Halbjahresbericht
zum 31. August 2022.

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

Deka Investment GmbH

Finanzgruppe

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 2022

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 2022 bis zum 31. August 2022.

Das Geschehen an den internationalen Kapitalmärkten stand im Berichtszeitraum im Schatten des Ende Februar erfolgten völkerrechtswidrigen Angriffs Russlands auf die Ukraine, in dessen Folge umfangreiche Sanktionsmaßnahmen des Westens gegen den Aggressor auf den Weg gebracht wurden. Russland seinerseits verhängte Gegenmaßnahmen und stoppte die Lieferung von Gas in mehrere europäische Länder oder reduzierte die Liefermengen, was zu weiteren signifikanten Preissteigerungen bei Energie und Rohstoffen führte sowie Befürchtungen hinsichtlich einer Energie-Knappheit im nächsten Winter zur Folge hatte.

Die Geld- und Fiskalpolitik wurde in den vergangenen sechs Monaten von der rasanten Inflationsentwicklung dominiert. Sowohl die EZB als auch die Federal Reserve haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet. Darüber hinaus vollzogen beide Notenbanken die Leitzins-Wende. Während die Fed diesen seit März in vier Schritten um insgesamt 225 Basispunkte erhöhte, folgte die EZB im Juli mit einer ersten Anhebung um 50 Basispunkte. Dank einer stark expansiven Finanzpolitik haben sich die USA rascher als Europa von der Pandemie erholt. Zudem trifft der Krieg gegen die Ukraine die europäische Wirtschaft um ein Vielfaches stärker, wodurch sich Zinserhöhungen für die EZB problematischer darstellen. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen per saldo kräftig an. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 1,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei plus 3,2 Prozent.

Nahezu sämtliche bedeutenden Aktienmärkte weltweit rangierten auf Halbjahres-Sicht im negativen Bereich. Die Inflationsentwicklung, hohe Rohstoffpreise, Lieferkettenprobleme sowie der Krieg in der Ukraine belasteten die Kurse in den letzten sechs Monaten deutlich. Insbesondere Wachstumstitel waren hiervon zeitweise überdurchschnittlich stark betroffen. In China belasteten zudem Lockdown-Maßnahmen und der sich zuletzt verschärfende Taiwan-Konflikt. Signifikant unter Druck geriet auch der Euro, der sich zum US-Dollar in Richtung Parität entwickelte.

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 2022	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2022	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 *	-3,5%	-4,6%	-2,0%

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	DE0001141786	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23) 20231012
Löschung	FR0013344751	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2018(24) 20240324
Löschung	NL0012650469	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2017(24) 20240114
Löschung	IT0005367492	1.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24) 20240630
Löschung	IT0005344335	2.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(23) 20230930
Löschung	ES00000126B2	2.750000 % Spanien EO-Bonos 2014(24) 20241030
Neuaufnahme	DE0001141828	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.182 v.2020(25) 20251009
Neuaufnahme	NL0015000QL2	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2022(26) 20260114
Neuaufnahme	ES0000012K38	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2022(25) 20250530
Neuaufnahme	FR0012517027	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2015(25) 20250524
Neuaufnahme	IT0005367492	1.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24) 20240630
Neuaufnahme	IT0005345183	2.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20251114

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0013415627	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(25) 20250324	6,45
FR0012517027	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2015(25) 20250524	5,91
DE0001141828	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.182 v.2020(25) 20251009	5,44
BE0000334434	0.800000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(25) Ser. 74 20250621	5,33
DE0001141794	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.179 v.2019(24) 20240404	5,22
ES0000012F92	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(25) 20250130	4,99
DE0001141802	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24) 20241017	4,96
NL0011220108	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2015(25) 20250714	4,69
ES0000012H33	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2021(24) 20240530	4,62
IT0005386245	0.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(25) 20250131	4,44
DE0001141810	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.181 v.2020(25) 20250410	4,38
FR0014001N46	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(24) 20240224	4,36
IT0005439275	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(24) 20240414	4,30
NL0010733424	2.000000 % Niederlande EO-Anl. 2014(24) 20240714	4,29
ES0000012E85	0.250000 % Spanien EO-Bonos 2019(24) 20240729	4,20
IT0005345183	2.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20251114	4,19
IT0005408502	1.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(25) 20250630	4,16
BE0000332412	2.600000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72 20240621	3,73
FR0014007TY9	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2021(25) 20250224	3,29
ES0000012K38	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2022(25) 20250530	2,95
AT0000A28KX7	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240714	2,74
NL0015000QL2	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2022(26) 20260114	1,92
AT0000A2QRW0	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(25) 20250419	1,89
FI4000391529	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(24) 20240914	0,95
SK4000017158	0.250000 % Slowakei EO-Anl. 2020(25) 20250513	0,59

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF
Vermögensübersicht zum 31. August 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens[1)]
I. Vermögensgegenstände		**123.807.197,53**	**100,01**
1. Anleihen		122.070.603,95	98,61
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	107.974.068,51		87,22
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	14.096.535,44		11,39
2. Forderungen		118.790,68	0,10
3. Bankguthaben		1.617.802,90	1,31
II. Verbindlichkeiten		**-16.940,48**	**-0,01**
III. Fondsvermögen		**123.790.257,05**	**100,00**

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF
Vermögensaufstellung zum 31. August 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
Inland										
DE0001141828	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2025[2)]		EUR	6.889	7.341	452	%	96,380	6.639.618,20	5,36
DE0001141794	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024[2)]		EUR	6.476	1.665	1.595	%	98,483	6.377.759,08	5,15
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024		EUR	6.201	1.597	1.529	%	97,611	6.052.858,11	4,89
DE0001141810	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2020/2025		EUR	5.512	1.417	1.357	%	97,016	5.347.521,92	4,32
							EUR		24.417.757,31	19,73
Ausland										
BE0000334434	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2015/2025		EUR	6.618	2.298	1.353	%	98,403	6.512.294,00	5,26
BE0000332412	2,6000 % Belgien, Königreich - Obligations 2014/2024		EUR	4.448	1.321	966	%	102,487	4.558.621,76	3,68
FI4000391529	0,0000 % Finnland, Republik - Anleihe 2019/2024		EUR	1.189	353	258	%	97,413	1.158.242,59	0,94
FR0014001N46	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2024		EUR	5.405	1.532	2.246	%	98,548	5.326.505,89	4,30
FR0013415627	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2025		EUR	8.158	2.312	3.391	%	96,484	7.871.137,80	6,36
FR0014007TY9	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2021/2025[2)]		EUR	4.164	3.544	381	%	96,523	4.019.217,72	3,25
FR0012517027	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025		EUR	7.393	7.683	290	%	97,530	7.210.355,94	5,82
IT0005439275	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2024		EUR	5.419	1.608	1.175	%	96,778	5.244.399,82	4,24
IT0005386245	0,3500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2025		EUR	5.693	1.701	1.587	%	95,267	5.423.554,30	4,38
IT0005408502	1,8500 % Italien, Republik - Anleihe 2020/2025		EUR	5.176	1.543	1.427	%	98,022	5.073.592,84	4,10
IT0005345183	2,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2025		EUR	5.138	5.346	208	%	99,486	5.111.577,84	4,13
NL0015000QL2	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2022/2026		EUR	2.460	2.559	99	%	95,339	2.345.339,40	1,89
NL0011220108	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2015/2025		EUR	5.903	1.753	1.281	%	96,944	5.722.604,32	4,62
NL0010733424	2,0000 % Niederlande - Anleihe 2014/2024		EUR	5.159	1.531	1.119	%	101,561	5.239.531,99	4,23
AT0000A28KX7	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	3.432	1.113	722	%	97,595	3.349.473,10	2,71
AT0000A2QRW0	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2021/2025		EUR	2.402	975	461	%	96,201	2.310.743,70	1,87
SK4000017158	0,2500 % Slowakei - Anleihe 2020/2025		EUR	749	315	143	%	95,905	718.328,45	0,58
ES0000012F92	0,0000 % Spanien - Anleihe 2020/2025		EUR	6.335	1.879	1.373	%	96,246	6.097.184,10	4,93
ES0000012K38	0,0000 % Spanien - Anleihe 2022/2025		EUR	3.781	3.988	207	%	95,329	3.604.389,49	2,91
ES0000012E85	0,2500 % Spanien - Bonos 2019/2024		EUR	5.243	1.558	1.139	%	97,683	5.121.519,69	4,14
ES0000012H33	0,0000 % Spanien, Königreich - Bonos 2021/2024		EUR	5.770	1.712	1.251	%	97,647	5.634.231,90	4,55
							EUR		97.652.846,64	78,89
Summe Wertpapiervermögen							EUR		122.070.603,95	98,61
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR		1.617.802,90	1,31
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	1.617.802,90			%	100,000	1.617.802,90	1,31
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR		118.790,68	0,10
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	1.262,74					1.262,74	0,00
Zinsansprüche			EUR	117.527,94					117.527,94	0,09
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR		-16.940,48	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-16.940,48					-16.940,48	-0,01
Fondsvermögen							EUR		123.790.257,05	100,00[1)]
Anteilwert							EUR		91,08	
Umlaufende Anteile							STK		1.359.160,00	

[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 befristet	unbefristet	gesamt
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:						
DE0001141828	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2025	EUR	5.612.000		5.408.845,60	
DE0001141794	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024	EUR	4.746.000		4.674.003,18	
FR0014007TY9	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2021/2025	EUR	700.000		675.661,00	
	Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				10.758.509,78	**10.758.509,78**

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze
Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte — Kurse per 31.08.2022

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Inland					
DE0001141786	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023	EUR	610	5.653	
Ausland					
FR0013344751	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2024	EUR	1.921	10.138	
IT0005367492	1,7500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2024	EUR	4.980	4.980	
IT0005344335	2,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2023	EUR	544	5.043	
NL0012650469	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2017/2024	EUR	1.199	5.391	
ES00000126B2	2,7500 % Spanien - Bonos 2014/2024	EUR	800	7.403	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			24.316

(Basiswerte: 0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2015/2025 (BE0000334434); 2,6000 % Belgien, Königreich - Obligations 2014/2024 (BE0000332412); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2025 (DE0001141828); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023 (DE0001141786); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024 (DE0001141802); 0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2021/2025 (FR0014007TY9))

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2022 bis zum 31.08.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil[1] EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		296.393,94	0,218
2. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		4.661,89	0,003
Summe der Erträge		301.055,83	0,222
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-96.514,34	-0,071
2. Sonstige Aufwendungen		-3.653,55	-0,003
davon: Negative Einlagezinsen	-3.653,55		-0,003
Summe der Aufwendungen		-100.167,89	-0,074
III. Ordentlicher Nettoertrag		200.887,94	0,148
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		4.484,50	0,003
2. Realisierte Verluste		-1.417.218,16	-1,043
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.412.733,66	-1,039
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.211.845,72	-0,892
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		0,00	0,000
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-3.388.820,71	-2,493
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-3.388.820,71	-2,493
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-4.600.666,43	-3,385

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2022 / 2023 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		124.936.765,98
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-87.791,20
2. Zwischenausschüttungen		-125.024,40
3. Mittelzufluss (netto)		3.623.549,10
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	32.323.950,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-28.700.400,90	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		43.424,00
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-4.600.666,43
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	0,00	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-3.388.820,71	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		123.790.257,05

[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**	**10.758.509,78**

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

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten	**EUR**	**11.078.598,07**
Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	**EUR**	**4.650,68**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betrugen im Geschäftszeitraum EUR 4.650,68. 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	91,08
Umlaufende Anteile	STK	1.359.160,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	**98,61**
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 31.08.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.
Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.
Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,04

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 Währung -3.646,90 enthalten.

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

	Wertpapierleihe EUR
Verwendete Vermögensgegenstände	
absolut	10.758.509,78
in % des Fondsvermögens	8,69
10 größte Gegenparteien	
Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	10.758.509,78
Sitzstaat	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	10.758.509,78
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte	Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.
Währungen der erhaltenen Sicherheiten	Euro

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	11.078.598,07
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	4.650,68
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.

8,81

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Spanien, Königreich
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	7.332.581,74
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	421.263,12
3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	368.911,44
4. Name	Portugal, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	358.265,96
5. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	172.276,43
6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	138.408,42
7. Name	European Financial Stability Facility [EFSF]
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	137.539,92
8. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	131.634,59
9. Name	BPCE SFH
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	118.017,53
10. Name	HSBC SFH [France]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	114.260,43

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	11.078.598,07

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Frankfurt am Main, den 1. September 2022
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 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;
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squaire
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 2022

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

Finanzgruppe

Stand 08.22