

Jahresbericht  
zum 28. Februar 2023.

**Deka iBoxx € Liquid  
Corporates Diversified UCITS  
ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Das geistige Eigentum des hier erwähnten Index ist Eigentum von oder lizenziert durch IHS Markit und/oder seinen Tochtergesellschaften (IHS Markit). Dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen werden von IHS Markit nicht gesponsert, gefördert oder unterstützt. IHS Markit gibt keinerlei Garantien oder Zusicherungen hinsichtlich der Richtigkeit, Vollständigkeit oder Eignung für einen bestimmten Zweck oder der Ergebnisse, die durch die Verwendung des Index oder der darin enthaltenen Informationen erzielt werden können. IHS Markit haftet gegenüber dem Empfänger in keiner Weise für Ungenauigkeiten, Fehler oder Auslassungen in den IHS Markit Daten, unabhängig von deren Ursache, oder für daraus resultierende (direkte oder indirekte) Schäden. Dieses Dokument stellt keine ausdrückliche oder stillschweigende Finanz-, Investitions-, Rechts-, Steuer- oder sonstige Beratung jeglicher Art oder Empfehlung von IHS Markit dar. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

# Bericht der Geschäftsführung.

28. Februar 2023

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2022 bis zum 28. Februar 2023.

Die mit dem Einmarsch Russlands in die Ukraine erfolgte jähe Zäsur bildete im Berichtszeitraum das beherrschende Thema und verursachte auch an den Kapitalmärkten Turbulenzen. Die als Reaktion auf den Angriffskrieg initiierten Sanktionsmaßnahmen des Westens gegen den russischen Aggressor setzten eine Vergeltungsspirale in Gang, in deren Folge Russland u.a. die Lieferung von Gas an verschiedene europäische Länder massiv beschränkte und zahlreiche ausländische Unternehmen ihre dortigen Geschäftstätigkeiten einstellen mussten. Signifikante Preissteigerungen sowie Befürchtungen vor Versorgungsengpässen sorgten phasenweise für große Verunsicherung, insbesondere in Europa. Während die Pandemie und ihre Auswirkungen an den Finanzmärkten weltweit zusehends in den Hintergrund rückten, führte die Null-Covid-Politik in China mit damit einhergehenden Lockdown-Maßnahmen zu wiederholten Beeinträchtigungen im internationalen Handel, ehe im Dezember die Staatsführung einen abrupten Wechsel in der Pandemiepolitik vollzog.

In der Geld- und Fiskalpolitik rückte im Laufe des Berichtszeitraums die dynamische Inflationsentwicklung in den Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu einer scharfen Zinswende zwang. Während die Fed zum Stichtag bei einem Leitzinsintervall von 4,50 bis 4,75 Prozent angelangt war, hob die EZB die Leitzinsen ab Juli 2022 auf 3,00 Prozent an. Zugleich wurden weitere Zinserhöhungen in Aussicht gestellt. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo merklich an. Ende Februar 2023 rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 2,7 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,9 Prozent.

Angesichts zahlreicher Belastungsfaktoren und Unsicherheiten wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode starke Schwankungen auf. Bis September überwogen hierbei die negativen Vorzeichen, ehe in der zweiten Berichtshälfte eine kräftige Gegenbewegung einsetzte. Stark unter Druck geriet zeitweise der Euro, der vorübergehend unter die Parität zum US-Dollar auf ein 20-Jahrestief fiel, sich jedoch ab November wieder spürbar erholte. Nach deutlichen Zugewinnen im ersten Quartal begab sich der Ölpreis ab Sommer auf Talfahrt und tendierte zuletzt unter 85 US-Dollar pro Barrel (Brent).

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

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023	13
Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023	14
Anhang	20
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	23
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	25

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

# Jahresbericht 01.03.2022 bis 28.02.2023

## Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

### Tätigkeitsbericht.

Der Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den Markt iBoxx € Liquid Corporates Diversified (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der 75 größten und umsatzstärksten europäischen Unternehmensanleihen ab. Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrunde liegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt.

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

Zusatzerträge können durch Wertpapierdarlehensgeschäfte erzielt werden.

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren im Wesentlichen aus Transaktionen mit Anleihen, die aufgrund von Indexveränderungen und der Rücknahme von Anteilscheinen durchgeführt wurden.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten (Angaben gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852).

#### PAI-Berücksichtigung

Der Fonds bewirbt weder ökologische oder soziale Merkmale noch verfolgt er ein nachhaltiges Investitionsziel. Demnach handelt es sich um ein Finanzprodukt gemäß Artikel 6 (EU) 2019/2088 (Offenlegungs-VO). Bei dem Fonds wurden gemäß Artikel 7 (EU) 2019/2088 die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (nachfolgend auch Principal Adverse Impacts oder PAI) berücksichtigt. PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-) Tätigkeiten der Unternehmen, die im zugrundeliegenden Index enthalten sind, in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Bei diesem Fonds wurde im Berichtszeitraum in Bezug auf die PAI nicht in Unternehmen investiert, die kontroverse Waffen herstellen.

Die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen von Unternehmen wurden auch im Rahmen der Mitwirkungspolitik der Verwaltungsgesellschaft berücksichtigt mit der Absicht auf eine Reduzierung der PAI der Emittenten im Anlageuniversum hinzuwirken.

#### Wichtige Kennzahlen

##### Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
Performance*	-10,15%	-4,73%	-1,88%

ISIN DE000ETF375

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

Die Ergebnisse der Mitwirkungspolitik sind im aktuellen Engagement-Bericht zu finden <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.

#### Adressenausfallrisiken

Das Investmentvermögen unterlag im Berichtszeitraum wesentlichen Adressenausfallrisiken aus Wertpapierdarlehensgeschäften nach § 200 und § 202 KAGB. Die Risikosteuerung von Adressenausfallrisiken erfolgt anhand der gesetzlichen Vorgaben hinsichtlich Kontrahentenbegrenzung und Besicherung. Des Weiteren bestanden Ausfallrisiken der Emittenten der im Fonds enthaltenen Schuldverschreibungen. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Emittentenrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des Index. Die geringen Abweichungen in dem Emittentenrisikoexposition zwischen Investmentvermögen und Index im Berichtszeitraum waren u.a. durch den Kassenbestand zu erklären. Im Berichtszeitraum entstand dem Investmentvermögen kein Verlust durch einen Adressenausfall.

#### Währungsrisiken

Da die Fondswährung auf Euro lautet und das Investmentvermögen im Berichtszeitraum gemäß den Indexvorgaben ausschließlich in Euro-Wertpapiere investiert war, bestand für den Anleger aus der Eurozone kein Währungsrisiko.

#### Sonstige Marktpreisrisiken

Das Investmentvermögen unterlag im Berichtszeitraum dem Marktpreisrisiko der im Investmentvermögen gehaltenen Schuldverschreibungen. Deren Kursentwicklung wird u.a. durch das Marktzinsniveau sowie die Markteinschätzung zur Emittentenbonität beeinflusst. Da die Zusammensetzung des Investmentvermögens darauf abzielt, den zugrunde liegenden Index möglichst genau abzubilden, entsprach das Marktpreisrisiko im Berichtszeitraum auch weitestgehend dem des iBoxx € Liquid Corporates Diversified (Preis-)Index. Die geringen Abweichungen in dem Marktpreisexposition zwischen Investmentvermögen und

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Index im Berichtszeitraum waren u.a. durch den Kassenbestand zu erklären. Die modifizierte Duration des Investmentvermögens betrug zum Stichtag 4,46 Prozent.

## **Operationelle Risiken**

Das Management von operationellen Risiken für das Investmentvermögen erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Deka Investment GmbH ist methodisch und prozessual in das in der Deka-Gruppe implementierte System zum Management und Controlling operationeller Risiken eingebunden. In diesem Rahmen werden regelmäßig die operationellen Risiken der für das Investmentvermögen relevanten Prozesse identifiziert, bewertet und überwacht. Instrumente hierfür sind u.a. das dezentrale Self Assessment, Szenarioanalysen sowie eine konzernweite Schadensfalldatenbank. Außerdem werden wesentliche Auslagerungen, insbesondere die konzernexterne Auslagerung der Fondsbuchhaltung an die BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland, im Rahmen eines Auslagerungscontrollings überwacht. Im Berichtszeitraum entstand dem Investmentvermögen kein Schaden aus operationellen Risiken.

## **Liquiditätsrisiken**

Aufgrund der passiven Abbildung eines Index, dessen Regelwerk liquiditätsrelevante Anforderungen an die Indexkonstituenten (u.a. Mindestemissionsvolumen) stellt sowie die Investition in Wertpapiere gemäß § 193 KAGB, wird das Liquiditätsrisiko grundsätzlich als gering eingestuft.

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS2280845491	0.000000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260110
Löschung	FR0014003Q41	0.000000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25) 20251130
Löschung	XS2343821794	0.000000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(24) 20240718
Löschung	FR0014002S57	0.010000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2021(26) 20260510
Löschung	XS2406549464	0.010000 % Danske Bank AS EO-FLR MTN 2021(23/24) 20241109
Löschung	XS2079723552	0.050000 % DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231113
Löschung	XS2436160779	0.100000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25) 20250125
Löschung	FR0013444304	0.100000 % HSBC Continental Europe S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(27) 20270902
Löschung	XS2258389415	0.100000 % OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(27) 20271115
Löschung	XS2322289385	0.125000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Preferred MTN 21(26/27) 20270323
Löschung	FR0013463650	0.125000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/25) 20250526
Löschung	FR0014006IU2	0.125000 % Société Générale S.A. EO-FLR-MTN 2021(25/26) 20261116
Löschung	XS2404629235	0.125000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20261102
Löschung	XS2298304499	0.200000 % Banco Santander S.A. EO-Pref. Med-T. Nts 2021(28) 20280210
Löschung	FR0013476199	0.250000 % BPCE S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(26) 20260114
Löschung	XS2306517876	0.250000 % DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) 20290222
Löschung	XS2281155254	0.250000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(29/30) 20300131
Löschung	DE000A2R9ZT1	0.250000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231105
Löschung	XS2207657417	0.250000 % Nationwide Building Society EO-Preferred MTN 2020(25) 20250721
Löschung	XS2404027935	0.250000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 21(26) 20261101
Löschung	CH0576402181	0.250000 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2020(27/28) 20281104
Löschung	XS2343563214	0.300000 % Swedbank AB EO-Non-Pref. FLR MTN 21(26/27) 20270519
Löschung	XS2416413339	0.375000 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Med.-T. Nts 21(26/27) 20271130
Löschung	XS2432567555	0.375000 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(27/28) 20280117
Löschung	FR0013463668	0.375000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20271126
Löschung	XS2390506546	0.375000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(27/28) 20280928
Löschung	XS2238789460	0.375000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2020(20/28) 20281014
Löschung	XS2356049069	0.375000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280620
Löschung	XS2050404800	0.450000 % DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/28) 20280317
Löschung	XS2024715794	0.500000 % Deutsche Telekom AG MTN v.2019(2027) 20270704
Löschung	XS2384273715	0.500000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2021(21/30) 20300902
Löschung	XS2403444677	0.500000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2021(28) 20281101
Löschung	XS1948612905	0.625000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231005
Löschung	XS2434702424	0.625000 % Caixabank S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28) 20280120
Löschung	XS1956955980	0.625000 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240226
Löschung	XS2388491289	0.641000 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(21/29) 20290923
Löschung	XS2456247605	0.750000 % BASF SE MTN v.2022(2022/2026) 20260316
Löschung	XS2199266003	0.750000 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/27) 20270105
Löschung	FR0013412947	0.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(26) 20260607
Löschung	XS2200150766	0.750000 % Caixabank S.A. EO-FLR Preferred MTN 20(25/26) 20260709
Löschung	XS2050406094	0.750000 % DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/31) 20310917
Löschung	XS2442768227	0.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270808
Löschung	FR0014007LK5	0.875000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(29/30) 20300710
Löschung	DE000CZ40NS9	1.000000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.923 v.19(26) 20260303

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FR0014009857	1.000000 % Crédit Agricole S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250917
Löschung	XS2002491517	1.000000 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240527
Löschung	CH1168499791	1.000000 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2022(24/25) 20250320
Löschung	BE6312821612	1.125000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270630
Löschung	XS1960678255	1.125000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/27) 20270306
Löschung	XS2443893255	1.125000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2022(27) 20270215
Löschung	XS1992927902	1.231000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(31) 20310507
Löschung	XS2443920249	1.250000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(26/27) 20270215
Löschung	XS2360853332	1.288000 % Prosus N.V. EO-Med.-T.Nts 2021(21/29)Reg.S 20290712
Löschung	XS2185867830	1.375000 % Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260608
Löschung	XS2168647357	1.375000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26) 20260104
Löschung	FR0013422011	1.375000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 20290527
Löschung	XS2455983861	1.375000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320310
Löschung	XS2449911143	1.375000 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2022(27) 20270301
Löschung	XS2447983813	1.375000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2022(29) 20290222
Löschung	XS2456247787	1.500000 % BASF SE MTN v.2022(2022/2031) 20310316
Löschung	XS1948611840	1.500000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290205
Löschung	XS2301292400	1.500000 % Gaz Finance PLC EO-M.-T.LPN 21(27)Gazprom RegS 20270216
Löschung	XS2485259241	1.750000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2022(25) 20251125
Löschung	XS1958307461	1.750000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 20290304
Löschung	XS2478690931	1.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 2022(26) 20261110
Löschung	XS1962571011	1.875000 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(31) 20310314
Löschung	FR0014009LQ8	2.100000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(32) 20320406
Löschung	XS2485152362	2.100000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270524
Löschung	XS2478299204	2.125000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20291116
Löschung	XS2526839175	2.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20250309
Löschung	XS2482618464	2.500000 % Nordea Bank Abp EO-Non-Preferred MTN 2022(29) 20290522
Löschung	XS2484587048	2.592000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310524
Löschung	FR001400AO14	2.625000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2022(29) 20290529
Löschung	FR001400AKP6	2.750000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/28) 20280724
Löschung	XS2482887879	2.750000 % RWE AG Medium Term Notes v.22(30/30) 20300523
Löschung	XS2521027446	3.125000 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(29/30) 20300823
Löschung	XS2530034649	3.750000 % Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(29) 20290906
Löschung	XS2528858033	4.067000 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28) 20280905
Neuaufnahme	XS2280845491	0.000000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260110
Neuaufnahme	FR0014001IO6	0.000000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(29) 20290717
Neuaufnahme	FR0014006XE5	0.010000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2021(25) 20250306
Neuaufnahme	XS2298304499	0.200000 % Banco Santander S.A. EO-Pref. Med-T. Nts 2021(28) 20280210
Neuaufnahme	XS2306517876	0.250000 % DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) 20290222
Neuaufnahme	CH0576402181	0.250000 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2020(27/28) 20281104
Neuaufnahme	FR0013516069	0.375000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260104



# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	XS2447561403	0.500000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250221
Neuaufnahme	FR0013516077	0.500000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) 20280604
Neuaufnahme	FR0014000UL9	0.625000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(32) 20321202
Neuaufnahme	XS2456247605	0.750000 % BASF SE MTN v.2022(2022/2026) 20260316
Neuaufnahme	XS2442768227	0.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270808
Neuaufnahme	FR0014009A50	1.000000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250522
Neuaufnahme	FR0014009857	1.000000 % Crédit Agricole S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250917
Neuaufnahme	CH1168499791	1.000000 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2022(24/25) 20250320
Neuaufnahme	XS2443893255	1.125000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2022(27) 20270215
Neuaufnahme	XS2443920249	1.250000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(26/27) 20270215
Neuaufnahme	XS2199266698	1.375000 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/32) 20320705
Neuaufnahme	XS2455983861	1.375000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320310
Neuaufnahme	FR0013508694	1.375000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2020(32) 20320420
Neuaufnahme	XS2449911143	1.375000 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2022(27) 20270301
Neuaufnahme	XS2447983813	1.375000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2022(29) 20290222
Neuaufnahme	XS2456247787	1.500000 % BASF SE MTN v.2022(2022/2031) 20310316
Neuaufnahme	XS2477935345	1.625000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/26) 20261116
Neuaufnahme	XS2485259241	1.750000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2022(25) 20251125
Neuaufnahme	XS2443920751	1.750000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(30/31) 20310215
Neuaufnahme	XS2478690931	1.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 2022(26) 20261110
Neuaufnahme	XS2459544339	1.875000 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290920
Neuaufnahme	XS2193983108	1.908000 % Upjohn Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320622
Neuaufnahme	XS2153409029	1.994000 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) 20320407
Neuaufnahme	XS2267889991	2.000000 % Autostrade per l'Italia S.p.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/28) 20281203
Neuaufnahme	DE000A289XJ2	2.000000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2020(26) 20260821
Neuaufnahme	FR0014009LQ8	2.100000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(32) 20320406
Neuaufnahme	XS2485152362	2.100000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27) 20270524
Neuaufnahme	XS2483607474	2.125000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(25/26) 20260524
Neuaufnahme	XS2478299204	2.125000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20291116
Neuaufnahme	XS2526839175	2.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20250309
Neuaufnahme	FR0013507878	2.375000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/32) 20320414
Neuaufnahme	FR001400CEQ3	2.500000 % Crédit Agricole S.A. EO-Preferred MTN 2022(29) 20290828
Neuaufnahme	XS2482618464	2.500000 % Nordea Bank Abp EO-Non-Preferred MTN 2022(29) 20290522
Neuaufnahme	XS2523390271	2.500000 % RWE AG Medium Term Notes v.22(25/25) 20250823
Neuaufnahme	XS2484587048	2.592000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310524
Neuaufnahme	FR001400AO14	2.625000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2022(29) 20290529
Neuaufnahme	FR001400AKP6	2.750000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/28) 20280724
Neuaufnahme	XS2482887879	2.750000 % RWE AG Medium Term Notes v.22(30/30) 20300523
Neuaufnahme	XS2135801160	2.822000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2020(32) 20320406
Neuaufnahme	BE6320935271	2.875000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) 20320401
Neuaufnahme	XS2530506752	2.875000 % OP Yrityspankki Oyj EO-Non-Preferred MTN 2022(25) 20251214
Neuaufnahme	XS2535308477	3.000000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2022(22/28) 20281014

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	XS2486589596	3.019000 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/27) 20270614
Neuaufnahme	XS2534985523	3.125000 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(26/27) 20270920
Neuaufnahme	XS2521027446	3.125000 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(29/30) 20300823
Neuaufnahme	XS2535308634	3.125000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2022(22/31) 20311014
Neuaufnahme	XS2558953621	3.250000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251123
Neuaufnahme	XS2534785865	3.375000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2022(27) 20270919
Neuaufnahme	FR001400CQ85	3.375000 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Nts 2022(27) 20270918
Neuaufnahme	XS2538366878	3.625000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(25/26) 20260926
Neuaufnahme	FR001400CFW8	3.625000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(29) 20290831
Neuaufnahme	FR001400F1G3	3.625000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/30) 20300110
Neuaufnahme	XS2575952424	3.750000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2023(26) 20260115
Neuaufnahme	XS2530034649	3.750000 % Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(29) 20290906
Neuaufnahme	XS2579319513	3.750000 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20271122
Neuaufnahme	XS2555192710	3.750000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251113
Neuaufnahme	FR001400E797	4.000000 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(32) 20321128
Neuaufnahme	XS2572996606	4.000000 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Pref. MTN 2023(30) 20300109
Neuaufnahme	XS2573569220	4.000000 % Danske Bank AS EO-FLR Preferred MTN 23(26/27) 20270111
Neuaufnahme	XS2553798443	4.000000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26) 20261108
Neuaufnahme	XS2528858033	4.067000 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28) 20280905
Neuaufnahme	XS2573569576	4.125000 % Danske Bank AS EO-FLR Preferred MTN 23(30/31) 20310109
Neuaufnahme	XS2554487905	4.125000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20251114
Neuaufnahme	FR001400FDB0	4.250000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2023(23/32) 20320124
Neuaufnahme	FR001400DZO1	4.250000 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2022(32) 20321115
Neuaufnahme	XS2545206166	4.375000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2022(29) 20291013
Neuaufnahme	FR001400D6N0	4.375000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20291011
Neuaufnahme	BE0002900810	4.375000 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(26/27) 20271122
Neuaufnahme	FR001400DNG3	4.625000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/32) 20320606
Neuaufnahme	XS2550081454	4.625000 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(27/28) 20280126
Neuaufnahme	XS2579606927	4.750000 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-FLR Med.-T. Nts 2023(26/27) 20270125

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS2486589596	3.019000	% HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/27) 20270614	2,13
XS2575952424	3.750000	% Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2023(26) 20260115	1,93
BE6320935271	2.875000	% Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) 20320401	1,80
FR0014006XE5	0.010000	% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2021(25) 20250306	1,78
FR0014009A50	1.000000	% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250522	1,73
FR0013482833	0.125000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) 20280210	1,66
XS2148623106	3.500000	% Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2020(25/26) 20260331	1,65
XS2538366878	3.625000	% Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(25/26) 20260926	1,65
DE000A289RN6	2.625000	% Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250406	1,64
FR001400E797	4.000000	% BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(32) 20321128	1,64
XS2483607474	2.125000	% ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(25/26) 20260524	1,59
FR001400CFW8	3.625000	% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2022(29) 20290831	1,59
FR0013506508	0.750000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) 20250406	1,58
FR0013508512	1.000000	% Crédit Agricole S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(25/26) 20260421	1,56
XS2366407018	0.800000	% Thermo Fisher Scient.(Fin.)BV EO-Notes 2021(21/30) 20301017	1,56
FR0013509726	0.625000	% BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250427	1,56
XS2171210862	0.375000	% Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25) 20250511	1,54
FR0013505633	2.750000	% Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300401	1,54
XS2153406868	1.491000	% TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270407	1,53
XS2326546434	0.010000	% UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2021(26) 20260330	1,48
FR001400DNG3	4.625000	% Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/32) 20320606	1,45
XS2153409029	1.994000	% TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) 20320407	1,44
FR0014000UL9	0.625000	% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(32) 20321202	1,41
XS2545206166	4.375000	% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2022(29) 20291013	1,40
FR001400DZO1	4.250000	% Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2022(32) 20321115	1,39
CH0576402181	0.250000	% UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2020(27/28) 20281104	1,39
XS2443920751	1.750000	% ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(30/31) 20310215	1,39
XS2199266268	1.125000	% Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/30) 20300105	1,37
XS2572996606	4.000000	% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Pref. MTN 2023(30) 20300109	1,36
XS2530506752	2.875000	% OP Yrityspankki Oyj EO-Non-Preferred MTN 2022(25) 20251214	1,35
XS2534985523	3.125000	% DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(26/27) 20270920	1,35
XS2523390271	2.500000	% RWE AG Medium Term Notes v.22(25/25) 20250823	1,35
XS2534785865	3.375000	% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2022(27) 20270919	1,35
DE000A289XJ2	2.000000	% Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2020(26) 20260821	1,32
XS2156510021	1.000000	% Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250414	1,32
XS2447561403	0.500000	% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250221	1,32
XS2477935345	1.625000	% TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/26) 20261116	1,30
XS2199266698	1.375000	% Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/32) 20320705	1,30
FR0013516069	0.375000	% EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260104	1,28
XS2345982362	0.250000	% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260104	1,27
FR001400CEQ3	2.500000	% Crédit Agricole S.A. EO-Preferred MTN 2022(29) 20290828	1,27
XS2177441990	1.201000	% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270820	1,25
XS2135801160	2.822000	% BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2020(32) 20320406	1,25
FR0013486701	0.125000	% Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26) 20260223	1,24
XS2350621863	0.000000	% Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(26/26) 20260613	1,24
XS2459544339	1.875000	% EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290920	1,23

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS2171874519	0.500000	% Nordea Bank Abp EO-Preferred Med.-T.Nts 20(27) 20270513	1,22
XS2355599197	0.125000	% NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260617	1,22
XS2325733413	0.625000	% Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) 20270329	1,22
FR0013516077	0.500000	% EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) 20280604	1,21
XS2185867913	1.625000	% Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300608	1,20
FR0013507878	2.375000	% Capgemini SE EO-Notes 2020(20/32) 20320414	1,18
XS2267889991	2.000000	% Autostrade per l'Italia S.p.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/28) 20281203	1,18
XS2234567233	0.875000	% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2020(28) 20280921	1,16
XS2356040357	0.750000	% Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290117	1,14
XS2550081454	4.625000	% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(27/28) 20280126	1,13
XS2554487905	4.125000	% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20251114	1,12
BE0002900810	4.375000	% KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(26/27) 20271122	1,11
XS2553798443	4.000000	% Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26) 20261108	1,11
FR001400D6N0	4.375000	% Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20291011	1,11
XS2573569220	4.000000	% Danske Bank AS EO-FLR Preferred MTN 23(26/27) 20270111	1,11
XS2555192710	3.750000	% Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251113	1,11
XS2573569576	4.125000	% Danske Bank AS EO-FLR Preferred MTN 23(30/31) 20310109	1,10
XS2558953621	3.250000	% Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25) 20251123	1,09
XS2579606927	4.750000	% Raiffeisen Bank Intl AG EO-FLR Med.-T. Nts 2023(26/27) 20270125	1,09
XS2579319513	3.750000	% Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27) 20271122	1,09
FR001400F1G3	3.625000	% Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/30) 20300110	1,09
FR001400FDB0	4.250000	% Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2023(23/32) 20320124	1,09
FR001400CQ85	3.375000	% Crédit Mutuel Arkéa EO-Medium-Term Nts 2022(27) 20270918	1,08
XS2535308477	3.000000	% Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2022(22/28) 20281014	1,07
XS2193983108	1.908000	% Upjohn Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320622	1,06
XS2535308634	3.125000	% Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2022(22/31) 20311014	1,05
FR0013508694	1.375000	% La Poste EO-Medium-Term Notes 2020(32) 20320420	1,02
XS2381671671	0.250000	% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2021(28) 20280831	1,01
FR0014001IO6	0.000000	% La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(29) 20290717	0,91

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 28. Februar 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>267.836.614,00</b>	<b>101,77</b>
1. Anleihen		261.287.054,48	99,28
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	63.330.482,61		24,06
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	84.829.394,68		32,23
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	50.742.714,54		19,28
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	62.384.462,65		23,70
2. Forderungen		7.220.035,15	2,74
3. Bankguthaben		-670.475,63	-0,25
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-4.661.629,96</b>	<b>-1,77</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>263.174.984,04</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
XS2199266268	1,1250 % Bayer AG - Anleihe 2020/2030		EUR	4.400	2.300	2.200	% 81,911	3.604.063,32	1,37
XS2199266698	1,3750 % Bayer AG - Anleihe 2020/2032		EUR	4.400	5.600	1.200	% 77,694	3.418.539,52	1,30
XS2171210862	0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Anleihe 2020/2025		EUR	4.400	2.300	2.200	% 92,120	4.053.259,32	1,54
XS2523390271	2,5000 % RWE AG - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	3.633	4.324	691	% 96,999	3.523.969,31	1,34
							EUR	14.599.831,47	5,55
Ausland									
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2030		EUR	4.400	2.300	2.200	% 92,055	4.050.417,36	1,54
XS2185867913	1,6250 % Airbus SE - Anleihe 2020/2030		EUR	3.670	1.868	1.774	% 86,043	3.157.767,46	1,20
BE6320935271	2,8750 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2020/2032		EUR	5.098	6.960	1.862	% 91,972	4.688.715,23	1,78
XS2267889991	2,0000 % Autostrade per l'Italia S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2028		EUR	3.670	4.338	668	% 84,332	3.094.966,78	1,18
XS2534785865	3,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Medium Term Notes 2022/2027		EUR	3.600	4.300	700	% 96,601	3.477.642,12	1,32
XS2538366878	3,6250 % Banco Santander S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2026		EUR	4.400	5.300	900	% 98,294	4.324.953,60	1,64
XS2575952424	3,7500 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2023/2026		EUR	5.100	5.100	0	% 98,856	5.041.660,08	1,92
XS2447561403	0,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	3.633	4.898	1.265	% 94,364	3.428.233,22	1,30
FR0014000UL9	0,6250 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2020/2032		EUR	5.200	5.200	0	% 70,094	3.644.899,44	1,38
FR001400CFW8	3,6250 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2022/2029		EUR	4.400	5.300	900	% 95,188	4.188.262,76	1,59
FR001400DNG3	4,6250 % Bouygues S.A. - Bonds 2022/2032		EUR	3.600	3.600	0	% 103,722	3.733.993,80	1,42
XS2135801160	2,8220 % BP Capital Markets PLC - Anleihe 2020/2032		EUR	3.670	4.989	1.319	% 89,423	3.281.827,04	1,25
FR0013509726	0,6250 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2025		EUR	4.400	2.300	2.200	% 93,047	4.094.069,76	1,56
FR001400E797	4,0000 % BPCE S.A. - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	4.400	4.400	0	% 97,815	4.303.863,96	1,64
FR0014006XE5	0,0100 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Anleihe 2021/2025		EUR	5.000	6.700	1.700	% 92,274	4.613.682,00	1,75
FR0014009A50	1,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Anleihe 2022/2025		EUR	4.800	6.000	1.200	% 93,691	4.497.164,16	1,71
FR0013507878	2,3750 % Caggemini SE - Anleihe 2020/2032		EUR	3.500	4.700	1.200	% 87,932	3.077.632,95	1,17
XS2572996606	4,0000 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	3.600	3.600	0	% 97,688	3.516.776,28	1,34
XS2550081454	4,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2028		EUR	2.900	3.500	600	% 100,812	2.923.561,05	1,11
FR0013508512	1,0000 % Crédit Agricole S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	4.400	2.300	2.200	% 93,171	4.099.521,80	1,56
FR001400CEQ3	2,5000 % Crédit Agricole S.A. - Medium Term Notes 2022/2029		EUR	3.600	3.600	0	% 90,977	3.275.186,40	1,24
FR001400CQ85	3,3750 % Crédit Mutuel Arkéa - Medium Term Notes 2022/2027		EUR	2.900	3.500	600	% 96,603	2.801.480,62	1,06
XS2345982362	0,2500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	3.893	1.984	2.362	% 85,990	3.347.598,49	1,27
XS2381671671	0,2500 % Credit Suisse AG [London Branch] - Medium Term Notes 2021/2021		EUR	3.617	1.815	1.774	% 73,768	2.668.189,28	1,01
XS2573569220	4,0000 % Danske Bank AS - Floating Rate Medium Term 2023/2027		EUR	2.956	2.956	0	% 99,295	2.935.167,89	1,12
XS2573569576	4,1250 % Danske Bank AS - Floating Rate Medium Term 2023/2031		EUR	2.956	2.956	0	% 98,917	2.923.978,24	1,11
XS2534985523	3,1250 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2022/2027		EUR	3.670	4.338	668	% 97,124	3.564.444,56	1,35
XS2459544339	1,8750 % EDP Finance B.V. - Anleihe 2022/2029		EUR	3.600	4.800	1.200	% 87,962	3.166.634,52	1,20
FR001400FDB0	4,2500 % Electricité de France (E.D.F.) - Medium Term Notes 2023/2032		EUR	2.900	2.900	0	% 97,298	2.821.650,41	1,07
FR001400D6N0	4,3750 % Electricité de France (E.D.F.) - Medium Term Notes 2022/2029		EUR	2.900	3.500	600	% 99,556	2.887.118,78	1,10
FR001400F1G3	3,6250 % Engie S.A. - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	2.900	2.900	0	% 97,521	2.828.122,63	1,07
XS2545206166	4,3750 % EO-Preferred MTN 2022(29) - Medium Term Notes 2022/2029		EUR	3.600	4.300	700	% 100,543	3.619.552,32	1,38
FR0013516069	0,3750 % EssilorLuxottica S.A. - Medium Term Notes 2020/2026		EUR	3.600	3.600	0	% 92,011	3.312.393,12	1,26
FR0013516077	0,5000 % EssilorLuxottica S.A. - Medium Term Notes 2020/2028		EUR	3.600	3.600	0	% 86,534	3.115.222,56	1,18

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2486589596	3,0190 % HSBC Holdings PLC - Anleihe 2022/2027		EUR	5.813	7.442	1.629	% 95,207	5.534.364,89	2,10
XS2443920751	1,7500 % ING Groep N.V. - Anleihe 2022/2031		EUR	4.400	6.000	1.600	% 82,828	3.644.410,44	1,38
XS2483607474	2,1250 % ING Groep N.V. - Anleihe 2022/2026		EUR	4.400	5.600	1.200	% 95,264	4.191.594,44	1,59
BE0002900810	4,3750 % KBC Groep N.V. - Floating Rate Medium Term 2022/2027		EUR	2.900	2.900	0	% 99,767	2.893.245,90	1,10
FR0014001106	0,0000 % La Poste - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	3.100	3.100	0	% 77,680	2.408.074,73	0,92
FR0013508694	1,3750 % La Poste - Anleihe 2020/2032		EUR	3.300	4.500	1.200	% 79,725	2.630.935,56	1,00
XS2148623106	3,5000 % Lloyds Banking Group PLC - Anleihe 2020/2026		EUR	4.384	2.045	1.932	% 98,378	4.312.884,94	1,64
FR0013482833	0,1250 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2028		EUR	5.100	2.400	2.300	% 84,817	4.325.676,69	1,64
FR0013506508	0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2025		EUR	4.400	2.300	2.200	% 94,636	4.163.989,28	1,58
XS2535308477	3,0000 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2022/2028		EUR	2.956	3.510	554	% 95,734	2.829.887,58	1,08
XS2535308634	3,1250 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2022/2031		EUR	2.956	3.510	554	% 94,437	2.791.552,40	1,06
DE000A289XJ2	2,0000 % Mercedes-Benz International Finance B.V. - Anleihe 2020/2026		EUR	3.633	4.569	936	% 94,946	3.449.388,54	1,31
DE000A289RN6	2,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. - Medium Term Notes 2020/2025		EUR	4.360	2.164	2.059	% 98,150	4.279.348,72	1,63
XS2355599197	0,1250 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	3.670	1.868	1.774	% 87,405	3.207.778,18	1,22
XS2350621863	0,0000 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	3.633	1.803	1.716	% 89,043	3.234.945,63	1,23
XS2171874519	0,5000 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2020/2027		EUR	3.670	1.868	1.774	% 87,513	3.211.743,98	1,22
XS2530506752	2,8750 % OP Yrityspankki Oyj - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	3.670	4.338	668	% 97,130	3.564.658,52	1,35
XS2579606927	4,7500 % Raiffeisen Bank Intl AG - Floating Rate Medium Term 2023/2027		EUR	2.900	2.900	0	% 97,861	2.837.965,52	1,08
XS2558953621	3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	2.956	2.956	0	% 98,080	2.899.254,85	1,10
XS2553798443	4,0000 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2022/2026		EUR	2.956	2.956	0	% 99,643	2.945.451,51	1,12
FR0013486701	0,1250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	3.600	1.700	1.600	% 89,175	3.210.302,16	1,22
FR001400DZO1	4,2500 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	3.600	3.600	0	% 99,652	3.587.478,84	1,36
XS2579319513	3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA - Medium Term Notes 2023/2027		EUR	2.956	2.956	0	% 97,714	2.888.418,75	1,10
XS2325733413	0,6250 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2027		EUR	3.670	1.868	1.774	% 87,171	3.199.190,75	1,22
XS2356040357	0,7500 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	3.670	1.868	1.774	% 81,700	2.998.407,25	1,14
XS2156510021	1,0000 % Svenska Handelsbanken AB - Anleihe 2020/2025		EUR	3.670	1.868	1.774	% 94,447	3.466.213,71	1,32
XS2555192710	3,7500 % Swedbank AB - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	2.956	2.956	0	% 99,279	2.934.678,37	1,12
XS2177441990	1,2010 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2020/2027		EUR	3.600	1.700	1.600	% 89,715	3.229.743,24	1,23
XS2477935345	1,6250 % TenneT Holding B.V. - Anleihe 2022/2026		EUR	3.670	4.660	990	% 93,495	3.431.280,45	1,30
XS2366407018	0,8000 % Thermo Fisher Scientific [Finance I] B.V. - Medium Term Notes 2021/2021		EUR	5.098	2.642	2.510	% 79,812	4.068.835,64	1,55
XS2153406868	1,4910 % Total Capital Intl S.A. - Anleihe 2020/2027		EUR	4.400	2.300	2.200	% 91,463	4.024.385,20	1,53
XS2153409029	1,9940 % TotalEnergies Capital International S.A. - Medium Term Notes 2020/2032		EUR	4.400	6.000	1.600	% 85,772	3.773.988,24	1,43
XS2326546434	0,0100 % UBS AG (London Branch) - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	4.284	1.835	1.878	% 88,342	3.784.564,43	1,44
CH0576402181	0,2500 % UBS Group AG - Floating Rate Medium Term 2020/2028		EUR	4.284	5.165	5.217	% 83,008	3.556.060,15	1,35
XS2193983108	1,9080 % Upjohn Finance B.V. - Anleihe 2020/2032		EUR	3.670	4.660	990	% 75,858	2.783.976,12	1,06
XS2234567233	0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028		EUR	3.600	1.700	1.600	% 82,950	2.986.189,20	1,13
XS2554487905	4,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	2.900	2.900	0	% 100,000	2.900.007,54	1,10
Summe Wertpapiervermögen							EUR EUR	246.687.223,01 261.287.054,48	93,74 99,28

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						EUR	-670.475,63	-0,25
	EUR-Kredite bei:								
	Verwahrstelle	EUR		-670.476			% 100,000	-670.475,63	-0,25
	Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	7.220.035,15	2,74
	Forderungen aus Anteilzeichnungen	EUR		4.592.582,40				4.592.582,40	1,75
	Zinsansprüche	EUR		2.627.452,75				2.627.452,75	1,00
	Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-4.661.629,96	-1,77
	Verbindlichkeiten Anleihen	EUR		-4.620.365,92				-4.620.365,92	-1,76
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR		-41.264,04				-41.264,04	-0,02
	Fondsvermögen						EUR	263.174.984,04	100,00
	Anteilwert	EUR						95,37	
	Umlaufende Anteile	STK						2.759.483,00	

<sup>1)</sup> 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 28.02.2023

## 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
<b>Inland</b>					
XS2456247605	0,7500 % BASF SE - Anleihe 2022/2026	EUR	3.500	3.500	
XS2456247787	1,5000 % BASF SE - Anleihe 2022/2031	EUR	3.500	3.500	
XS2199266003	0,7500 % Bayer AG - Anleihe 2020/2027	EUR	700	5.000	
DE000CZ40NS9	1,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2019/2026	EUR	165	3.711	
XS2024715794	0,5000 % Deutsche Telekom AG - Medium Term Notes 2019/2027	EUR	531	4.077	
XS2482887879	2,7500 % RWE AG - Anleihe 2022/2030	EUR	3.050	3.050	
XS2343821794	0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2021/2024	EUR	1.292	4.838	
<b>Ausland</b>					
XS2185867830	1,3750 % Airbus SE - Anleihe 2020/2026	EUR	505	4.081	
BE6312821612	1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2019/2027	EUR	100	3.676	
XS2322289385	0,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	900	3.700	
XS2485259241	1,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Anleihe 2022/2025	EUR	3.800	3.800	
XS2436160779	0,1000 % Banco Santander S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2025	EUR	700	5.000	
XS2298304499	0,2000 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	3.800	3.800	
XS2168647357	1,3750 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	1.600	5.900	
XS2280845491	0,0000 % BMW Finance N.V. - Anleihe 2021/2026	EUR	2.901	2.901	
XS1948612905	0,6250 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2023	EUR	199	4.454	
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	199	4.454	
FR0014007LK5	0,8750 % BNP Paribas S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2030	EUR	700	5.000	
FR0013422011	1,3750 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	200	4.000	
FR0014009LQ8	2,1000 % BNP Paribas S.A. - Anleihe 2022/2032	EUR	5.000	5.000	
FR001400AKP6	2,7500 % BNP Paribas S.A. - Anleihe 2022/2028	EUR	4.900	4.900	
XS1992927902	1,2310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2031	EUR	492	3.614	
FR0013476199	0,2500 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	1.600	5.900	
FR0014002S57	0,0100 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	900	5.300	
FR0013412947	0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	200	5.100	
XS2434702424	0,6250 % Caixabank S.A. - Medium Term Notes 2022/2028	EUR	900	3.700	
XS2200150766	0,7500 % Caixabank S.A. - Medium Term Notes 2020/2026	EUR	200	3.000	
XS2530034649	3,7500 % Caixabank S.A. - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	3.100	3.100	
XS1962571011	1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. - Medium Term Notes 2019/2031	EUR	100	3.100	
XS2404629235	0,3750 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	200	3.014	
XS2416413339	0,3750 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	900	3.700	
XS1956955980	0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	200	3.700	
XS1958307461	1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	200	4.500	
FR0014009857	1,0000 % Crédit Agricole S.A. - Anleihe 2022/2025	EUR	4.300	4.300	
FR0014003Q41	0,0000 % Danone S.A. - Medium Term Notes 2021/2025	EUR	900	3.700	



# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
XS2406549464	0,0100 % Danske Bank A/S - Floating Rate Medium Term 2021/2024	EUR	505	4.081	
XS2050404800	0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Anleihe 2019/2028	EUR	1.123	4.699	
XS2050406094	0,7500 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Guaranteed Registered Notes 2019/2031	EUR	1.538	6.504	
XS2079723552	0,0500 % DNB Bank ASA - Anleihe 2019/2023	EUR	864	6.537	
XS2306517876	0,2500 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2021/2029	EUR	2.996	2.996	
XS2432567555	0,3750 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	748	3.562	
FR0013463650	0,1250 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2025	EUR	1.600	5.900	
FR0013463668	0,3750 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2027	EUR	1.600	5.900	
XS2301292400	1,5000 % Gaz Finance PLC - Loan Particip.Certific. 2021/2027	EUR	0	2.838	
XS2384273715	0,5000 % Holcim Finance [Luxembourg] S.A. - Medium Term Notes 2021/2030	EUR	648	3.486	
FR0013444304	0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. - Anleihe 2019/2027	EUR	1.000	4.500	
XS2388491289	0,6410 % HSBC Holdings PLC - Floating Rate Medium Term 2021/2029	EUR	400	3.214	
XS2455983861	1,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	3.500	3.500	
XS2281155254	0,2500 % ING Groep N.V. - Floating Rate Medium Term 2021/2030	EUR	200	4.500	
XS2390506546	0,3750 % ING Groep N.V. - Floating Rate Medium Term 2021/2028	EUR	200	4.500	
XS2443920249	1,2500 % ING Groep N.V. - Anleihe 2022/2027	EUR	4.400	4.400	
XS2521027446	3,1250 % Lloyds Banking Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2030	EUR	3.074	3.074	
XS2238789460	0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2020/2028	EUR	100	2.938	
XS1960678255	1,1250 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2027	EUR	200	4.471	
DE000A2R9ZT1	0,2500 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. - Anleihe 2019/2023	EUR	744	5.708	
XS2207657417	0,2500 % Nationwide Building Society - Anleihe 2020/2025	EUR	100	2.938	
XS2528858033	4,0670 % NatWest Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	3.074	3.074	
XS2002491517	1,0000 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	505	4.081	
XS2449911143	1,3750 % NatWest Markets PLC - Anleihe 2022/2027	EUR	2.996	2.996	
XS2403444677	0,5000 % Nordea Bank Abp - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	200	3.014	
XS2443893255	1,1250 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2022/2027	EUR	2.941	2.941	
XS2482618464	2,5000 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2022/2029	EUR	3.196	3.196	
XS2258389415	0,1000 % OP Yrityspankki Oyj - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	100	2.938	
XS2360853332	1,2880 % Prosus N.V. - Medium Term Notes 2021/2029	EUR	748	3.562	
XS2526839175	2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2022/2025	EUR	3.100	3.100	
XS2356049069	0,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	400	3.224	
XS2442768227	0,7500 % Skandinaviska Enskilda Banken AB - Anleihe 2022/2027	EUR	3.292	3.292	
XS2478690931	1,1750 % Skandinaviska Enskilda Banken - Anleihe 2022/2026	EUR	3.196	3.196	
FR0014006IU2	0,1250 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	500	3.300	
FR001400AO14	2,6250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2022/2029	EUR	3.200	3.200	
XS2447983813	1,3750 % Svenska Handelsbanken AB - Anleihe 2022/2029	EUR	3.299	3.299	
XS2404027935	0,2500 % Swedbank AB - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	748	3.562	
XS2343563214	0,3000 % Swedbank AB - Floating Rate Medium Term 2021/2021	EUR	300	3.138	
XS2485152362	2,1000 % Swedbank AB - Anleihe 2022/2027	EUR	3.196	3.196	
XS2484587048	2,5920 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2022/2031	EUR	3.200	3.200	
XS2478299204	2,1250 % TenneT Holding B.V. - Anleihe 2022/2029	EUR	3.196	3.196	
CH1168499791	1,0000 % UBS Group AG - Anleihe 2022/2023	EUR	4.878	4.878	

## Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):

unbefristet EUR 251.569

(Basiswerte: 2,7500 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2030 (FR0013505633); 1,3750 % Airbus SE - Anleihe 2020/2026 (XS2185867830); 1,6250 % Airbus SE - Anleihe 2020/2030 (XS2185867913); 2,8750 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2020/2032 (BE6320935271); 0,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Floating Rate Medium Term 2021/2027 (XS2322289385); 0,2000 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2021/2028 (XS2298304499); 1,3750 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2026 (XS2168647357); 1,1250 % Bayer AG - Anleihe 2020/2030 (XS2199266268); 0,0000 % BMW Finance N.V. - Anleihe 2021/2026 (XS2280845491); 0,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2022/2025 (XS2447561403); 1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029 (XS1948611840); 1,2310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2031 (XS1992927902); 0,2500 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2026 (FR0013476199); 0,6250 % CaixaBank S.A. - Medium Term Notes 2022/2028 (XS2434702424); 2,3750 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2032 (FR0013507878); 1,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2019/2026 (DE000CZ40NS9); 1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. - Medium Term Notes 2019/2031 (XS1962571011); 0,2500 % Credit Suisse AG [London Branch] - Medium Term Notes 2021/2021 (XS2381671671); 0,5000 % Deutsche Telekom AG - Medium Term Notes 2019/2027 (XS2024715794); 0,3750 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2022/2028 (XS2432567555); 1,8750 % EDP Finance B.V. - Anleihe 2022/2029 (XS2459544339); 0,1250 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2025 (FR0013463650); 0,5000 % Holcim Finance [Luxembourg] S.A. - Medium Term Notes 2021/2030 (XS2384273715); 0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. - Anleihe 2019/2027 (FR0013444304); 0,6410 % HSBC Holdings PLC - Floating Rate Medium Term 2021/2029 (XS2388491289); 1,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2022/2032 (XS2455983861); 0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Anleihe 2020/2025 (XS2171210862); 0,1250 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2028 (FR0013482833); 1,0000 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2024 (XS2002491517); 1,3750 % NatWest Markets PLC - Anleihe 2022/2027 (XS2449911143); 0,5000 % Nordea Bank Abp - Medium Term Notes 2021/2028 (XS2403444677); 2,5000 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2022/2029 (XS2482618464); 1,2880 % Prosus N.V. - Medium Term Notes 2021/2029 (XS2360853332); 0,1250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2020/2026 (FR0013486701); 0,6250 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2027 (XS2325733413); 0,7500 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2029 (XS2356040357); 0,8000 % Thermo Fisher Scientific [Finance I] B.V. - Medium Term Notes 2021/2021 (XS2366407018); 1,9940 % TotalEnergies Capital International S.A. - Medium Term Notes 2020/2032 (XS2153409029); 0,2500 % UBS Group AG - Floating Rate Medium Term 2020/2028 (CH0576402181); 0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2021/2024 (XS2343821794); 0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028 (XS2234567233))

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.03.2022 bis zum 28.02.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		369.012,95	0,134
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		3.016.344,08	1,093
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		14.586,10	0,005
4. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		11.768,74	0,004
Summe der Erträge		3.411.711,87	1,236
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-1.596,63	-0,001
2. Verwaltungsvergütung		-516.009,65	-0,187
3. Sonstige Aufwendungen		-9.279,38	-0,003
davon: Negative Einlagezinsen			-0,003
Summe der Aufwendungen	-9.279,38	-526.885,66	-0,191
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		2.884.826,21	1,045
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		675.206,35	0,245
2. Realisierte Verluste		-31.284.194,04	-11,337
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-30.608.987,69	-11,092
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-27.724.161,48	-10,047
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		141.100,76	0,051
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-3.882.118,14	-1,407
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-3.741.017,38	-1,356
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-31.465.178,86	-11,403
<b>Entwicklung des Sondervermögens</b>		2022 / 2023	
	EUR	EUR	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		275.678.365,48	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-309.917,79	
2. Zwischenausschüttungen		-4.561.478,55	
3. Mittelzufluss (netto)		20.865.127,52	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	132.439.087,40		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-111.573.959,88		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		2.968.066,24	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-31.465.178,86	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	141.100,76		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-3.882.118,14		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		263.174.984,04	
<b>Verwendung der Erträge des Sondervermögens</b>			
	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		7.904.881,75	2,865
1. Vortrag aus dem Vorjahr		35.629.043,23	12,911
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-27.724.161,48	-10,047
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		2.377.584,15	0,862
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		2.377.584,15	0,862
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		5.527.297,60	2,003
1. Zwischenausschüttung		4.561.478,55	1,653
2. Endausschüttung		965.819,05	0,350

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

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

## Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre Geschäftsjahr

	<b>Sondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR</b>	<b>Anteilwert EUR</b>
2022/2023	263.174.984,04	95,37
2021/2022	275.678.365,48	108,32
2020/2021	303.675.261,26	113,83
2019/2020	403.818.877,07	114,09

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF Anhang.

## Angaben nach der Derivateverordnung

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

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	95,37
Umlaufende Anteile	STK	2.759.483,00

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>		<b>99,28</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>		<b>0,00</b>

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 28.02.2023 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 28.02.2023 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

<b>Gesamtkostenquote (in %)</b>		<b>0,20</b>
---------------------------------	--	-------------

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

<b>Transaktionskosten</b>	<b>EUR</b>	<b>0,00</b>
---------------------------	------------	-------------

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

<b>Erfolgt die Abwicklung von Zeichnungen bzw. Rücknahmen von Anteilscheinen mit den sog. Market Makern nicht über die Bereitstellung bzw. Abnahme der betreffenden Wertpapiere, sondern über Bankguthaben, werden die Transaktionskosten, die dadurch entstehen, dass die Deka Investment die Wertpapiere über andere Broker beschafft bzw. veräußert, durch den Marker Maker ersetzt und dem Sondervermögen gutgeschrieben. Die oben genannten Transaktionskosten reduzieren sich deshalb um folgenden Betrag:</b>	<b>EUR</b>	<b>151,98</b>
--	------------	---------------

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00 %.

Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

### Angaben zu den Kosten

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,26
Höhe der Annual Tracking Difference	0,30

Die durchschnittliche Höhe des gehaltenen Bankguthabens und die Transaktionskosten, die beim Nachvollzug von Indexanpassungen anfallen, sind wesentliche Einflussfaktoren auf den Tracking Error und im konkreten Fall ursächlich dafür, dass der im Berichtszeitraum tatsächlich realisierte Tracking Error oberhalb der prognostizierten Bandbreite für den Tracking Error lag.

### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

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

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -9.251,03 enthalten.

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

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

### Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB:

Basierend auf dem Gesetz zur Umsetzung der zweiten Aktionärsrechterichtlinie (ARUG II) macht die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu § 134c Abs. 4 AktG folgende Angaben:

### Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken:

Informationen zu den wesentlichen allgemeinen mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens sind im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Risikohinweise“ aufgeführt. Für die konkreten wesentlichen Risiken im Geschäftsjahr verweisen wir auf den Tätigkeitsbericht.

### Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten:

Die Zusammensetzung des Portfolios und die Portfolioumsätze können der Vermögensaufstellung bzw. den Angaben zu den während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäften, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, entnommen werden. Die Portfolioumsatzkosten werden im Anhang des vorliegenden Jahresberichts ausgewiesen (Transaktionskosten).

### Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung:

Das Sondervermögen bildet möglichst genau die Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index ab, sodass die mittel- bis langfristige Entwicklung der jeweiligen Gesellschaften kein Entscheidungskriterium für Investitionen ist.

### Einsatz von Stimmrechtsberatern:

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern informieren der Mitwirkungsbericht sowie der Stewardship Code der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Dokumente stehen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueberuns> (Corporate Governance).

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

## Handhabung der Wertpapierleihe und Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten:

Auf inländischen Hauptversammlungen von börsennotierten Aktiengesellschaften übt die Kapitalverwaltungsgesellschaft das Stimmrecht entweder selbst oder über Stimmrechtsvertreter aus. Verleihe Aktien werden rechtzeitig an die Kapitalverwaltungsgesellschaft zurückübertragen, sodass diese das Stimmrecht auf Hauptversammlungen wahrnehmen kann. Für die in den Sondervermögen befindlichen ausländischen Aktien erfolgt die Ausübung des Stimmrechts insbesondere bei Gesellschaften, die im EURO STOXX 50® oder STOXX Europe 50® vertreten sind, sowie für US-amerikanische und japanische Gesellschaften mit signifikantem Bestand, falls diese Aktien zum Hauptversammlungstermin nicht verliehen sind. Zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften informiert der Stewardship Code und der Mitwirkungsbericht der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die entsprechenden Dokumente stehen Ihnen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueberuns> (Corporate Governance).

## Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka Investment GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme. Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung“ (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft

## Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeiter und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlagerfolgspremien, werden bei der Deka Investment GmbH nicht gewährt.

## Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeiters, der Erfolgsbeitrag der Deka Investment GmbH bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeiters werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeiter erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

## Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitern

Die variable Vergütung der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und von Mitarbeitern, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitern (zusammen als „risikorelevante Mitarbeiter“) unterliegt folgenden Regelungen:

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeiter ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitern unterhalb der Geschäftsführungs-Ebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
- Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 75 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

## Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2022 fand im Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2022 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

	EUR
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung</b>	<b>57.636.189,51</b>
davon feste Vergütung	43.854.381,97
davon variable Vergütung	13.781.807,54
Zahl der Mitarbeiter der KVG	461,00
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**</b>	<b>11.962.579,80</b>
Geschäftsführer	2.094.112,05
weitere Risktaker	1.991.350,34
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	387.352,00
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risktaker	7.489.765,41

\* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt

\*\* weitere Risktaker: alle sonstigen Risktaker, die nicht Geschäftsführer oder Risktaker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risktaker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risktaker oder Geschäftsführer befinden.

# Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

---

Frankfurt am Main, den 25. Mai 2023  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

**An die Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main**

## Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. März 2022 bis zum 28. Februar 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. März 2022 bis zum 28. Februar 2023 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht 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 des Jahresberichts 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 des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der KVG 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 zum Jahresbericht zu dienen.

## Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die allgemeinen Angaben zum Management und zur Verwaltung des Sondervermögens.

Unser Prüfungsurteil zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und dementsprechend geben wir

diesbezüglich weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht des Sondervermögens Name des Fonds unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

## Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der KVG sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, 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 in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die KVG zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

## Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht 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 dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts 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 falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts 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 KVG abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der KVG bei der Aufstellung des Jahresberichts 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 KVG aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht 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 KVG nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, 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 bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 31. Mai 2023

## **Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft**

Andreas Koch  
Wirtschaftsprüfer

Mathias Bunge  
Wirtschaftsprüfer



# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

17. Mai 1995; die Gesellschaft übernahm das Investmentgeschäft der am 17. August 1956 gegründeten Deka Deutsche Kapitalanlagegesellschaft mbH.

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2021

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 93,1 Mio.

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Dr. Matthias Danne  
Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main und der WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf

### Stellvertretende Vorsitzende

Birgit Dietl-Benzin  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;  
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 28. Februar 2023

Die vorstehenden Angaben werden in den Jahres- und ggf. Halbjahresberichten jeweils aktualisiert.



**Deka Investment GmbH**

Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
[www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de)

