

Halbjahresbericht
zum 31. August 2021.

**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 2021

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 2021 bis zum 31. August 2021.

Die europäische Wirtschaft litt im Berichtszeitraum zunächst weiterhin unter den Belastungen der Corona-Pandemie. So schrumpfte in Deutschland die gesamtwirtschaftliche Leistung im ersten Quartal 2021 merklich. Vor allem der private Konsum büßte durch die Lockdown-Maßnahmen angesichts erneut steigender Infektionszahlen und auftretender Virusmutationen ein. Erst in der zweiten Berichtshälfte mehrten sich die Erholungszeichen und an den Finanzmärkten überwogen optimistische Konjunkturperspektiven. Die Kombination aus erfolgreich verlaufenden Impfmaßnahmen und hoher Liquidität am Markt auf der Suche nach auskömmlichen Renditen befeuerte zudem den Risikoappetit der Anleger.

Eine wichtige Stütze bildete die Geld- und Finanzpolitik. Sowohl die EZB wie auch die US-Notenbank Federal Reserve bekräftigten ihren expansiven Kurs. Zunehmend rückte im Verlauf des Berichtszeitraums die Inflationsentwicklung in den Vordergrund. Die Europäische Zentralbank und viele Marktteilnehmer betrachteten allerdings den teils erheblichen Preisanstieg lediglich als temporäres Phänomen. An den Anleihemärkten war von wachsender Inflationsgefahr wenig zu spüren, die Renditen zeigten sich im Stichtagsvergleich relativ unverändert. Ende August rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei minus 0,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries bei plus 1,3 Prozent.

Die Aktienmärkte erzielten auf Halbjahressicht kräftige Kurssteigerungen, beflügelt von zahlreichen Konjunkturstimuli wie auch der anhaltenden Flutung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken. Einige etablierte Aktienindizes erreichten in diesem Zuge neue Rekordmarken.

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 Anteilinhaber im Internet unter 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 2021	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2021	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigefügt 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.
Performance *	-0,0%	-0,3%	0,1%

ISIN 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	DE0001141760	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.176 v.2017(22) 20221006
Löschung	IE00BDHDPQ37	0.000000 % Irland EO-Treasury Bonds 2017(22) 20221017
Löschung	AT0000A1XM92	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20220919
Löschung	IT0005413684	0.300000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(23) 20230814
Löschung	ES0000012A97	0.450000 % Spanien EO-Bonos 2017(22) 20221030
Löschung	IT0005277444	0.900000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(22) 20220731
Löschung	IT0005325946	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(23) 20230228
Löschung	BE0000325341	4.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2012(22) Ser. 65 20220927
Neuaufnahme	DE0001141802	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24) 20241017
Neuaufnahme	FI4000391529	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(24) 20240914
Neuaufnahme	IT0005424251	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(24) 20240114
Neuaufnahme	IT0005439275	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(24) 20240414
Neuaufnahme	ES0000012H33	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2021(24) 20240530
Neuaufnahme	IT0005282527	1.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(24) 20241114
Neuaufnahme	BE0000328378	2.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2013(23) Ser.68 20230621
Neuaufnahme	BE0000332412	2.600000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72 20240621

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0013344751	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2018(24) 20240324	6,46
FR0013283686	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2017(23) 20230324	6,42
DE0001141794	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.179 v.2019(24) 20240404	5,66
DE0001141802	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24) 20241017	5,44
ES0000012F84	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(23) 20230429	5,20
ES0000012B62	0.350000 % Spanien EO-Bonos 2018(23) 20230729	5,10
FR0014001N46	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(24) 20240224	4,55
DE0001141786	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23) 20231012	4,44
DE0001141778	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.177 v.2018(23) 20230413	4,42
NL0010418810	1.750000 % Niederlande EO-Anl. 2013(23) 20230714	4,36
IT0005439275	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(24) 20240414	4,35
IT0005367492	1.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24) 20240630	4,33
IT0005282527	1.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(24) 20241114	4,31
ES0000012E85	0.250000 % Spanien EO-Bonos 2019(24) 20240729	4,27
IT0005424251	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(24) 20240114	4,01
NL0010733424	2.000000 % Niederlande EO-Anl. 2014(24) 20240714	3,90
BE0000332412	2.600000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72 20240621	3,88
ES0000012H33	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2021(24) 20240530	3,73
NL0012650469	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2017(24) 20240114	3,70
BE0000328378	2.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2013(23) Ser.68 20230621	3,26
AT0000A28KX7	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240714	2,69
FR0013479102	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(23) 20230224	2,59
AT0000A2EJZ6	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230419	1,48
FI4000391529	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(24) 20240914	0,97
SI0002103974	0.200000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2020(23) 20230330	0,48

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		132.221.237,56	100,01
1. Anleihen		130.509.488,64	98,72
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	116.521.087,35		88,14
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	13.988.401,29		10,58
2. Forderungen		110.682,12	0,08
3. Bankguthaben		1.601.066,80	1,21
II. Verbindlichkeiten		-17.950,26	-0,01
III. Fondsvermögen		132.203.287,30	100,00

¹⁾ Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2021.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2021	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE0001141778	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023	EUR		5.704	104	181	% 101,216	5.773.383,46	4,37
DE0001141786	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023	EUR		5.704	104	181	% 101,627	5.796.811,50	4,38
DE0001141794	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024	EUR		7.246	131	228	% 101,985	7.389.824,40	5,59
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024 ²⁾	EUR		6.938	6.976	38	% 102,372	7.102.557,57	5,37
							EUR	26.062.576,93	19,71
Ausland									
BE0000328378	2,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2013/2023	EUR		4.044	4.067	23	% 105,362	4.260.829,17	3,22
BE0000332412	2,6000 % Belgien, Königreich - Obligations 2014/2024	EUR		4.630	4.656	26	% 109,362	5.063.449,03	3,83
FI4000391529	0,0000 % Finnland, Republik - Anleihe 2019/2024	EUR		1.238	1.245	7	% 102,062	1.263.527,68	0,96
FR0014001N46	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2024	EUR		5.845	4.891	0	% 101,627	5.940.112,76	4,49
FR0013283686	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2023	EUR		8.283	168	2.041	% 101,088	8.373.137,26	6,33
FR0013344751	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2024	EUR		8.288	167	2.041	% 101,699	8.428.799,03	6,38
FR0013479102	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2023	EUR		3.343	68	824	% 101,041	3.377.813,33	2,56
IT0005424251	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2024	EUR		5.195	5.224	29	% 100,792	5.236.136,61	3,96
IT0005439275	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2024	EUR		5.640	5.640	0	% 100,755	5.682.582,00	4,30
IT0005282527	1,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2024	EUR		5.334	5.334	0	% 105,405	5.622.316,04	4,25
IT0005367492	1,7500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2024	EUR		5.341	97	169	% 105,754	5.648.310,99	4,27
NL0012650469	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2017/2024	EUR		4.742	86	149	% 101,748	4.824.890,16	3,65
NL0010418810	1,7500 % Niederlande - Anleihe 2013/2023	EUR		5.429	99	172	% 104,710	5.684.680,93	4,30
NL0010733424	2,0000 % Niederlande - Anleihe 2014/2024	EUR		4.722	86	149	% 107,903	5.095.172,58	3,85
AT0000A2EJZ6	0,0000 % Österreich, Republik - Anleihe 2020/2023	EUR		1.909	34	59	% 101,122	1.930.414,97	1,46
AT0000A28KX7	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2019/2024	EUR		3.440	623	0	% 101,985	3.508.289,85	2,65
SI0002103974	0,2000 % Slowenien, Republik - Anleihe 2020/2023	EUR		617	11	19	% 101,439	625.880,54	0,47
ES0000012F84	0,0000 % Spanien - Anleihe 2020/2023	EUR		6.721	123	213	% 101,007	6.788.660,31	5,14
ES0000012E85	0,2500 % Spanien - Bonos 2019/2024	EUR		5.457	512	130	% 102,237	5.579.086,73	4,22
ES0000012B62	0,3500 % Spanien - Bonos 2018/2023	EUR		6.532	119	207	% 101,807	6.650.058,71	5,03
ES0000012H33	0,0000 % Spanien, Königreich - Bonos 2021/2024	EUR		4.797	4.797	0	% 101,371	4.862.763,03	3,68
							EUR	104.446.911,71	79,00
							EUR	130.509.488,64	98,72
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
	Verwahrstelle	EUR		1.601.066,80			% 100,000	1.601.066,80	1,21
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen	EUR		510,24				110.682,12	0,08
	Zinsansprüche	EUR		110.171,88				510,24	0,00
								110.171,88	0,08
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR		-17.950,26				-17.950,26	-0,01
								-17.950,26	-0,01
Fondsvermögen									
	Anteilwert	EUR						132.203.287,30	100,00 ¹⁾
	Umlaufende Anteile	STK						95,79	
								1.380.160,00	

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

²⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung		Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Wertpapierdarlehen Kurswert in EUR		gesamt
				befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:						
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024	EUR	2.566.000		2.626.861,16	
	Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				2.626.861,16	2.626.861,16

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.08.2021

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Inland					
DE0001141760	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2017/2022	EUR	0	6.093	
Ausland					
BE0000325341	4,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2012/2022	EUR	0	4.962	
IE00BDHDPQ37	0,0000 % Irland - Treasury Bonds 2017/2022	EUR	0	1.575	
IT0005413684	0,3000 % Italien, Republik - Anleihe 2020/2023	EUR	93	5.247	
IT0005277444	0,9000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2022	EUR	0	5.672	
IT0005325946	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2023	EUR	94	5.302	
AT0000A1XM92	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2017/2022	EUR	0	2.180	
ES0000012A97	0,4500 % Spanien - Bonos 2017/2022	EUR	105	5.941	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
	unbefristet	EUR			58.927

(Basiswerte: 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2017/2022 (DE0001141760); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023 (DE0001141778); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023 (DE0001141786); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024 (DE0001141802); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024 (DE0001141794); 0,2000 % Slowenien, Republik - Anleihe 2020/2023 (SI0002103974); 0,4500 % Spanien - Bonos 2017/2022 (ES0000012A97))

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2021 bis zum 31.08.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		321.265,17	0,233
2. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		3.187,40	0,002
Summe der Erträge		324.452,57	0,235
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-99.084,72	-0,072
2. Sonstige Aufwendungen		-3.005,46	-0,002
davon: Negative Einlagezinsen	-3.005,46		-0,002
Summe der Aufwendungen		-102.090,18	-0,074
III. Ordentlicher Nettoertrag		222.362,39	0,161
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		58.004,33	0,042
2. Realisierte Verluste		-326.992,30	-0,237
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-268.987,97	-0,195
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-46.625,58	-0,034
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-52.311,81	-0,038
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		33.040,33	0,024
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-19.271,48	-0,014
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-65.897,06	-0,048

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2021 / 2022 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		130.154.262,92
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-135.516,00
2. Zwischenausschüttungen		-149.067,60
3. Mittelzufluss (netto)		2.396.960,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	2.396.960,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		2.545,04
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-65.897,06
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-52.311,81	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	33.040,33	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		132.203.287,30

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 2.626.861,16

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen
 Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten	EUR		2.657.015,00

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich) EUR 3.174,51

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 3.174,51. 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	95,79
Umlaufende Anteile	STK	1.380.160,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,72
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 31.08.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2021 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) 0,03

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 sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -2.995,41.

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

Verwendete Vermögensgegenstände		
	absolut	2.626.861,16
	in % des Fondsvermögens	1,99

10 größte Gegenparteien

	Name
Bruttovolumen offene Geschäfte	Clearstream Banking AG
Sitzstaat	2.626.861,16 Deutschland

Arten von Abwicklung und Clearing

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem) und per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte).

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	0,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	2.626.861,16

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindizes (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder dem GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter www.eurexrepo.com entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag i.H.v. 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	2.657.015,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	0,00

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	3.174,51
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.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

Die hier angegebene Prozentzahl bezieht sich auf das gesamte Wertpapiervermögen des Fonds einschließlich / ausschließlich Anteilen an Zielfonds/ Geldmarktfonds. Die Anlagebedingungen können jedoch Beschränkungen enthalten, so dass das Verleihen ggf. nur in geringerem Umfang zulässig ist.

2,01

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Bankia S.A.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	220.888,76
2. Name	Bremen, Freie Hansestadt
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	141.571,91
3. Name	Italien, Republik
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	118.623,15
4. Name	NRW.BANK
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	78.393,06
5. Name	BPCE S.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	74.675,75
6. Name	BNP Paribas S.A.
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	67.727,46
7. Name	Agence Française de Développement
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	62.723,00
8. Name	Porsche Automobil Holding SE
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	59.596,02
9. Name	Landwirtschaftliche Rentenbank
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	59.351,87
10. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	55.431,10

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	1,00
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	2.657.015,00

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

gesonderte Konten / Depots	0,00
Sammelkonten/Depots	0,00
Andere Konten/Depots	0,00
Verwahrt bestimmt Empfänger	0,00

Frankfurt am Main, den 1. September 2021
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 2020

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 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;
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

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 2021

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