

Halbjahresbericht
zum 31. August 2022.

**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 2022

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 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 Anteilhaber 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 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 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.
Performance *	-8,7%	-12,5%	-4,3%

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	BE0000351602	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2020(27) 20271021
Löschung	DE0001102523	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2027) 20271114
Löschung	DE0001102457	0.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2018 (2028) 20280814
Löschung	PTOTEMOE0035	0.700000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(27) 20271014
Löschung	FR0013341682	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2018(28) 20281124
Löschung	NL0012818504	0.750000 % Niederlande EO-Anl. 2018(28) 20280714
Löschung	IT0005416570	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(27) 20270914
Löschung	SK4120014150	1.000000 % Slowakei EO-Anl. 2018(28) 20280611
Löschung	ES0000012B39	1.400000 % Spanien EO-Bonos 2018(28) 20280429
Löschung	ES0000012B88	1.400000 % Spanien EO-Bonos 2018(28) 20280729
Löschung	IT0005323032	2.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20280131
Neuaufnahme	DE0001102473	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290814
Neuaufnahme	FR0013451507	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20291124
Neuaufnahme	IT0005467482	0.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(29) 20290214
Neuaufnahme	FI4000369467	0.500000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(29) 20290914
Neuaufnahme	ES0000012F43	0.600000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20291030
Neuaufnahme	FR0013286192	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2017(28) 20280524
Neuaufnahme	FR001400AIN5	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2022(28) 20280224
Neuaufnahme	ES0000012K53	0.800000 % Spanien EO-Bonos 2022(29) 20290729
Neuaufnahme	SK4120014150	1.000000 % Slowakei EO-Anl. 2018(28) 20280611
Neuaufnahme	SI0002103842	1.187500 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2019(29) 20290313
Neuaufnahme	IT0005365165	3.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(29) 20290731

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0013286192	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2017(28) 20280524	7,07
DE0001102465	0.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290214	6,64
DE0001102473	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290814	6,49
FR0013407236	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20290524	6,26
IT0005365165	3.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(29) 20290731	6,04
DE0001102556	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2028) 20281114	5,94
IT0005340929	2.800000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20281130	5,87
ES0000012E51	1.450000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20290429	5,47
ES0000012F43	0.600000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20291030	5,45
FR0013451507	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20291124	4,87
BE0000347568	0.900000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(29) 20290621	4,85
ES0000012I08	0.000000 % Spanien EO-Obligaciones 2021(28) 20280130	4,56
IT0005433690	0.250000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(28) 20280314	4,49
IT0005467482	0.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(29) 20290214	3,67
PTOTEXOE0024	1.950000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2019(29) 20290614	3,16
NL0013332430	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2019(29) 20290714	2,99
AT0000A269M8	0.500000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290219	2,94
IE00BH3SQ895	1.100000 % Irland EO-Treasury Bonds 2019(29) 20290514	2,62
NL0015000LS8	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(29) 20290114	2,46
FR001400AIN5	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2022(28) 20280224	1,83
ES0000012K53	0.800000 % Spanien EO-Bonos 2022(29) 20290729	1,54
FI4000369467	0.500000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(29) 20290914	1,53
AT0000A2VB47	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(28) 20281019	1,38
FI4000348727	0.500000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2018(28) 20280914	1,26
SI0002103842	1.187500 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2019(29) 20290313	0,61

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		50.762.188,17	100,01
1. Anleihen		49.850.876,33	98,22
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	43.938.413,34		86,57
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	5.912.462,99		11,65
2. Forderungen		113.785,04	0,22
3. Bankguthaben		797.526,80	1,57
II. Verbindlichkeiten		-6.791,61	-0,01
III. Fondsvermögen		50.755.396,56	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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									
DE0001102473	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029		EUR	3.556	3.900	344	% 90,940	3.233.826,40	6,37
DE0001102465	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029 ²⁾		EUR	3.556	989	486	% 93,121	3.311.382,76	6,52
DE0001102556	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Anleihe 2021/2028		EUR	3.220	896	441	% 91,940	2.960.468,00	5,83
							EUR	9.505.677,16	18,73
Ausland									
BE0000347568	0,9000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2029		EUR	2.562	861	284	% 94,284	2.415.543,27	4,76
FI4000369467	0,5000 % Finnland, Republik - Anleihe 2019/2029		EUR	842	943	101	% 90,879	765.199,75	1,51
FI4000348727	0,5000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2018/2028		EUR	677	163	81	% 92,695	627.542,92	1,24
FR0013451507	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2018/2029		EUR	2.764	2.764	0	% 87,916	2.429.987,74	4,79
FR0013407236	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2029		EUR	3.389	623	2.498	% 92,035	3.119.077,33	6,15
FR001400AIN5	0,7500 % Frankreich - Anleihe 2022/2028		EUR	964	964	0	% 94,814	914.006,96	1,80
FR0013286192	0,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2028		EUR	3.718	3.718	0	% 94,823	3.525.519,14	6,95
IE00BH3SQ895	1,1000 % Irland - Anleihe 2019/2029 ²⁾		EUR	1.372	331	165	% 95,306	1.307.598,32	2,58
IT0005433690	0,2500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2028		EUR	2.628	630	313	% 85,191	2.238.819,48	4,41
IT0005467482	0,4500 % Italien, Republik - Anleihe 2021/2029		EUR	2.192	2.453	261	% 83,387	1.827.832,08	3,60
IT0005340929	2,8000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2028		EUR	2.999	838	357	% 97,602	2.927.083,98	5,77
IT0005365165	3,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2019/2029		EUR	3.079	3.445	366	% 97,842	3.012.555,18	5,94
NL0015000LS8	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2029		EUR	1.364	575	163	% 89,893	1.226.133,70	2,42
NL0013332430	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2019/2029		EUR	1.639	395	197	% 90,843	1.488.916,77	2,93
AT0000A2VB47	0,0000 % Österreich, Republik - Anleihe 2022/2028		EUR	773	425	65	% 89,105	688.779,33	1,36
AT0000A269M8	0,5000 % Österreich, Republik - Anleihe 2019/2029		EUR	1.607	413	189	% 91,234	1.466.127,65	2,89
PTOTEXOE0024	1,9500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2019/2029		EUR	1.595	384	191	% 98,775	1.575.461,25	3,10
SI0002103842	1,1875 % Slowenien, Republik - Anleihe 2019/2029		EUR	327	367	40	% 93,168	304.660,70	0,60
ES0000012F43	0,6000 % Spanien - Anleihe 2019/2029		EUR	3.050	3.050	0	% 89,091	2.717.275,50	5,35
ES0000012K53	0,8000 % Spanien - Anleihe 2022/2029		EUR	848	907	59	% 90,447	766.992,68	1,51
ES0000012E51	1,4500 % Spanien - Bonos 2019/2029		EUR	2.860	690	344	% 95,340	2.726.724,00	5,37
ES0000012I08	0,0000 % Spanien - Obligaciones 2021/2028		EUR	2.542	613	305	% 89,432	2.273.361,44	4,48
							EUR	40.345.199,17	79,49
							EUR	49.850.876,33	98,22
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
	Verwahrstelle		EUR	797.526,80			% 100,000	797.526,80	1,57
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	27,90			EUR	113.785,04	0,22
	Zinsansprüche		EUR	113.757,14			EUR	27,90	0,00
			EUR				EUR	113.757,14	0,22
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-6.791,61			EUR	-6.791,61	-0,01
Fondsvermögen									
	Anteilwert						EUR	50.755.396,56	100,00 ¹⁾
	Umlaufende Anteile						EUR	102,97	
							STK	492.905,00	

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 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:						
DE0001102465	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029	EUR	95.000		88.464,95	
IE00BH3SQ895	1,1000 % Irland - Anleihe 2019/2029	EUR	15.000		14.295,90	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen					102.760,85	102.760,85

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					
DE0001102523	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2027	EUR	0	2.535	
DE0001102457	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2018/2028	EUR	111	3.049	
Ausland					
BE0000351602	0,0000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2027	EUR	0	943	
FR0013341682	0,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2028	EUR	218	6.063	
IT0005416570	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2027	EUR	0	2.276	
IT0005323032	2,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2028	EUR	0	2.721	
NL0012818504	0,7500 % Niederlande - Anleihe 2018/2028	EUR	0	1.725	
PTOTEMOEO035	0,7000 % Portugal, Republik - Anleihe 2020/2027	EUR	0	777	
SK4120014150	0,0000 % Slowakische Republik - Anleihe /	EUR	414	414	
ES0000012B39	1,4000 % Spanien - Bonos 2018/2028	EUR	0	2.830	
ES0000012B88	1,4000 % Spanien - Bonos 2018/2028	EUR	677	3.310	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			39.084

(Basiswerte: 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029 (DE0001102465); 0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2029 (FR0013407236); 0,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2028 (FR0013341682); 0,2500 % Niederlande - Anleihe 2019/2029 (NL0013332430))

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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 inländischen Wertpapieren		6.470,72	0,013
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		207.546,62	0,421
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		2.627,96	0,005
Summe der Erträge		216.645,30	0,440
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-38.857,26	-0,079
2. Sonstige Aufwendungen		-1.732,53	-0,004
davon: Negative Einlagezinsen	-1.732,53		-0,004
Summe der Aufwendungen		-40.589,79	-0,082
III. Ordentlicher Nettoertrag		176.055,51	0,357
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		0,00	0,000
2. Realisierte Verluste		-2.736.083,01	-5,551
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-2.736.083,01	-5,551
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-2.560.027,50	-5,194
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		0,00	0,000
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-2.396.679,13	-4,862
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-2.396.679,13	-4,862
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-4.956.706,63	-10,056

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023
	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	57.484.618,25
2. Zwischenausschüttungen	-81.264,80
3. Mittelzufluss (netto)	-102.939,10
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	-1.627.334,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	4.725.946,00
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	-6.353.280,00
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	39.022,84
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-4.956.706,63
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	50.755.396,56

¹⁾ 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 **102.760,85**

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten EUR **106.141,76**

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich) EUR **2.731,56**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 2.731,56. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.UR .

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	102,97
Umlaufende Anteile	STK	492.905,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,22
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) 0,11

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 -1.753,00 enthalten.

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

Verwendete Vermögensgegenstände	absolut	102.760,85
	in % des Fondsvermögens	0,20

10 größte Gegenparteien

Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	102.760,85
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	102.760,85

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

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

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

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

Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	106.141,76
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	2.731,56
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.

0,21

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Spanien, Königreich
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	70.257,80
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4.037,90
3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3.535,16
4. Name	Portugal, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3.430,86
5. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.651,15
6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.326,31
7. Name	European Financial Stability Facility [EFSF]
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.317,50
8. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.261,17
9. Name	BPCE SFH
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.131,89
10. Name	HSBC SFH [France]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.094,15

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	106.141,76

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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

