife AB	STK	138	498
JE00BN574F90	Wizz Air Holdings PLC	STK	125	438
NL00150010J5	Wolters Kluwer N.V. - Anrechte	STK	1.745	1.745

Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) 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 ESG DR UCIT ETF
International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9603

Anteilwert	EUR	42,76
Umlaufende Anteile	STK	1.110.400
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	XXX
Ertragsverwendung		0,19
Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)		99,57
Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

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

Angaben für Indexfonds

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 (annualisiert)

0,15%

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.

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
I. Vermögensgegenstände		228.010.317,15	100,04
1. Aktien		227.054.732,10	99,62
- Banken	7.296.535,24		3,20
- Bau und Baustoffe	1.732.132,80		0,76
- Bergbau	1.205.311,16		0,53
- Chemische Industrie	34.970.821,62		15,34
- Einzelhandel	5.090.193,79		2,23
- Elektrik / Elektronik	10.876.442,30		4,77
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	33.613.762,55		14,75
- Pharmaindustrie / Biotech	27.264.634,03		11,96
- Real Estate	5.170.075,06		2,27
- Software	15.364.180,44		6,74
- Sonstige Finanzdienstleistungen	6.989.427,00		3,07
- Sonstige industrielle Werte	16.823.589,64		7,38
- Telekommunikation	15.998.485,89		7,02
- Textilien und Kleidung	6.298.259,08		2,76
- Transportation	9.724.303,80		4,27
- Versicherungen	28.636.577,70		12,56
2. Forderungen		876.036,67	0,38
3. Bankguthaben		79.548,38	0,03
II. Verbindlichkeiten		-80.569,29	-0,04
III. Teilsondervermögen		227.929.747,86	100,00 ¹⁾

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert EUR	% des Teilsonder- ver- mögens	
							im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	38.873	7.349	4.848	EUR	127,460	4.954.752,58	2,17
DE0008404005	Allianz SE		STK	80.133	20.487	15.710	EUR	200,900	16.098.719,70	7,06
DE0006766504	Aurubis AG		STK	7.119	1.376	721	EUR	76,360	543.606,84	0,24
DE000BASF111	BASF SE		STK	210.812	39.960	22.411	EUR	46,390	9.779.568,68	4,29
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	231.698	45.052	23.797	EUR	48,325	11.196.805,85	4,91
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	72.380	13.748	10.009	EUR	83,380	6.035.044,40	2,65
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	23.093	4.464	2.332	EUR	107,200	2.475.569,60	1,09
DE000A1DAH00	Brenntag SE		STK	36.423	7.047	3.719	EUR	59,720	2.175.181,56	0,95
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	8.606	1.668	890	EUR	117,900	1.014.647,40	0,45
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	249.401	48.215	25.230	EUR	8,836	2.203.707,24	0,97
DE0005439004	Continental AG		STK	25.489	4.927	2.573	EUR	55,980	1.426.874,22	0,63
DE0006062144	Covestro AG		STK	44.711	8.485	4.596	EUR	36,550	1.634.187,05	0,72
DE0007100000	Daimler AG		STK	185.451	36.061	19.048	EUR	61,400	11.386.691,40	5,00
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG		STK	101.307	101.383	76	EUR	28,945	2.932.331,12	1,29
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	481.000	93.036	48.912	EUR	10,588	5.092.828,00	2,23
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	43.305	8.432	4.459	EUR	161,400	6.989.427,00	3,07
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	239.508	62.392	17.071	EUR	7,765	1.859.779,62	0,82
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	223.551	44.424	28.243	EUR	35,180	7.864.524,18	3,45
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	814.396	166.805	92.096	EUR	18,638	15.178.712,65	6,66
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	48.390	9.352	4.883	EUR	17,935	867.874,65	0,38
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	46.893	9.133	4.813	EUR	30,570	1.433.519,01	0,63
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA		STK	97.745	18.910	9.963	EUR	26,250	2.565.806,25	1,13
DE0006602006	GEA Group AG		STK	34.410	6.479	4.329	EUR	38,200	1.314.462,00	0,58
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	14.156	2.738	1.442	EUR	185,500	2.625.938,00	1,15
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	32.510	6.040	3.869	EUR	53,280	1.732.132,80	0,76
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	38.838	7.319	4.870	EUR	65,020	2.525.246,76	1,11
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG		STK	13.715	2.651	1.385	EUR	54,160	742.804,40	0,33
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	307.130	59.835	31.577	EUR	28,430	8.731.705,90	3,83
DE000KSAG888	K+S Aktiengesellschaft		STK	45.171	8.732	4.560	EUR	18,375	830.017,13	0,36
DE000KGX8881	KION GROUP AG		STK	16.934	3.273	1.706	EUR	26,770	453.323,18	0,20
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	15.602	3.015	1.574	EUR	51,040	796.326,08	0,35
DE0005470405	LANXESS AG		STK	19.294	3.728	1.946	EUR	37,700	727.383,80	0,32
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	17.490	3.634	1.747	EUR	60,860	1.064.441,40	0,47
DE0006599905	Merck KGaA		STK	30.481	5.894	3.098	EUR	180,900	5.514.012,90	2,42
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	32.605	6.135	3.540	EUR	304,000	9.911.920,00	4,35
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	36.094	6.983	3.690	EUR	51,240	1.849.456,56	0,81
DE0006969603	PUMA SE		STK	23.695	4.588	2.439	EUR	56,700	1.343.506,50	0,59
DE0007164600	SAP SE		STK	159.396	33.136	29.023	EUR	96,390	15.364.180,44	6,74
DE0007165631	Sartorius AG		STK	5.806	1.121	585	EUR	369,400	2.144.736,40	0,94
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	17.468	4.156	2.509	EUR	46,930	819.773,24	0,36
DE0007236101	Siemens AG		STK	123.629	26.488	36.263	EUR	129,640	16.027.263,56	7,03
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	109.514	22.041	11.087	EUR	17,575	1.924.708,55	0,84
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	65.574	12.683	6.670	EUR	46,730	3.064.273,02	1,34
DE000SYM9999	Symrise AG		STK	31.309	6.057	3.185	EUR	101,650	3.182.559,85	1,40
DE0007500001	thyssenkrupp AG		STK	116.170	22.455	11.726	EUR	5,696	661.704,32	0,29
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	54.036	54.073	37	EUR	116,420	6.290.871,12	2,76
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	166.862	32.722	19.511	EUR	22,020	3.674.301,24	1,61
DE000ZAL1111	Zalando SE		STK	55.033	10.686	5.120	EUR	33,110	1.822.142,63	0,80
								EUR	210.849.350,78	92,51
Ausland										
LU1673108939	Aroundtown SA		STK	197.587	38.892	52.736	EUR	2,183	431.332,42	0,19
IE00BZ12WP82	Linde PLC		STK	51.642	10.050	8.684	EUR	305,450	15.774.048,90	6,92
								EUR	16.205.381,32	7,11
								EUR	227.054.732,10	99,62
Summe Wertpapiervermögen										
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	79.548,38	0,03	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle		EUR		21.414,55			%	100,000	21.414,55	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Verwahrstelle		USD		62.043,33			%	100,000	58.133,83	0,03
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	876.036,67	0,38	
Dividendenforderungen Aktien		EUR		876.036,67					876.036,67	0,38
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-80.569,29	-0,04	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR		-80.569,29					-80.569,29	-0,04
Wert des Teilsondervermögens							EUR	227.929.747,86	100,00 ¹⁾	
Anteilwert							EUR	32,35		

Umlaufende Anteile			STK	7.045.300
---------------------------	--	--	------------	------------------

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.12.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)	30.12.2022
US-Dollar (GBP)	1,06725 = 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					
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG	STK	5.422	30.881	
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK	18.584	49.965	
DE000A31C3C0	TAG Immobilien AG - Anrechte	STK	31.311	31.311	
Ausland					
LU2489901806	Aroundtown SA - Anrechte	STK	0	211.431	

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) 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 (DR) UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF9090
Anteilwert	EUR	32,35
Umlaufende Anteile	STK	7.045.300
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,15
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)		99,62
Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.12.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

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

Angaben für Indexfonds

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 (annualisiert)

0,34%

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.