

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2024.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 1-10 UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

**.iDeka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Der iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 (Preis-)Index ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC oder seinen Tochtergesellschaften („SPDJI“) und wurde zur Verwendung durch die Deka Investment GmbH lizenziert. S&P®, S&P 500®, US 500, The 500, iBoxx®, iTraxx® und CDX® sind Marken von S&P Global, Inc. oder seinen Tochtergesellschaften („S&P“). Dow Jones® ist eine eingetragene Marke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“). Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF wird von SPDJI, Dow Jones, S&P, ihren jeweiligen Tochtergesellschaften weder gesponsert, unterstützt, verkauft noch gefördert und keine dieser Parteien macht eine Zusicherung hinsichtlich der Ratsamkeit der Investition in dieses Produkt oder übernimmt Haftung für Fehler, Auslassungen oder Störungen des iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 (Preis-)Index.

# Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2024

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2024 bis zum 31. August 2024.

Sinkende Inflationszahlen stabilisierten in den vergangenen sechs Monaten die Finanzmärkte. In Deutschland und vielen anderen Ländern der Europäischen Währungsunion fielen die Inflationszahlen zuletzt im August sehr erfreulich aus und bewegten sich letztlich im Zielkorridor der Europäischen Zentralbank (EZB). Auf konjunktureller Seite bot sich ein uneinheitliches Bild. Das deutsche Bruttoinlandsprodukt schrumpfte im zweiten Quartal und bleibt damit schwunglos. Für die USA bot sich ein freundlicheres Bild, denn das US-BIP überraschte weiter positiv und zeugt von einer robusten Konjunktur. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken ist weiterhin auf die Inflationsbekämpfung ausgerichtet. Im ersten Quartal 2024 sorgten die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und zwischenzeitlich wieder steigende Renditen. Die Fed behielt daher über die Berichtsperiode das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei, signalisierte aber zuletzt eine baldige erste Zinssenkung. Die EZB verringerte den Hauptrefinanzierungssatz bereits im Juni von 4,50 Prozent auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger Euroland-Staatsanleihen lag Ende August bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 3,9 Prozent. Damit gingen die Renditen auf Halbjahressicht leicht zurück.

Die globalen Zinssenkungserwartungen waren ein Antriebsfaktor für die Kurse der weltweiten Aktienmärkte, die sich in der Breite in einer freundlichen Verfassung zeigten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten zwischenzeitlich jeweils auf ein Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Nach der überraschenden Leitzinserhöhung der japanischen Notenbank Anfang August sackten die weltweiten Aktienkurse kurzzeitig ab. Die Märkte konnten sich jedoch dank überzeugender Wachstumsdaten für die USA und die Eurozone sowie solider Unternehmensgewinne rasch in Richtung ihrer historischen Höchststände erholen.

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilhaber im Internet unter [www.deka-etf.de](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.

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

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 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 iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der größten und umsatzstärksten europäischen Staatsanleihen ab und besteht aus maximal 25 Einzelwerten unterschiedlicher Euro-Länder mit einer Restlaufzeit von 1,5 bis 10,5 Jahren. Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrunde liegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt.

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

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

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

## Wichtige Kennzahlen

### Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

Performance*	6 Monate
	2,48%
ISIN	DE000ETFL110

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FR0013516549	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(30) 20301124
Löschung	NL0015031501	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(27) 20270114
Löschung	NL0014555419	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(30) 20300714
Löschung	NL0015000QL2	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2022(26) 20260114
Löschung	DE0001102507	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814
Löschung	IT0005416570	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(27) 20270914
Löschung	ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030
Löschung	IT0005413171	1.650000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20301130
Löschung	FR001400FYQ4	2.500000 % Frankreich EO-OAT 2023(26) 20260923
Löschung	ES0000012L78	3.550000 % Spanien EO-Bonos 2023(33) 20331030
Löschung	IT0005518128	4.400000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(33) 20330430
Neuaufnahme	NL0015000LS8	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(29) 20290114
Neuaufnahme	ES0000012H41	0.100000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20310429
Neuaufnahme	NL0015000RP1	0.500000 % Niederlande EO-Bonds 2022(32) 20320714
Neuaufnahme	IT0005436693	0.600000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(31) 20310731
Neuaufnahme	ES0000012K20	0.700000 % Spanien EO-Bonos 2022(32) 20320429
Neuaufnahme	FR001400BKZ3	2.000000 % Frankreich EO-OAT 2022(32) 20321124
Neuaufnahme	DE000BU2Z023	2.200000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2024 (2034) 20340214
Neuaufnahme	FR001400HI98	2.750000 % Frankreich EO-OAT 2023(29) 20290224
Neuaufnahme	BE0000360694	2.850000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2024(34) 20341021
Neuaufnahme	IT0005519787	3.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(29) 20291214
Neuaufnahme	IT0005518128	4.400000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(33) 20330430

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
DE000BU2Z007	2.300000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) 20330214	5,73
DE000BU2Z023	2.200000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2024 (2034) 20340214	5,18
FR001400HI98	2.750000 % Frankreich EO-OAT 2023(29) 20290224	5,10
ES0000012I08	0.000000 % Spanien EO-Obligaciones 2021(28) 20280130	5,05
ES0000012K53	0.800000 % Spanien EO-Bonos 2022(29) 20290729	4,87
IT0005519787	3.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(29) 20291214	4,84
FR001400AIN5	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2022(28) 20280224	4,66
FR0014002WK3	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(31) 20311124	4,63
ES0000012H41	0.100000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20310429	4,60
ES0000012K20	0.700000 % Spanien EO-Bonos 2022(32) 20320429	4,59
IT0005518128	4.400000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(33) 20330430	4,57
FR001400BKZ3	2.000000 % Frankreich EO-OAT 2022(32) 20321124	4,56
IT0005422891	0.900000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(31) 20310331	4,47
DE0001102564	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) 20310814	4,11
DE0001102580	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2032) 20320214	3,93
BE0000357666	3.000000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2023(33) 20330621	3,68
IT0005436693	0.600000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(31) 20310731	3,56
AT0000A324S8	2.900000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33) 20330219	3,46
NL0015000LS8	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(29) 20290114	2,98
BE0000360694	2.850000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2024(34) 20341021	2,78
BE0000354630	0.350000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2022(32) 20320621	2,76
AT0000A2NW83	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(31) 20310219	2,64
NL00150006U0	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(31) 20310714	2,56
NL0015000RP1	0.500000 % Niederlande EO-Bonds 2022(32) 20320714	2,35
BE0000352618	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2021(31) 20311021	2,34

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2024.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>56.180.743,81</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		55.795.578,41	99,33
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	12.641.815,06		22,51
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	14.941.850,59		26,60
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	26.661.805,27		47,46
- Restlaufzeit über 10 Jahre	1.550.107,49		2,76
2. Forderungen		327.260,29	0,58
3. Bankguthaben		57.905,11	0,10
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-7.784,93</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>56.172.958,88</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. August 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
Inland										
DE0001102564	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031		EUR	2.656	608	648	% 86,359	2.293.695,04	4,08	
DE0001102580	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesschatzanweisungen 2022/2032		EUR	2.573	591	630	% 85,319	2.195.257,87	3,91	
DE000BU2Z023	2,2000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2024/2034		EUR	2.905	2.905	0	% 99,526	2.891.230,30	5,15	
DE000BU2Z007	2,3000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2023/2033		EUR	3.175	727	774	% 100,722	3.197.923,50	5,69	
							EUR	10.578.106,71	18,83	
Ausland										
BE0000352618	0,0000 % Belgien, Königreich - Bons 2021/2031		EUR	1.574	330	312	% 83,049	1.307.191,26	2,33	
BE0000354630	0,3500 % Belgien, Königreich - Anleihe 2022/2032		EUR	1.840	385	365	% 83,586	1.537.982,40	2,74	
BE0000360694	2,8500 % Belgien, Königreich - Obligations 2024/2034		EUR	1.552	1.552	0	% 99,878	1.550.107,49	2,76	
BE0000357666	3,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2023/2033		EUR	2.014	421	399	% 101,875	2.051.754,44	3,65	
FR0014002WK3	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2031		EUR	3.147	735	566	% 82,168	2.585.826,96	4,60	
FR001400AIN5	0,7500 % Frankreich - Anleihe 2022/2028		EUR	2.766	581	544	% 93,958	2.598.878,28	4,63	
FR001400BKZ3	2,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2021/2032		EUR	2.710	2.710	0	% 93,880	2.544.148,00	4,53	
FR001400HI98	2,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2023/2029		EUR	2.834	2.979	145	% 100,396	2.845.222,64	5,07	
IT0005436693	0,5000 % Italien, Republik - Anleihe 2021/2031		EUR	2.379	2.379	0	% 83,441	1.985.061,39	3,53	
IT0005422891	0,9000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2031		EUR	2.899	721	523	% 86,041	2.494.328,59	4,44	
IT0005519787	3,8500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2022/2029		EUR	2.608	2.739	131	% 103,489	2.698.993,12	4,80	
IT0005518128	4,4000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2022/2033		EUR	2.385	2.646	2.620	% 106,881	2.549.119,72	4,54	
NL0015000LS8	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2029		EUR	1.840	1.930	90	% 90,306	1.661.630,40	2,96	
NL00150006U0	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2031		EUR	1.683	352	333	% 84,907	1.428.984,81	2,54	
NL0015000RP1	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2022/2032		EUR	1.521	1.521	0	% 86,136	1.310.128,56	2,33	
AT0000A2NW83	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2021/2031		EUR	1.745	386	317	% 84,520	1.474.878,36	2,63	
AT0000A324S8	2,9000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	1.910	454	339	% 101,185	1.932.628,73	3,44	
ES0000012K53	0,8000 % Spanien - Anleihe 2022/2029		EUR	2.970	703	539	% 91,485	2.717.114,30	4,84	
ES0000012H41	0,1000 % Spanien - Bonos 2021/2031		EUR	3.056	3.212	156	% 83,963	2.565.909,28	4,57	
ES0000012K20	0,7000 % Spanien - Bonos 2022/2032		EUR	2.995	2.995	0	% 85,430	2.558.613,53	4,55	
ES0000012I08	0,0000 % Spanien - Obligaciones 2021/2028		EUR	3.076	728	558	% 91,644	2.818.969,44	5,02	
							EUR	45.217.471,70	80,50	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	55.795.578,41	99,33
Bankguthaben, nicht verbrieftete Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	57.905,11	0,10
EUR-Guthaben bei:										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	57.905,11			% 100,000	57.905,11	0,10	
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	327.260,29	0,58
	Zinsansprüche		EUR	327.260,29				327.260,29	0,58	
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-7.784,93	-0,01
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-7.784,93				-7.784,93	-0,01	
Fondsvermögen								EUR	56.172.958,88	100,00 <sup>1)</sup>
	Anteilwert						EUR	101,25		
	Umlaufende Anteile						STK	554.786,00		

<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 30.08.2024

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

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>					
DE0001102507	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031	EUR	536	3.358	
<b>Ausland</b>					
FR0013516549	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2030	EUR	550	3.702	
FR001400FYQ4	2,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2022/2026	EUR	291	2.913	
IT0005416570	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2027	EUR	417	2.796	
IT0005413171	1,6500 % Italien, Republik - Anleihe 2020/2030	EUR	446	2.999	
NL0015031501	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2027	EUR	306	2.047	
NL0014555419	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2030	EUR	172	1.723	
NL0015000QL2	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2022/2026	EUR	280	1.916	
ES0000012G34	1,2500 % Spanien - Anleihe 2020/2030	EUR	590	3.362	
ES0000012L78	3,5500 % Spanien - Bonos 2023/2033	EUR	282	2.832	

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.03.2024 bis zum 31.08.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		41.385,45	0,075
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		246.110,17	0,444
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		3.947,92	0,007
Summe der Erträge		291.443,54	0,525
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-39.163,04	-0,071
Summe der Aufwendungen		-39.163,04	-0,071
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		252.280,50	0,455
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		272.322,87	0,491
2. Realisierte Verluste		-697.341,10	-1,257
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-425.018,23	-0,766
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-172.737,73	-0,311
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		236.281,50	0,426
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		1.146.435,81	2,066
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		1.382.717,31	2,492
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		1.209.979,58	2,181

Entwicklung des Sondervermögens

	2024 / 2025
	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	53.922.965,69
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-234.501,56
2. Zwischenausschüttungen	-134.942,22
3. Mittelzufluss (netto)	1386.576,10
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	11.544.661,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-10.158.084,90
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	22.881,29
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	1.209.979,58
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	236.281,50
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	1.146.435,81
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	56.172.958,88

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 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	101,25
Umlaufende Anteile	STK	554.786,00

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**

**99,33**

**Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)**

**0,00**

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)

0,07

### 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.

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

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

---

Frankfurt am Main, den 2. September 2024

Deka Investment GmbH

Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2023

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

### Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

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

### Stellvertretende Vorsitzende

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

### Mitglieder

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Peter Scherkamp, München

Dr. Bernd Türk, Frankfurt am Main

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter

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

Thomas Schneider

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

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

### Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. August 2024

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



**Deka Investment GmbH**

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

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

