

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2020.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 1-3 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.

31. August 2020

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2020 bis zum 31. August 2020.

Zu Beginn des Berichtszeitraums befand sich die globale Wirtschaft bereits tief in der Corona-Krise. Die Beschränkungen der Verkehrsfreiheit und weitgehende Lockdown-Maßnahmen trübten die weltweiten Konjunkturperspektiven in unvergleichbarem Ausmaß ein. Die Ende Juli veröffentlichten BIP-Daten der USA und Deutschlands für das zweite Quartal 2020 dokumentierten den dramatischen Einbruch der Wirtschaftsleistung, wobei sich seit Mai die Anzeichen für eine Erholung häufen. Die positiven Tendenzen setzten sich auch gegen Ende der Berichtsperiode mit ermutigenden Zahlen fort. So erholte sich beispielsweise das ifo Geschäftsklima und auch der Arbeitsmarkt in den USA zeigte sich stabiler.

Seitens der Geld- und Fiskalpolitik erfolgte als Reaktion auf die durch die Corona-Krise gestiegenen konjunkturellen Risiken die Implementierung umfangreicher Unterstützungspakete. Die EZB stockte im Verlauf der Pandemie ihr PEPP-Anleihekaufprogramm auf 1,35 Bio. Euro auf. Auch die US-Notenbank kauft mittlerweile direkt Unternehmensanleihen und senkte die Leitzinsen massiv. Zudem verkündete sie im August eine bemerkenswerte Umorientierung, die die bisherige Ausrichtung der Geldpolitik an der Inflationsmarke von 2 Prozent flexibler sieht und die Beschäftigung stärker in den Fokus nimmt. Ende August rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei knapp minus 0,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries mit plus 0,7 Prozent und damit auf signifikant niedrigerem Niveau als Anfang März.

Ein Großteil der Aktienmärkte befand sich aufgrund der pessimistischen Pandemie-Szenarien Anfang März bereits im freien Fall. Die staatlichen Hilfspakete, die Versorgung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken sowie die Hoffnung auf eine Eindämmung der Pandemie sorgten im Anschluss jedoch für eine spürbare Beruhigung der Märkte und eine kräftige Gegenbewegung. Das Gros der etablierten Aktienbörsen konnte auf Halbjahressicht dementsprechend teils deutliche Kurszuwächse verbuchen.

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 2020	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2020	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 1-3 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 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 1-3 (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 3,5 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).

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.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	-0,3%	-0,9%	-0,1%

<b>ISIN</b>	DE000ETFL128
-------------	--------------

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	DE0001141745	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.174 v.2016(21) 20211007
Löschung	IT0005388928	0.000000 % Italien, Republik EO-C.T.Z. 2019(21) 20211128
Löschung	NL0011896857	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2016(22) 20220114
Löschung	ES0000012C46	0.050000 % Spanien EO-Bonos 2018(21) 20211030
Löschung	BE0000339482	0.200000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(23) Ser. 79 20231021
Löschung	IT0005366007	1.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(22) 20220714
Löschung	IT0005244782	1.200000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(22) 20220331
Löschung	NL0010418810	1.750000 % Niederlande EO-Anl. 2013(23) 20230714
Löschung	AT0000A001X2	3.500000 % Österreich, Republik EO-Med.-T. Nts 2006(21) 144A 20210914
Löschung	BE0000321308	4.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2011(21) Ser. 61 20210927
Löschung	BE0000325341	4.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2012(22) Ser. 65 20220927
Neuaufnahme	DE0001141786	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23) 20231012
Neuaufnahme	FI4000219787	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(23) 20230914
Neuaufnahme	IT0005388928	0.000000 % Italien, Republik EO-C.T.Z. 2019(21) 20211128
Neuaufnahme	NL0012650469	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2017(24) 20240114
Neuaufnahme	AT0000A2EJZ6	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230419
Neuaufnahme	ES0000012F84	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(23) 20230429
Neuaufnahme	BE0000339482	0.200000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(23) Ser. 79 20231021
Neuaufnahme	SI0002103974	0.200000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2020(23) 20230330
Neuaufnahme	IT0005244782	1.200000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(22) 20220331
Neuaufnahme	NL0010418810	1.750000 % Niederlande EO-Anl. 2013(23) 20230714
Neuaufnahme	IT0005344335	2.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(23) 20230930

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0013283686	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2017(23) 20230324	7,03
FR0013219177	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2016(22) 20220524	5,56
DE0001141752	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.175 v.2017(22) 20220407	5,30
ES0000012B62	0.350000 % Spanien EO-Bonos 2018(23) 20230729	5,27
ES0000012801	0.400000 % Spanien EO-Obligaciones 2017(22) 20220429	5,17
FR0013398583	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(22) 20220224	5,13
NL0010418810	1.750000 % Niederlande EO-Anl. 2013(23) 20230714	5,11
IT0005344335	2.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(23) 20230930	5,08
DE0001141760	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.176 v.2017(22) 20221006	5,06
IT0005277444	0.900000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(22) 20220731	5,02
ES0000012F84	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(23) 20230429	4,95
DE0001141786	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23) 20231012	4,83
DE0001141778	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.177 v.2018(23) 20230413	4,82
ES0000012A97	0.450000 % Spanien EO-Bonos 2017(22) 20221030	4,64
IT0005325946	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(23) 20230228	4,63
IT0005244782	1.200000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(22) 20220331	4,61
NL0012650469	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2017(24) 20240114	4,26
AT0000A1PE50	0.000000 % Österreich, Republik EO-Bundesobl. 2016(23) 20230714	2,65
FR0013479102	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(23) 20230224	2,30
AT0000A1XM92	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20220919	1,92
AT0000A2EJZ6	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230419	1,71
FI4000219787	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(23) 20230914	1,60
FI4000242862	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2017(22) 20220414	1,42
IE00BDHDPQ37	0.000000 % Irland EO-Treasury Bonds 2017(22) 20221017	1,40
SI0002103974	0.200000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2020(23) 20230330	0,55

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2020.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>130.746.543,07</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		129.119.802,79	98,77
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	108.758.973,80		83,19
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	20.360.828,99		15,57
2. Forderungen		173.974,52	0,13
3. Bankguthaben		1.452.765,76	1,11
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-17.348,72</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>130.729.194,35</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. August 2020.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2020	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
Inland										
DE0001141760	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2017/2022		EUR	6.439	1.602.000	3.051	% 101,399	6.529.081,61	4,99	
DE0001141752	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2017/2022		EUR	6.769	2.475.000	2.805	% 101,043	6.839.608,79	5,23	
DE0001141778	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023		EUR	6.109	2.298.000	2.500	% 101,793	6.218.544,76	4,76	
DE0001141786	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023		EUR	6.109	6.479.000	370	% 102,157	6.240.790,07	4,77	
							EUR	25.828.025,23	19,76	
Ausland										
FI4000219787	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2023		EUR	2.024	2.354	330	% 101,848	2.061.408,98	1,58	
FI4000242862	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2017/2022		EUR	1.822	786	936	% 100,967	1.839.618,74	1,41	
FR0013283686	0,0000 % Frankreich - OAT 2017/2023		EUR	8.941	2.234	4.846	% 101,528	9.077.635,47	6,94	
FR0013219177	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2016/2022		EUR	7.111	1.569	5.066	% 101,037	7.184.741,07	5,50	
FR0013398583	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2022		EUR	6.569	1.450	4.681	% 100,881	6.626.899,82	5,07	
FR0013479102	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2023		EUR	2.923	2.236	516	% 101,427	2.964.702,44	2,27	
IE00BDHDPQ37	0,0000 % Irland - Treasury Bonds 2017/2022		EUR	1.787	798	1.022	% 101,172	1.807.934,71	1,38	
IT0005277444	0,9000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2022		EUR	6.361	2.186	2.985	% 101,845	6.478.373,81	4,96	
IT0005325946	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2023		EUR	5.841	1.885	2.803	% 102,254	5.972.680,09	4,57	
IT0005244782	1,2000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2022		EUR	5.835	6.321	7.053	% 102,043	5.954.203,80	4,55	
IT0005344335	2,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2023		EUR	6.125	6.672	547	% 107,099	6.559.842,54	5,02	
NL0012650469	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2017/2024		EUR	5.389	5.389	0	% 102,037	5.498.787,40	4,21	
NL0010418810	1,7500 % Niederlande - Anleihe 2013/2023		EUR	6.170	6.685	7.460	% 106,862	6.593.375,53	5,04	
AT0000A2EJZ6	0,0000 % Österreich, Republik - Anleihe 2020/2023		EUR	2.169	2.289	120	% 101,556	2.202.749,42	1,68	
AT0000A1PE50	0,0000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2023		EUR	3.360	1.574	1.887	% 101,695	3.416.960,40	2,61	
AT0000A1XM92	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2017/2022		EUR	2.445	1.158	1.367	% 101,258	2.475.745,88	1,89	
SI0002103974	0,2000 % Slowenien, Republik - Anleihe 2020/2023		EUR	701	836	135	% 101,620	712.356,62	0,54	
ES0000012B62	0,3500 % Spanien - Bonos 2018/2023		EUR	6.667	1.931	2.989	% 102,088	6.806.204,96	5,21	
ES0000012A97	0,4500 % Spanien - MTN 2017/2022		EUR	5.878	1.423	2.911	% 101,930	5.991.445,40	4,58	
ES0000012801	0,4000 % Spanien - Obligaciones 2017/2022		EUR	6.578	1.592	3.257	% 101,433	6.672.260,77	5,10	
ES0000012F84	0,0000 % Spanien, Königreich - Anleihe 2020/2023		EUR	6.332	6.333	1	% 100,977	6.393.849,71	4,89	
							EUR	103.291.777,56	79,01	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	129.119.802,79	98,77
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	1.452.765,76	1,11
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle								EUR	1.452.765,76	1,11
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	173.974,52	0,13
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen								EUR	33,23	0,00
Zinsansprüche								EUR	173.941,29	0,13
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-17.348,72	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung								EUR	-17.348,72	-0,01
Fondsvermögen								EUR	130.729.194,35	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert								EUR	96,47	
Umlaufende Anteile								STK	1.355.160,00	

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.08.2020

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

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzugang 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>					
DE0001141745	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2016/2021	EUR	555	8.049	
<b>Ausland</b>					
BE0000339482	0,2000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2023	EUR	3.847	3.847	
BE0000321308	4,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2011/2021	EUR	474	6.881	
BE0000325341	4,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2012/2022	EUR	468	6.778	
IT0005388928	0,0000 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2021	EUR	6.742	6.742	
IT0005366007	1,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2019/2022	EUR	499	7.230	
NL0011896857	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2016/2022	EUR	2.211	8.277	
AT0000A001X2	3,5000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2005/2021	EUR	465	6.745	
ES0000012C46	0,0500 % Spanien - Bonos 2018/2021	EUR	1.351	9.612	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			33.458

(Basiswerte: 0,2000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2023 (BE0000339482); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2016/2021 (DE0001141745); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023 (DE0001141786); 0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2016/2022 (FR0013219177); 0,0000 % Niederlande - Anleihe 2016/2022 (NL0011896857); 1,7500 % Niederlande - Anleihe 2013/2023 (NL0010418810); 0,4500 % Spanien - MTN 2017/2022 (ES0000012A97); 0,4000 % Spanien - Obligaciones 2017/2022 (ES0000012801))

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.03.2020 bis zum 31.08.2020

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		282.429,03	0,208
2. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		3.456,57	0,003
Summe der Erträge		285.885,60	0,211
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-94.129,74	-0,069
2. Sonstige Aufwendungen		-3.776,48	-0,003
davon: Negative Einlagezinsen	-3.776,48		-0,003
Summe der Aufwendungen		-97.906,22	-0,072
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		187.979,38	0,139
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		130.907,83	0,097
2. Realisierte Verluste		-1.364.890,50	-1,007
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.233.982,67	-0,911
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-1.046.003,29	-0,772
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-56.629,74	-0,042
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		398.529,94	0,294
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		341.900,20	0,252
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-704.103,09	-0,520

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2020 / 2021 EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		170.243.703,74
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-240.577,20
2. Zwischenausschüttungen		-138.617,60
3. Mittelzufluss (netto)		-38.466.863,40
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	26.600.935,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-65.067.798,40	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		35.651,90
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-704.103,09
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-56.629,74	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	398.529,94	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		130.729.194,35

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

## Anhang.

### Angaben nach der Derivateverordnung

**Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR **3.651,89**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 3.651,89. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.

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

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	96,47
Umlaufende Anteile	STK	1.355.160,00

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>98,77</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 31.08.2020 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 31.08.2020 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 0,03

### 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 -4.056,49 enthalten.

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

#### Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds		
	absolut	3.651,89
	in % der Bruttoerträge	100,00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)		
	absolut	0,00
	in % der Bruttoerträge	0,00

**Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (absoluter Betrag)** Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

---

Frankfurt am Main, den 1. September 2020  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 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 2019

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 93,2 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 Ostsächsischen Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)

Jörg Boysen

Thomas Ketter

Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

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

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Square  
Am Flughafen  
60549 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 2020

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



**Deka Investment GmbH**

Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39  
[www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de)