

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2019.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 5-7 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 2019

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2019 bis zum 31. August 2019.

In den vergangenen sechs Monaten prägten wiederholt sowohl die geldpolitischen Entscheidungsträger als auch die Akteure im Handelskonflikt der USA mit China die Kapitalmärkte. Insgesamt zeigten die Aktienbörsen eine erstaunliche Widerstandskraft gegen exogene Erschütterungen; bei den Marktteilnehmern zeigte sich jedoch eine gestiegene Risikoaversion und eine höhere Nachfrage nach sicheren Anlagemöglichkeiten.

Das unverändert niedrige bzw. sinkende Zinsniveau äußerte sich bei einer positiven Marktentwicklung in merklich nachgebenden Renditen. Mittlerweile bewegen sich deutsche Bundesanleihen über alle Laufzeiten hinweg im negativen Bereich. Die US-amerikanische Notenbank Fed nahm im Juli zum ersten Mal seit der Finanzkrise eine Leitzinssenkung vor und reagierte damit auf Anzeichen einer sich abschwächenden Konjunktur. Zum Stichtag rentierten 10-jährige US-Treasuries mit lediglich 1,5 Prozent auf einem niedrigen Niveau.

Die weltpolitischen Störfeuer führten nur zu temporären Unsicherheiten an den Märkten und so bewegte sich das Gros der internationalen Börsen im Berichtshalbjahr unter Schwankungen leicht aufwärts. In den USA verzeichneten die Leitindizes Dow Jones Industrial und der marktweite S&P 500 im Juli ein neues Allzeithoch. Auch der deutsche Standardwertindex DAX sowie der EURO STOXX 50 landeten auf Halbjahressicht auf positivem Terrain. Im Zuge des erneut eskalierenden Handelsstreits mit den USA verlor hingegen vor allem der chinesische HangSeng deutlich. Ebenso musste der japanische Nikkei 225 Einbußen hinnehmen. An den Rohstoffmärkten machte Gold seinem Namen als Krisenwährung alle Ehre und verzeichnete im August ein neues Sechsjahreshoch.

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



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Dr. Ulrich Neugebauer  
(stv. Vorsitzender)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. August 2019	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2019	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 5-7 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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 Markt iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 (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 5,5 bis 7,5 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 5-7 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	6,0%	8,2%	2,1%

**ISIN** DE000ETFL144

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	NL0011220108	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2015(25) 20250714
Löschung	BE0000342510	0.500000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(24) Ser. 82 20241021
Löschung	FR0012517027	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2015(25) 20250524
Löschung	AT0000A1FAP5	1.200000 % Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2015(25) 20251019
Löschung	IT0005327306	1.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20250514
Löschung	IT0005090318	1.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25) 20250531
Löschung	FR0011962398	1.750000 % Frankreich EO-OAT 2014(24) 20241124
Löschung	SI0002103545	2.125000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2015(25) 20250727
Löschung	ES00000127G9	2.150000 % Spanien EO-Obligaciones 2015(25) 20251030
Löschung	ES00000126B2	2.750000 % Spanien EO-Bonos 2014(24) 20241030
Neuaufnahme	FR0013415627	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(25) 20250324
Neuaufnahme	DE0001102408	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026) 20260814
Neuaufnahme	FR0013200813	0.250000 % Frankreich EO-OAT 2016(26) 20261124
Neuaufnahme	NL0011220108	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2015(25) 20250714
Neuaufnahme	AT0000A1K9C8	0.750000 % Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2016(26) 20261019
Neuaufnahme	BE0000334434	0.800000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(25) Ser. 74 20250621
Neuaufnahme	IT0005210650	1.250000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20261130
Neuaufnahme	ES00000128H5	1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030
Neuaufnahme	IT0005345183	2.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20251114
Neuaufnahme	ES00000123C7	5.900000 % Spanien EO-Bonos 2011(26) 20260729

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
FR0012938116	1.000000	% Frankreich EO-OAT 2015(25) 20251124	5,81
FR0013131877	0.500000	% Frankreich EO-OAT 2016(26) 20260524	5,77
ES00000123C7	5.900000	% Spanien EO-Bonos 2011(26) 20260729	5,74
FR0013200813	0.250000	% Frankreich EO-OAT 2016(26) 20261124	5,66
ES00000122E5	4.650000	% Spanien EO-Obligaciones 2010(25) 20250729	5,39
DE0001102390	0.500000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026) 20260214	5,39
DE0001102408	0.000000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026) 20260814	5,04
DE0001102382	1.000000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2015 (2025) 20250814	4,87
DE0001102374	0.500000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2015 (2025) 20250214	4,71
ES00000128H5	1.300000	% Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030	4,54
IT0005127086	2.000000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25) 20251130	4,43
ES00000127Z9	1.950000	% Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20260429	4,18
IT0005210650	1.250000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20261130	4,13
IT0005170839	1.600000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20260531	3,97
IT0005345183	2.500000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(25) 20251114	3,87
BE0000334434	0.800000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(25) Ser. 74 20250621	3,75
NL0011819040	0.500000	% Niederlande EO-Anl. 2016(26) 20260714	3,45
NL0011220108	0.250000	% Niederlande EO-Anl. 2015(25) 20250714	3,39
BE0000337460	1.000000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(26) Ser. 77 20260621	3,35
FR0013415627	0.000000	% Frankreich EO-OAT 2019(25) 20250324	2,74
AT0000A1K9C8	0.750000	% Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2016(26) 20261019	2,67
IE00BV8C9418	1.000000	% Irland EO-Treasury Bonds 2016(26) 20260514	2,60
PTOTETOE0012	2.875000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2016(26) 20260720	2,40
FI4000197959	0.500000	% Finnland, Republik EO-Bonds 2016(26) 20260414	1,25
FI4000167317	0.875000	% Finnland, Republik EO-Bonds 2015(25) 20250914	0,92

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2019.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>94.516.072,58</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		93.112.799,97	98,53
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	77.281.176,75		81,78
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	15.831.623,22		16,75
2. Forderungen		304.230,44	0,32
3. Bankguthaben		1.099.042,17	1,16
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-12.215,24</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>94.503.857,34</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. August 2019.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE0001102408	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026		EUR	4.408	4.689	281	% 106,360	4.688.357,62	4,96
DE0001102374	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025		EUR	4.055	1.155	1.472	% 108,037	4.380.889,40	4,64
DE0001102390	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026 <sup>2)</sup>		EUR	4.584	1.307	1.665	% 109,387	5.014.300,08	5,31
DE0001102382	1,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025		EUR	4.055	1.155	1.472	% 111,760	4.531.868,81	4,80
							EUR	18.615.415,91	19,70
Ausland									
BE0000334434	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2015/2025		EUR	3.220	3.220	0	% 108,461	3.492.444,20	3,70
BE0000337460	1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2026 <sup>2)</sup>		EUR	2.816	940	859	% 110,845	3.121.395,20	3,30
FI4000197959	0,5000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2026		EUR	1.077	445	318	% 107,744	1.160.402,88	1,23
FI4000167317	0,8750 % Finnland, Republik - Government Bonds 2015/2025		EUR	783	261	238	% 109,582	858.025,10	0,91
FR0013415627	0,0000 % Frankreich - OAT 2019/2025		EUR	2.455	2.493	38	% 103,925	2.551.350,65	2,70
FR0013200813	0,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026		EUR	4.960	4.960	0	% 106,244	5.269.694,96	5,58
FR0013131877	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026 <sup>2)</sup>		EUR	4.982	2.381	923	% 107,789	5.370.047,98	5,68
FR0012938116	1,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025		EUR	4.887	2.543	884	% 110,606	5.405.301,05	5,72
IE00B8V8C9418	1,0000 % Irland - Treasury Bonds 2016/2026		EUR	2.215	739	675	% 109,231	2.419.466,65	2,56
IT0005210650	1,2500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026		EUR	3.698	3.699	1	% 103,927	3.843.220,46	4,07
IT0005170839	1,6000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026		EUR	3.479	1.161	1.061	% 106,322	3.698.957,34	3,91
IT0005127086	2,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2015/2025		EUR	3.803	1.243	1.016	% 108,525	4.127.186,74	4,37
IT0005345183	2,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2025		EUR	3.235	3.937	702	% 111,485	3.606.542,99	3,82
NL0011220108	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2015/2025		EUR	2.979	3.190	3.104	% 106,049	3.159.199,71	3,34
NL0011819040	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2016/2026 <sup>2)</sup>		EUR	2.958	988	903	% 108,611	3.212.713,38	3,40
AT0000A1K9C8	0,7500 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2026		EUR	2.265	2.757	492	% 109,933	2.489.974,98	2,63
PTOTETOE0012	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2016/2026		EUR	1.846	636	307	% 120,785	2.229.691,10	2,36
ES00000123C7	5,9000 % Spanien - Bonos 2011/2026		EUR	3.753	3.756	3	% 142,327	5.341.537,19	5,65
ES00000128H5	1,3000 % Spanien - Obligaciones 2016/2026		EUR	3.827	3.830	3	% 110,497	4.228.732,82	4,47
ES00000127Z9	1,9500 % Spanien - Obligaciones 2016/2026		EUR	3.404	919	498	% 114,458	3.896.148,28	4,12
ES00000122E5	4,6500 % Spanien - Obligaciones 2010/2025		EUR	3.877	1.054	658	% 129,362	5.015.350,40	5,31
							EUR	74.497.384,06	78,83
							EUR	93.112.799,97	98,53
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
			EUR	1.099.042,17			% 100,000	1.099.042,17	1,16
Sonstige Vermögensgegenstände									
Abgegrenzte Zinsforderung aus verliehenen Wertpapieren									
			EUR	645,74				304.230,44	0,32
Zinsansprüche									
			EUR	303.584,70				645,74	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
			EUR	-12.215,24				303.584,70	0,32
Sonstige Verbindlichkeiten									
			EUR	-12.215,24				-12.215,24	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
			EUR					94.503.857,34	100,00 <sup>1)</sup>
Umlaufende Anteile									
			EUR					120,63	
			STK					783.418,00	

<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 5-7 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:					
BE0000337460	1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2026	EUR	500	554.225,00	
DE0001102390	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026	EUR	3.963	4.335.006,81	
FR0013131877	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026	EUR	1.181	1.272.887,85	
NL0011819040	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2016/2026	EUR	1.719	1.867.430,38	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				8.029.550,04	<b>8.029.550,04</b>

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 30.08.2019

## 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>Ausland</b>					
BE0000342510	0,5000 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2024	EUR	108	1.593	
FR0012517027	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025	EUR	2.114	6.170	
FR0011962398	1,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2013/2024	EUR	286	4.208	
IT0005327306	1,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2025	EUR	693	3.680	
IT0005090318	1,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2015/2025	EUR	274	4.035	
AT0000A1FAP5	1,2000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2015/2025	EUR	460	2.441	
SI0002103545	2,1250 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2015/2025	EUR	89	469	
ES0000012682	2,7500 % Spanien - Bonos 2014/2024	EUR	671	4.353	
ES00000127G9	2,1500 % Spanien - Obligaciones 2015/2025	EUR	605	3.930	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			55.367

(Basiswerte: 1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2026 (BE0000337460); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026 (DE0001102408); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025 (DE0001102374); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026 (DE0001102390); 1,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025 (DE0001102382); 0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025 (FR0012517027); 0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026 (FR0013131877); 1,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025 (FR0012938116); 2,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2015/2025 (IT0005127086); 0,2500 % Niederlande - Anleihe 2015/2025 (NL0011220108); 0,5000 % Niederlande - Anleihe 2016/2026 (NL0011819040); 0,7500 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2026 (AT0000A1K9C8); 2,1250 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2015/2025 (SI0002103545); 2,1500 % Spanien - Obligaciones 2015/2025 (ES00000127G9))

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.03.2019 bis zum 31.08.2019

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		42.146,96	0,054
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		493.517,28	0,630
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		4.568,59	0,006
Summe der Erträge		540.232,83	0,690
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-64.760,07	-0,083
2. Sonstige Aufwendungen		-1.748,62	-0,002
davon: Verwahrtgelt	-1.748,62		-0,002
Summe der Aufwendungen		-66.508,69	-0,085
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		473.724,14	0,605
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		1.661.137,17	2,120
2. Realisierte Verluste		-1.825,01	-0,002
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.659.312,16	2,118
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		2.133.036,30	2,723
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		2.812.134,99	3,590
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		88.292,95	0,113
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		2.900.427,94	3,702
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		5.033.464,24	6,425

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		78.554.306,99
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-157.945,44
2. Zwischenausschüttungen		-453.971,70
3. Mittelzufluss (netto)		11.756.760,03
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	24.807.777,93	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-13.051.017,90	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-228.756,78
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		5.033.464,24
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	2.812.134,99	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	88.292,95	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		94.503.857,34

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF Anhang.

**Angaben nach der Derivateverordnung**  
**Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 8.029.550,04

**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>9.578.432,02</b>
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		9.578.432,02
<b>Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren</b>	<b>EUR</b>		<b>6.613,06</b>

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 6.613,06. 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	120,63
Umlaufende Anteile	STK	783.418,00

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>98,53</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 31.08.2019 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 31.08.2019 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	0,14
---	------

## 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.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

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

### Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	8.029.550,04
in % des Fondsvermögens	8,50

### 10 größte Gegenparteien

Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	8.029.550,04
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	8.029.550,04

### 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. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen an einem geregelten Markt in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder an einer Börse in einem Mitgliedstaat der OECD notiert sein oder gehandelt werden und in einem wichtigen Index enthalten sein.

Von den Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten sowie ggf. nach Restlaufzeit variieren. Die Haircuts fallen für die aufgeführten Wertpapierkategorien wie folgt aus:

- Bankguthaben 0%
- Aktien 5% - 40%
- Renten 0,5% - 30%

Darüber hinaus kann für Sicherheiten in einer anderen Währung als der Fondswährung ein zusätzlicher Wertabschlag von bis zu 10%-Punkten angewandt werden. In besonderen Marktsituationen (z.B. Marktturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

### 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	9.578.432,02

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

## Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	6.613,06
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

8,62

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	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		5.158.367,12
	2. Name	Landesbank Baden-Württemberg
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		2.006.381,67
	3. Name	Danone S.A.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		1.712.465,42
	4. Name	Berlin Hyp AG
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		701.217,81

## 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	2,00
Name	J.P. Morgan AG Frankfurt
verwahrter Betrag absolut	6.870.832,55
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	2.707.599,47

## 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 2. September 2019  
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 2018

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

## Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Michael Rüdiger  
Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;  
Mitglied des Aufsichtsrates der Deka Immobilien GmbH,  
Frankfurt am Main

### Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
Deka Immobilien GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf  
und der  
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Stellvertretende Vorsitzende des Verwaltungsrates der  
DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A., Luxemburg;  
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 Munning  
Vorsitzender des Vorstandes der  
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

## Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Dr. Ulrich Neugebauer (stv. Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,  
Köln  
und der  
Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln  
und der  
Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

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 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 2019

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)