

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2020.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 3-5 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 3-5 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	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 3-5 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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 3-5 (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 3,5 bis 5,5 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 3-5 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	-0,3%	-1,0%	0,7%

<b>ISIN</b>	DE000ETFL136
-------------	--------------

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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	FI4000219787	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(23) 20230914
Löschung	NL0012650469	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2017(24) 20240114
Löschung	BE0000339482	0.200000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(23) Ser. 79 20231021
Löschung	DE0001102382	1.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2015 (2025) 20250814
Löschung	IT0005327306	1.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20250514
Löschung	ES00000126Z1	1.600000 % Spanien EO-Bonos 2015(25) 20250429
Löschung	IT0005344335	2.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(23) 20230930
Löschung	FR0010466938	4.250000 % Frankreich EO-OAT 2007(23) 20231024
Löschung	ES00000122E5	4.650000 % Spanien EO-Obligaciones 2010(25) 20250729
Neuaufnahme	ES0000012F92	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(25) 20250130
Neuaufnahme	DE0001141828	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.182 v.2020(25) 20251009
Neuaufnahme	SK4000017158	0.250000 % Slowakei EO-Anl. 2020(25) 20250513
Neuaufnahme	IT0005386245	0.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(25) 20250131
Neuaufnahme	DE0001102382	1.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2015 (2025) 20250814
Neuaufnahme	FR0011962398	1.750000 % Frankreich EO-OAT 2014(24) 20241124
Neuaufnahme	ES00000127G9	2.150000 % Spanien EO-Obligaciones 2015(25) 20251030
Neuaufnahme	IT0005345183	2.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20251114
Neuaufnahme	BE0000332412	2.600000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72 20240621
Neuaufnahme	PTOTEKOE0011	2.875000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25) 20251014

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
ES00000126B2	2.750000 % Spanien EO-Bonos 2014(24) 20241030	6,06
ES00000127G9	2.150000 % Spanien EO-Obligaciones 2015(25) 20251030	5,85
DE0001141794	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.179 v.2019(24) 20240404	5,63
DE0001141802	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24) 20241017	5,41
FR0013415627	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(25) 20250324	5,15
FR0011962398	1.750000 % Frankreich EO-OAT 2014(24) 20241124	4,97
FR0013344751	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2018(24) 20240324	4,97
FR0012517027	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2015(25) 20250524	4,91
DE0001141810	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.181 v.2020(25) 20250410	4,82
IT0005386245	0.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(25) 20250131	4,54
ES0000012F92	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(25) 20250130	4,31
IT0005367492	1.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24) 20240630	4,27
IT0005345183	2.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20251114	4,25
BE0000334434	0.800000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(25) Ser. 74 20250621	4,17
IT0005282527	1.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(24) 20241114	3,98
NL0010733424	2.000000 % Niederlande EO-Anl. 2014(24) 20240714	3,95
BE0000332412	2.600000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72 20240621	3,94
PTOTEKOE0011	2.875000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25) 20251014	3,83
NL0011220108	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2015(25) 20250714	3,70
ES0000012E85	0.250000 % Spanien EO-Bonos 2019(24) 20240729	3,69
BE0000342510	0.500000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(24) Ser. 82 20241021	3,14
AT0000A28KX7	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240714	1,80
DE0001141828	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.182 v.2020(25) 20251009	1,21
FI4000391529	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(24) 20240914	0,96
SK4000017158	0.250000 % Slowakei EO-Anl. 2020(25) 20250513	0,48

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2020.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>44.150.526,59</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		43.708.675,85	99,01
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	37.092.401,34		84,02
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	6.616.274,51		14,99
2. Forderungen		221.906,02	0,50
3. Bankguthaben		219.944,72	0,50
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-5.925,70</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>44.144.600,89</b>	<b>100,00</b>

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



# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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									
DE0001141828	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2025		EUR	511	511.000	0	% 103,297	527.847,67	1,20
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024		EUR	2.299	404.000	451	% 102,778	2.362.870,13	5,35
DE0001141794	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024		EUR	2.401	422.000	484	% 102,481	2.460.560,89	5,57
DE0001141810	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2020/2025		EUR	2.044	1.770.000	195	% 103,054	2.106.423,76	4,77
							EUR	7.457.702,45	16,89
Ausland									
BE0000342510	0,5000 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2024		EUR	1.316	337	289	% 104,427	1.374.254,19	3,11
BE0000334434	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2015/2025		EUR	1.711	364	523	% 106,481	1.821.892,82	4,13
BE0000332412	2,6000 % Belgien, Königreich - Obligations 2014/2024		EUR	1.534	1.780	246	% 112,234	1.721.674,01	3,90
FI4000391529	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2019/2024		EUR	410	122	64	% 102,396	419.821,92	0,95
FR0013344751	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2024		EUR	2.130	541	344	% 102,023	2.173.089,90	4,92
FR0013415627	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2025		EUR	2.201	753	350	% 102,362	2.252.987,62	5,10
FR0012517027	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025		EUR	2.047	314	440	% 104,864	2.146.566,08	4,86
FR0011962398	1,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2013/2024		EUR	1.979	2.403	424	% 109,813	2.173.199,27	4,92
IT0005386245	0,3500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2025		EUR	1.989	2.307	318	% 99,745	1.983.928,05	4,49
IT0005367492	0,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien 2019/2024		EUR	1.770	307	569	% 105,475	1.866.907,50	4,23
IT0005282527	1,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2024		EUR	1.665	288	447	% 104,590	1.741.429,83	3,94
IT0005345183	2,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2025		EUR	1.689	1.689	0	% 109,980	1.857.556,46	4,21
NL0011220108	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2015/2025 <sup>2)</sup>		EUR	1.555	269	499	% 104,095	1.618.677,25	3,67
NL0010733424	2,0000 % Niederlande - Anleihe 2014/2024		EUR	1.565	271	502	% 110,263	1.725.615,32	3,91
AT0000A28KX7	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	771	288	94	% 102,211	788.044,11	1,79
PTOTEKOE0011	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025		EUR	1.449	1.667	218	% 115,511	1.673.747,15	3,79
SK4000017158	0,2500 % Slowakische Republik - Anleihe 2020/2025		EUR	204	204	0	% 103,000	210.119,12	0,48
ES0000012E85	0,2500 % Spanien - Bonos 2019/2024		EUR	1.578	326	269	% 102,125	1.611.538,65	3,65
ES00000126B2	2,7500 % Spanien - Bonos 2014/2024		EUR	2.353	487	402	% 112,646	2.650.556,38	6,00
ES00000127G9	2,1500 % Spanien - Obligaciones 2015/2025		EUR	2.284	2.284	0	% 111,958	2.557.123,23	5,79
ES0000012F92	0,0000 % Spanien, Königreich - Anleihe 2020/2025		EUR	1.865	1.990	125	% 100,925	1.882.244,54	4,26
							EUR	36.250.973,40	82,12
							EUR	43.708.675,85	99,01
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
			EUR	219.944,72			% 100,000	219.944,72	0,50
Sonstige Vermögensgegenstände									
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen									
			EUR	12.945,67				221.906,02	0,50
Zinsansprüche									
			EUR	208.960,35				12.945,67	0,03
								208.960,35	0,47
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
			EUR	-5.925,70				-5.925,70	-0,01
								-5.925,70	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
							EUR	44.144.600,89	100,00 <sup>1)</sup>
Umlaufende Anteile									
							EUR	106,04	
							STK	416.300,00	

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

<sup>2)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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:						
NL0011220108	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2015/2025	EUR	1.500		1.561.425,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen					1.561.425,00	<b>1.561.425,00</b>

## 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 (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>					
DE0001141786	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023	EUR	0	1.877	
DE0001102382	1,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025	EUR	2.956	2.956	
<b>Ausland</b>					
BE0000339482	0,2000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2023	EUR	0	1.115	
FI4000219787	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2023	EUR	0	642	
FR0010466938	4,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2006/2023	EUR	0	2.548	
IT0005327306	1,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2025	EUR	108	1.952	
IT0005344335	2,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2023	EUR	0	2.050	
NL0012650469	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2017/2024	EUR	108	1.912	
ES0000012621	1,6000 % Spanien - Bonos 2015/2025	EUR	0	2.036	
ES00000122E5	4,6500 % Spanien - Obligaciones 2010/2025	EUR	326	2.470	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			48.222

(Basiswerte: 0,2000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2023 (BE0000339482); 0,5000 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2024 (BE0000342510); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2018/2023 (DE0001141786); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024 (DE0001141802); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2020/2025 (DE0001141810); 1,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025 (DE0001102382); 0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2024 (FR0013344751); 0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2025 (FR0013415627); 0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025 (FR0012517027); 4,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2006/2023 (FR0010466938); 0,0000 % Niederlande - Anleihe 2017/2024 (NL0012650469); 0,2500 % Niederlande - Anleihe 2015/2025 (NL0011220108); 2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025 (PTOTEKOE0011))

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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 inländischen Wertpapieren		6.504,71	0,016
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		219.116,21	0,526
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		13.695,30	0,033
Summe der Erträge		239.316,22	0,575
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-32.206,02	-0,077
2. Sonstige Aufwendungen		-405,95	-0,001
davon: Negative Einlagezinsen	-405,95		-0,001
Summe der Aufwendungen		-32.611,97	-0,078
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		206.704,25	0,497
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		85.165,88	0,205
2. Realisierte Verluste		-297.514,27	-0,715
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-212.348,39	-0,510
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-5.644,14	-0,014
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-160.065,48	-0,384
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-6.575,10	-0,016
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-166.640,58	-0,400
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-172.284,72	-0,414

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2020 / 2021	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>			46.027.466,62
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr			-94.851,02
2. Zwischenausschüttungen			-78.260,00
3. Mittelzufluss (netto)			-1.541.472,14
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	5.848.925,86		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-7.390.398,00		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			4.002,15
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			-172.284,72
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-160.065,48		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-6.575,10		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>			44.144.600,89

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 UCITS ETF Anhang.

**Angaben nach der Derivateverordnung**  
**Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 1.561.425,00

**Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen**  
 DekaBank Deutsche Girozentrale

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
<b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:</b>	<b>EUR</b>		<b>1.984.009,22</b>
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		1.984.009,22
<b>Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)</b>	<b>EUR</b>		<b>13.721,73</b>

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 13.721,73. 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	106,04
Umlaufende Anteile	STK	416.300,00

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>99,01</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	0,07
---	------

**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.

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

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -415,62 enthalten.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 UCITS ETF

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

### Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	1.561.425,00
in % des Fondsvermögens	3,54

### 10 größte Gegenparteien

Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.561.425,00
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	1.561.425,00

### 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

### Sicherheiten 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	1.984.009,22

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 UCITS ETF

## Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	13.721,73
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

3,57

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.

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Bayerische Landesbank
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.984.009,22

## 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	1.984.009,22

## 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

---

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)