

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2018.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 7-10 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.

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2018 bis zum 31. August 2018.

Rangierten im Vorfeld des Betrachtungszeitraums einige der einflussreichsten Aktienmärkte noch auf oder in der Nähe ihrer historischen Rekordmarken, so setzten in der Folge signifikante Korrekturbewegungen ein. Dies tat der globalen konjunkturellen Erholung jedoch keinen Abbruch. Angesichts eines robusten konjunkturellen Umfelds richteten die Marktteilnehmer ihr Augenmerk auf die geldpolitischen Signale der führenden Notenbanken. Die sich verschärfende Tonlage im US-Handelsstreit, die taumelnde türkische Lira, die zähen Brexit-Verhandlungen sowie die Wiederherstellung der US-Sanktionen gegen den Iran hinterließen letztlich auf Halbjahressicht deutliche Spuren an den Kapitalmärkten.

Die Qualität deutscher Staatsanleihen war im Betrachtungszeitraum wieder gefragt. Die Rendite 10-jähriger Bundesanleihen sank vom Hochpunkt bei 0,7 Prozent Anfang März auf zuletzt 0,3 Prozent. Vor dem Hintergrund der protektionistischen Stimmungslage in den USA und der Irritationen z.B. mit Blick auf die neue Regierung Italiens waren Anleger auf der Suche nach vergleichsweise sicheren Anlagen. Laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten in einem Umfeld guter Wirtschaftsdaten und moderater Zinserhöhungsschritte der US-Notenbank zuletzt bei 2,9 Prozent und damit etwa auf dem Ausgangsniveau.

An den Aktienmärkten setzte sich die vorangegangene Aufwärtsbewegung nicht fort. Befürchtungen z.B. hinsichtlich einer frühzeitigen Straffung der Geldpolitik durch die großen Notenbanken ließen die Börsen in einer Phase erhöhter Nervosität verharren. Im Berichtszeitraum wiesen die US-amerikanischen Börsen positive Ergebnisse aus, während in Europa eher ein gemischtes Bild vorherrschte. In Japan ergab sich ein leichtes Plus (Nikkei), während der Hang Seng-Index (Hongkong) als Spiegelbild für das restliche Asien deutliche Kursrückgänge verzeichnete.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF eine Wertentwicklung von plus 0,9 Prozent (nach BVI-Methode). 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 Anlagebedingungen 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)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik.	5
Vermögensübersicht zum 31. August 2018.	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2018.	9
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	12
Informationen der Verwaltung.	14
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 beigelegt sind, erfolgen.**

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

## Anlagepolitik.

Die Auswahl der für den Fonds vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den Markt iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 (Preisindex) nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der größten und umsatzstärksten europäischen Staatsanleihen ab und besteht aus Einzelwerten unterschiedlicher Euro-Länder mit einer Restlaufzeit von 7,5 bis 10,5 Jahren. Informationen zu den Basiswerten sind unter [www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de) erhältlich. Der Fonds 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. Erträge werden ausgeschüttet.

Grundlage hierfür ist, dass die Entscheidungen über den Erwerb oder die Veräußerung von Vermögensgegenständen sowie über deren Gewichtung im Fonds von dem zugrunde liegenden Index abhängig sind (passives Management).

Dabei ist allerdings zu beachten, dass der exakten Nachbildung des Index bestimmte Faktoren entgegenstehen. Transaktionskosten und Verwaltungskosten, die sich wertmindernd auf die Anteilspreisentwicklung auswirken, werden beispielsweise nicht in die Berechnung des Index einbezogen.

Die Indexzusammensetzung wird durch den Indexanbieter angepasst. Durch die Nachbildung dieser Änderungen im Fonds können Transaktionskosten entstehen.

**Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass die Ziele der Anlagepolitik tatsächlich erreicht werden.**

### Wichtige Kennzahlen Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Performance*	0,9%	0,2%	2,5%
ISIN	DE000ETFL151		

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FR0012938116	1.000000 % Frankreich EO-OAT 2015(25) 20251124
Löschung	AT0000A1FAP5	1.200000 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2015(25) 20251019
Löschung	IT0005127086	2.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25) 20251130
Löschung	ES00000127G9	2.150000 % Spanien EO-Obligaciones 2015(25) 20251030
Löschung	PTOTEKOE0011	2.875000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25) 20251014
Löschung	PTOTEUOE0019	4.125000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2017(27) 20270413
Neuaufnahme	FR0013286192	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2017(28) 20280524
Neuaufnahme	NL0012818504	0.750000 % Niederlande EO-Anl. 2018(28) 20280714
Neuaufnahme	BE0000345547	0.800000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(28) Ser. 85 20280621
Neuaufnahme	ES0000012B39	1.400000 % Spanien EO-Bonos 2018(28) 20280429
Neuaufnahme	IT0005323032	2.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20280131
Neuaufnahme	PTOTEUOE0019	4.125000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2017(27) 20270413

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
0.750000	% Frankreich EO-OAT 2017(28) 20280524	5,29
0.500000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026) 20260214	5,27
1.000000	% Frankreich EO-OAT 2017(27) 20270524	5,16
0.250000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270214	5,13
0.500000	% Frankreich EO-OAT 2016(26) 20260524	5,07
1.300000	% Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030	5,05
0.500000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270814	5,02
1.450000	% Spanien EO-Obligaciones 2017(27) 20271030	4,98
0.000000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026) 20260814	4,86
0.250000	% Frankreich EO-OAT 2016(26) 20261124	4,69
1.400000	% Spanien EO-Bonos 2018(28) 20280429	4,65
1.950000	% Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20260429	4,62
2.050000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270731	3,87
2.000000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20280131	3,81
1.600000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20260531	3,54
0.750000	% Niederlande EO-Anl. 2017(27) 20270714	3,52
1.250000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20261130	3,48
0.500000	% Niederlande EO-Anl. 2016(26) 20260714	3,42
1.000000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(26) Ser. 77 20260621	3,33
0.800000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81 20270621	3,10
0.750000	% Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2016(26) 20261019	2,64
0.800000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(28) Ser. 85 20280621	2,63
1.000000	% Irland EO-Treasury Bonds 2016(26) 20260514	2,59
0.750000	% Niederlande EO-Anl. 2018(28) 20280714	2,31
0.500000	% Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2017(27) 20270419	1,98

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2018.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>15.633.781,50</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		15.448.796,96	98,83
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	15.448.796,96		98,83
2. Forderungen		50.830,82	0,33
3. Bankguthaben		134.153,72	0,86
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-2.252,63</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>15.631.528,87</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>



# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. August 2018.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Inland</b>									
DE0001102408	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026		EUR	756	158	19	% 99,237	750.234,21	4,80
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 <sup>2)</sup>		EUR	786	164	20	% 100,815	792.405,90	5,07
DE0001102390	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026		EUR	786	164	20	% 103,480	813.350,21	5,20
DE0001102424	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027		EUR	756	158	19	% 102,558	775.335,46	4,96
							<b>EUR</b>	<b>3.131.325,78</b>	<b>20,03</b>
<b>Ausland</b>									
BE0000345547	0,8000 % Belgien, Königreich - OBC (Obligaciones) 2018/2028		EUR	403	403	0	% 100,913	406.679,39	2,60
BE0000341504	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2027		EUR	469	101	0	% 101,935	478.073,98	3,06
BE0000337460	1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2026		EUR	492	106	0	% 104,479	514.037,91	3,29
FR0013200813	0,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026 <sup>2)</sup>		EUR	733	156	59	% 98,793	724.150,86	4,63
FR0013131877	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026 <sup>2)</sup>		EUR	773	193	0	% 101,287	782.948,51	5,01
FR0013286192	0,7500 % Frankreich - OAT (Obl. ass. du Trésor) 2017/2028		EUR	807	808	1	% 101,244	817.035,05	5,23
FR0013250560	1,0000 % Frankreich - OAT 2016/2027 <sup>2)</sup>		EUR	763	162	62	% 104,432	796.814,25	5,10
IE00B8VC9418	1,0000 % Irland - Treasury Bonds 2016/2026		EUR	387	83	0	% 103,259	399.612,33	2,56
IT0005210650	1,2500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026		EUR	617	133	0	% 87,133	537.608,76	3,44
IT0005170839	1,6000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026		EUR	608	131	0	% 90,109	547.862,11	3,50
IT0005323032	2,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2021		EUR	652	652	0	% 90,298	588.744,13	3,77
IT0005274805	2,0500 % Italien, Republik - Bonds 2017/2027		EUR	656	141	0	% 91,036	597.193,14	3,82
NL0011819040	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2016/2026		EUR	517	111	0	% 102,276	528.768,21	3,38
NL0012171458	0,7500 % Niederlande - Anleihe 2017/2027		EUR	526	113	0	% 103,543	544.634,87	3,48
NL0012818504	0,7500 % Niederlande - Anleihe 2018/2028		EUR	347	347	0	% 102,872	356.964,97	2,28
AT0000A1VGK0	0,5000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2017/2027		EUR	305	66	0	% 100,348	306.060,64	1,96
AT0000A1K9C8	0,7500 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2026		EUR	396	85	0	% 103,010	407.920,59	2,61
ES0000012B39	1,4000 % Spanien - Bonos 2019/2028		EUR	719	720	1	% 99,918	718.407,98	4,60
ES00000128H5	1,3000 % Spanien - Obligaciones 2016/2026		EUR	773	167	0	% 100,992	780.671,25	4,99
ES0000012A89	1,4500 % Spanien - Obligaciones 2017/2027		EUR	762	164	0	% 100,992	769.562,77	4,92
ES00000127Z9	1,9500 % Spanien - Obligaciones 2016/2026		EUR	671	144	0	% 106,367	713.719,48	4,57
							<b>EUR</b>	<b>12.317.471,18</b>	<b>78,80</b>
							<b>EUR</b>	<b>15.448.796,96</b>	<b>98,83</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>									
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>									
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle			EUR	134.153,72			% 100,000	134.153,72	0,86
							<b>EUR</b>	<b>134.153,72</b>	<b>0,86</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Abgegrenzte Zinsforderung aus verliehenen Wertpapieren			EUR	176,99				176,99	0,00
Zinsansprüche			EUR	50.653,83				50.653,83	0,32
							<b>EUR</b>	<b>50.830,82</b>	<b>0,33</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-2.252,63				-2.252,63	-0,01
							<b>EUR</b>	<b>-2.252,63</b>	<b>-0,01</b>
<b>Fondsvermögen</b>									
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>15.631.528,87</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>EUR</b>	<b>123,44</b>	
							<b>STK</b>	<b>126.628</b>	

Fußnoten:

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 7-10 UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR		gesamt
			befristet	unbefristet	
<b>Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen</b>					
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:					
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027	EUR 500		504.075,00	
FR0013200813	0,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026	EUR 100		98.792,75	
FR0013131877	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026	EUR 115		116.480,05	
FR0013250560	1,0000 % Frankreich - OAT 2016/2027	EUR 669		698.778,95	
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen</b>				<b>1.418.126,75</b>	<b>1.418.126,75</b>

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 31.08.2018

## 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>					
FR0012938116	1,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2014/2025	EUR	0	596	
IT0005127086	2,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2015/2025	EUR	128	606	
AT0000A1FAP5	1,2000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2015/2025	EUR	0	280	
PTOTEKOE0011	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025	EUR	0	338	
PTOTEUOE0019	4,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2017/2027	EUR	294	294	
ES00000127G9	2,1500 % Spanien - Obligaciones 2015/2025	EUR	186	735	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			2.427

(Basiswerte: 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026 (DE0001102408); 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 (DE0001102416); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026 (DE0001102390); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 (DE0001102424); 0,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026 (FR0013200813))

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

## Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich für den Zeitraum vom 01.03.2018 bis zum 31.08.2018

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		5.013,28	0,040
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		75.425,92	0,596
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		1.035,16	0,008
<b>Summe der Erträge</b>		<b>81.474,36</b>	<b>0,643</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-12.005,17	-0,095
2. Sonstige Aufwendungen		-199,15	-0,002
davon: Verwahrtgelt	-199,15		-0,002
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-12.204,32</b>	<b>-0,096</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>69.270,04</b>	<b>0,547</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		18.347,00	0,145
2. Realisierte Verluste		-34.653,59	-0,274
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-16.306,59</b>	<b>-0,129</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>52.963,45</b>	<b>0,418</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		133.047,28	1,051
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-71.483,47	-0,565
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>61.563,81</b>	<b>0,486</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>114.527,26</b>	<b>0,904</b>

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

## Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2018 EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>12.468.309,47</b>
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00
2. Zwischenausschüttungen		-40.520,96
3. Mittelzufluss (netto)		3.096.810,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	3.096.810,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-7.596,90
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		114.527,26
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	133.047,28	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-71.483,47	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>15.631.528,87</b>

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 1.418.126,75

### Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

DekaBank Deutsche Girozentrale

	EUR	Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
<b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:</b>	EUR	1.605.185,87	
davon:			
Aktien	EUR		
Schuldverschreibungen	EUR		1.605.185,87

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren EUR 930,66

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 1.431,78. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandschädigung in Höhe von EUR 501,12.

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

### Sonstige Angaben

<b>Anteilwert</b>	EUR	123,44
<b>Umlaufende Anteile</b>	STK	126.628
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>		98,83
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>		0,00

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2018 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 31.08.2018 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

0,06

### 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.

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

Verwendete Vermögensgegenstände		Wertpapierleihe
		EUR
	absolut	1.418.126,75
	in % des Fondsvermögens	9,07
<b>10 größte Gegenparteien</b>	Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
	Bruttovolumen offene Geschäfte	1.418.126,75
	Sitzstaat	Deutschland
<b>Arten von Abwicklung und Clearing</b>		Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte).
<b>Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)</b>		
	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	1.418.126,75

### 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.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

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	1.605.185,87

### Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	930,66
in % der Bruttoerträge	65,00

Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)

absolut	501,12
in % der Bruttoerträge	35,00

### 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

9,18

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	Sparebanken Vest
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.605.185,87

### Wiedergelegte 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
Name	J.P. Morgan AG Frankfurt
verwahrter Betrag absolut	1.605.185,87

### 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 3. September 2018  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

# Informationen der Verwaltung.

## **Das DekaBank Depot – Service rund um Ihre Investmentfonds –**

Mit dem DekaBank Depot bieten wir Ihnen die kostengünstige Möglichkeit, verschiedene Investmentfonds Ihrer Wahl in einem einzigen Depot und mit einem Freistellungsauftrag verwahren zu lassen. Hierfür steht Ihnen ein Fondsuniversum von rund 1.000 Fonds der Deka-Gruppe und international renommierter Kooperationspartner zur Verfügung. Das Spektrum eignet sich zur Realisierung der unterschiedlichsten Anlagekonzepte. So können Sie zum Vermögensaufbau aus mehreren Alternativen wählen, unter anderem:

- Für Investmentfonds-Anleger, die regelmäßig sparen möchten, eignet sich der individuell zu gestaltende Deka-FondsSparplan ab einer Mindestanlage von 25,- Euro. Im Rahmen eines auf die eigenen Bedürfnisse abgestimmten Deka-Auszahlplans lässt sich das so aufgebaute Vermögen später gezielt nutzen.
- Für alle, die regelmäßig für ein Kind sparen möchten, ist der Deka-JuniorPlan besonders geeignet. Mit Beträgen ab monatlich 25,- Euro wird für den Vermögensaufbau chancenreich und breit gestreut in Investmentfonds angelegt und dank eines professionellen Anlagemanagements langfristig hohe Ertragsmöglichkeiten genutzt sowie Risiken im Vergleich zu Anlagen in Einzeltiteln spürbar reduziert.

■ Für den systematischen und flexiblen Vermögensaufbau – insbesondere im Rahmen der privaten Altersvorsorge – können Sie zwischen zwei Varianten wählen:

- Deka-ZukunftsPlan: Die individuelle Vorsorgelösung mit intelligentem Anlagekonzept – auch mit Riester-Förderung.
- Deka-BasisRente: Kombiniert als Rürup-Lösung die Vorteile einer staatlich geförderten Investmentanlage mit dem Wachstumspotenzial einer optimierten Vermögensstruktur.

Für die Auftragserteilung können Sie verschiedene Wege nutzen, z.B. Post, Telefon oder Internet über unsere Webpräsenz [www.deka.de](http://www.deka.de)

Auskünfte rund um das DekaBank Depot und Fondsinformationen erhalten Sie über unser Service-Telefon unter der Nummer (0 69) 7147-652. Sie erreichen uns montags bis freitags von 8.00 Uhr bis 18.00 Uhr.

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt

## 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

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.  
(Stand: 31. Dezember 2017)

## Alleingesellschafterin

DekaBank  
Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Michael Rüdiger

Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt;

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  
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;

Mitglied 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 Münning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse,  
Münster

Peter Scherkamp, München

(Stand 03. August 2018)

## Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH,  
Frankfurt

Thomas Ketter

Stellvertretender Vorsitzender des Verwaltungsrates der Deka International S.A.,  
Luxemburg

und der

International Fund Management S.A.,  
Luxemburg

Dr. Ulrich Neugebauer

Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH, Köln

und der

Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln

und der

Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

Michael Schmidt

Thomas Schneider

Vorsitzender des Aufsichtsrats der Deka International S.A.,  
Luxemburg

und der

International Fund Management S.A.,  
Luxemburg

(Stand 03. August 2018)

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Squire  
Am Flughafen  
60549 Frankfurt am Main

**Verwahrstelle**

DekaBank  
Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt

**Rechtsform**

Anstalt des öffentlichen Rechts

**Sitz**

Frankfurt am Main und Berlin

**Eigenkapital**

gezeichnetes und eingezahltes

Kapital: EUR 270,5 Mio.

Eigenmittel: EUR 5.492 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2017)

**Haupttätigkeit**

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft  
sowie Wertpapiergeschäft

Die vorstehenden Angaben werden  
in den Jahres- und Halbjahresberichten  
jeweils aktualisiert.





**Deka Investment GmbH**  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt  
Deutschland

Telefon: +49 (0)69 71 47 – 26 54  
[info.etf@deka.de](mailto:info.etf@deka.de)  
[www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de)

 **Finanzgruppe**