

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2022.

**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 2022

## 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 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](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 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 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>	-6,0%	-8,5%	-3,2%

**ISIN** 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	DE0001141828	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.182 v.2020(25) 20251009
Löschung	DE0001030716	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.v.2020(25) 20251009
Löschung	NL0015000QL2	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2022(26) 20260114
Löschung	DE0001102416	0.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270214
Löschung	AT0000A1K9C8	0.750000 % Österreich, Republik EO-Bundesobl. 2016(26) 20261019
Löschung	IT0005370306	2.100000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(26) 20260714
Löschung	PTOTEKOE0011	2.875000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25) 20251014
Löschung	FR0010916924	3.500000 % Frankreich EO-OAT 2010(26) 20260424
Neuaufnahme	BE0000351602	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2020(27) 20271021
Neuaufnahme	DE0001102523	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2027) 20271114
Neuaufnahme	DE0001141851	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.185 v.2022(27) 20270415
Neuaufnahme	DE0001102416	0.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270214
Neuaufnahme	PTOTEMOE0035	0.700000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(27) 20271014
Neuaufnahme	BE0000341504	0.800000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81 20270621
Neuaufnahme	IT0005416570	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(27) 20270914
Neuaufnahme	FR0011317783	2.750000 % Frankreich EO-OAT 2012(27) 20271024

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

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0011317783	2.750000 % Frankreich EO-OAT 2012(27) 20271024	6,22
ES00000128H5	1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030	5,77
DE0001141836	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.183 v.2021(26) 20260409	5,45
DE0001141844	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.184 v.2021(26) 20261008	5,18
FR0013131877	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2016(26) 20260524	5,06
ES0000012G26	0.800000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(27) 20270729	4,82
FR0013508470	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(26) 20260224	4,72
DE0001141851	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.185 v.2022(27) 20270415	4,72
ES0000012G91	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(26) 20260130	4,70
DE0001102523	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2027) 20271114	4,67
NL0011819040	0.500000 % Niederlande EO-Anl. 2016(26) 20260714	4,29
IT0005437147	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(26) 20260331	4,21
IT0005390874	0.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(27) 20270114	4,12
IT0005416570	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(27) 20270914	4,09
IT0005419848	0.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(26) 20260131	4,05
FR0014003513	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2021(27) 20270224	3,93
BE0000337460	1.000000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(26) Ser. 77 20260621	3,86
ES0000012J15	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2021(27) 20270130	3,85
BE0000341504	0.800000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81 20270621	3,50
NL0012171458	0.750000 % Niederlande EO-Anl. 2017(27) 20270714	3,48
NL0015031501	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(27) 20270114	3,46
BE0000351602	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2020(27) 20271021	1,92
IE00BKFVC568	0.200000 % Irland EO-Treasury Bonds 2020(27) 20270514	1,59
PTOTEMOE0035	0.700000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(27) 20271014	1,45
FI4000511449	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2021(26) 20260914	0,88

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

## Vermögensübersicht zum 31. August 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>8.751.340,44</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		8.667.076,76	99,05
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	7.077.776,01		80,89
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	1.589.300,75		18,16
2. Forderungen		23.557,74	0,27
3. Bankguthaben		60.705,94	0,69
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-1.215,27</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>8.750.125,17</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 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE0001102523	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2027		EUR	433	433	0	% 93,270	403.859,10	4,62
DE0001141836	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2026 <sup>2)</sup>		EUR	492	11	171	% 95,685	470.770,20	5,38
DE0001141851	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Anleihe 2022/2027		EUR	433	433	0	% 94,158	407.704,14	4,66
DE0001141844	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Bundesobligationen 2021/2026 <sup>2)</sup>		EUR	473	11	163	% 94,746	448.148,58	5,12
							EUR	1.730.482,02	19,78
Ausland									
BE0000351602	0,0000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2027		EUR	182	182	0	% 91,756	166.996,38	1,91
BE0000341504	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2027		EUR	316	316	0	% 96,183	303.936,70	3,47
BE0000337460	1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2026		EUR	341	8	104	% 98,151	334.696,04	3,83
FI4000511449	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2021/2026		EUR	81	2	25	% 93,745	75.933,45	0,87
FR0013508470	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2026		EUR	430	29	177	% 95,025	408.607,50	4,67
FR0014003513	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2021/2027		EUR	365	106	69	% 93,051	339.636,15	3,88
FR0013131877	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026		EUR	454	0	171	% 96,337	437.367,71	5,00
FR0011317783	2,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2011/2027 <sup>2)</sup>		EUR	510	524	14	% 105,414	537.613,34	6,14
IE00BKFCV568	0,2000 % Irland - Anleihe 2020/2027		EUR	148	4	45	% 93,475	138.343,00	1,58
IT0005437147	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2026		EUR	404	10	122	% 90,565	365.880,90	4,18
IT0005419848	0,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2026		EUR	378	9	114	% 92,862	351.018,51	4,01
IT0005390874	0,8500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2027		EUR	390	10	119	% 91,693	357.604,26	4,09
IT0005416570	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2027		EUR	393	422	29	% 90,315	354.938,93	4,06
NL0015031501	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2027		EUR	321	8	98	% 93,598	300.447,98	3,43
NL0011819040	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2016/2026		EUR	387	10	117	% 96,410	373.106,70	4,26
NL0012171458	0,7500 % Niederlande - Anleihe 2017/2027		EUR	314	7	94	% 96,308	302.407,12	3,46
PTOTEMOE0035	0,7000 % Portugal, Republik - Anleihe 2020/2027		EUR	134	144	10	% 93,950	125.893,00	1,44
ES0000012G91	0,0000 % Spanien - Anleihe 2020/2026		EUR	434	11	132	% 93,992	407.923,11	4,66
ES0000012G26	0,8000 % Spanien - Anleihe 2020/2027		EUR	444	11	105	% 94,378	419.038,32	4,79
ES0000012J15	0,0000 % Spanien - Bonos 2021/2027		EUR	364	197	36	% 91,711	333.829,64	3,82
ES00000128H5	1,3000 % Spanien - Obligaciones 2016/2026		EUR	512	12	155	% 97,925	501.376,00	5,73
							EUR	6.936.594,74	79,27
							EUR	8.667.076,76	99,05
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
			EUR	60.705,94			% 100,000	60.705,94	0,69
Sonstige Vermögensgegenstände									
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen									
			EUR	31,79			EUR	23.557,74	0,27
Zinsansprüche									
			EUR	23.525,95			EUR	23.525,95	0,27
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
			EUR	-1.215,27			EUR	-1.215,27	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
							EUR	8.750.125,17	100,00 <sup>1)</sup>
Umlaufende Anteile									
							EUR	95,84	
							STK	91.300,00	

<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:					
DE0001141836	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2026	EUR	24.000	22.964,40	
DE0001141844	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Bundesobligationen 2021/2026	EUR	70.000	66.322,20	
FR0011317783	2,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2011/2027	EUR	160.072	168.738,91	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				258.025,51	<b>258.025,51</b>

## 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
<b>Inland</b>					
DE0001141828	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2025	EUR	0	652	
DE0001030716	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2020/2025	EUR	0	130	
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027	EUR	587	587	
<b>Ausland</b>					
FR0010916924	3,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2010/2026	EUR	0	617	
IT0005370306	2,1000 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2026	EUR	0	437	
NL0015000QL2	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2022/2026	EUR	118	259	
AT0000A1K9C8	0,7500 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2026	EUR	0	394	
PTOTEKOE0011	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025	EUR	0	370	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			1.490

(Basiswerte: 1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2026 (BE0000337460); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2025 (DE0001141828); 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 (DE0001102416))

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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 <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		365,87	0,004
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		26.385,37	0,289
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		303,55	0,003
Summe der Erträge		27.054,79	0,296
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-6.810,08	-0,075
2. Sonstige Aufwendungen		-106,25	-0,001
davon: Negative Einlagezinsen	-106,25		-0,001
Summe der Aufwendungen		-6.916,33	-0,076
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		20.138,46	0,221
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		6.804,73	0,075
2. Realisierte Verluste		-232.080,82	-2,542
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-225.276,09	-2,467
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-205.137,63	-2,247
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		0,00	0,000
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-344.199,96	-3,770
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-344.199,96	-3,770
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-549.337,59	-6,017

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	EUR
		2022 / 2023
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		11.357.235,83
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00
2. Zwischenausschüttungen		-2.739,00
3. Mittelzufluss (netto)		-2.055.094,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-2.055.094,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		59,93
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-549.337,59
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	0,00	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-344.199,96	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		8.750.125,17

<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 258.025,51

### Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

**Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten** EUR 269.485,96

**Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR 304,61

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 304,61. 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	95,84
Umlaufende Anteile	STK	91.300,00

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>99,05</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 31.08.2022 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) 0,05

### 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 -106,57 enthalten.

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

#### Wertpapierleihe

#### EUR

<b>Verwendete Vermögensgegenstände</b>	absolut	258.025,51
	in % des Fondsvermögens	2,95

#### 10 größte Gegenparteien

Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	258.025,51
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	258.025,51

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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](http://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)	269.485,96
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	304,61
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.

2,98

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1. Name	Spanien, Königreich
		178.460,98
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2. Name	Italien, Republik
		10.252,55
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
		8.978,56
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4. Name	Portugal, Republik
		8.719,47
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
		4.193,74
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau
		3.367,69
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	7. Name	European Financial Stability Facility [EFSF]
		3.347,60
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	8. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
		3.202,80
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9. Name	BPCE SFH
		2.872,07
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	10. Name	HSBC SFH [France]
		2.780,40

## 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	269.485,96

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 3-5 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 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](http://www.deka-etf.de)

