

Halbjahresbericht
zum 31. August 2021.

**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. 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 2021

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 2021 bis zum 31. August 2021.

Die europäische Wirtschaft litt im Berichtszeitraum zunächst weiterhin unter den Belastungen der Corona-Pandemie. So schrumpfte in Deutschland die gesamtwirtschaftliche Leistung im ersten Quartal 2021 merklich. Vor allem der private Konsum büßte durch die Lockdown-Maßnahmen angesichts erneut steigender Infektionszahlen und auftretender Virusmutationen ein. Erst in der zweiten Berichtshälfte mehrten sich die Erholungszeichen und an den Finanzmärkten überwogen optimistische Konjunkturperspektiven. Die Kombination aus erfolgreich verlaufenden Impfmaßnahmen und hoher Liquidität am Markt auf der Suche nach auskömmlichen Renditen befeuerte zudem den Risikoappetit der Anleger.

Eine wichtige Stütze bildete die Geld- und Finanzpolitik. Sowohl die EZB wie auch die US-Notenbank Federal Reserve bekräftigten ihren expansiven Kurs. Zunehmend rückte im Verlauf des Berichtszeitraums die Inflationsentwicklung in den Vordergrund. Die Europäische Zentralbank und viele Marktteilnehmer betrachteten allerdings den teils erheblichen Preisanstieg lediglich als temporäres Phänomen. An den Anleihemärkten war von wachsender Inflationsgefahr wenig zu spüren, die Renditen zeigten sich im Stichtagsvergleich relativ unverändert. Ende August rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei minus 0,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries bei plus 1,3 Prozent.

Die Aktienmärkte erzielten auf Halbjahressicht kräftige Kurssteigerungen, beflügelt von zahlreichen Konjunkturstimuli wie auch der anhaltenden Flutung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken. Einige etablierte Aktienindizes erreichten in diesem Zuge neue Rekordmarken.

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 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 2021	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2021	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 beigelegt sind, erfolgen.

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 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 7-10 (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 7,5 bis 10,5 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 7-10 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	1,2%	1,2%	3,8%

ISIN DE000ETFL151

* 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	DE0001102499	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300214
Löschung	DE0001102457	0.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2018 (2028) 20280814
Löschung	PTOTELOE0028	0.475000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30) 20301017
Löschung	ES0000012F76	0.500000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20300429
Löschung	FR0013341682	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2018(28) 20281124
Löschung	IE00BH3SQ895	1.100000 % Irland EO-Treasury Bonds 2019(29) 20290514
Löschung	PTOTEVOE0018	2.125000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2018(28) 20281016
Löschung	IT0005340929	2.800000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20281130
Neuaufnahme	BE0000352618	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2021(31) 20311021
Neuaufnahme	DE0001102499	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300214
Neuaufnahme	DE0001102531	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) 20310214
Neuaufnahme	FR0014002WK3	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(31) 20311124
Neuaufnahme	NL00150006U0	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(31) 20310714
Neuaufnahme	ES0000012H41	0.100000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20310429
Neuaufnahme	PTOTELOE0028	0.475000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30) 20301017
Neuaufnahme	IT0005422891	0.900000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(31) 20310331

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0013516549	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(30) 20301124	5,85
FR0013407236	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20290524	5,77
DE0001102507	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814	5,61
ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030	5,24
FR0013451507	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20291124	5,21
IT0005365165	3.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(29) 20290731	4,96
DE0001102465	0.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290214	4,96
DE0001102473	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290814	4,87
IT0005383309	1.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(30) 20300331	4,83
IT0005413171	1.650000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20301130	4,81
DE0001102531	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) 20310214	4,59
ES0000012E51	1.450000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20290429	4,50
IT0005422891	0.900000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(31) 20310331	4,37
ES0000012F43	0.600000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20291030	4,30
ES0000012H41	0.100000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20310429	4,11
BE0000347568	0.900000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(29) 20290621	3,50
FR0014002WK3	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(31) 20311124	3,20
NL0014555419	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(30) 20300714	2,75
PTOTEXOE0024	1.950000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2019(29) 20290614	2,62
BE0000349580	0.100000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2020(30) 20300621	2,49
NL0013332430	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2019(29) 20290714	2,44
AT0000A269M8	0.500000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290219	2,37
BE0000352618	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2021(31) 20311021	2,33
AT0000A2CQD2	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(30) 20300219	2,17
NL00150006U0	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(31) 20310714	2,12

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		119.643.343,56	100,01
1. Anleihen		118.614.087,91	99,15
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	112.044.920,64		93,66
- Restlaufzeit über 10 Jahre	6.569.167,27		5,49
2. Forderungen		237.291,87	0,20
3. Bankguthaben		791.964,08	0,66
II. Verbindlichkeiten		-16.170,75	-0,01
III. Fondsvermögen		119.627.173,11	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2021.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2021	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE0001102507	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2030		EUR	6.375	660	12	% 104,336	6.651.401,51	5,56
DE0001102473	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029		EUR	5.539	574	11	% 104,354	5.780.181,91	4,83
DE0001102465	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029 ²⁾		EUR	5.539	574	11	% 106,300	5.887.975,28	4,92
DE0001102531	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Anleihe 2021/2031		EUR	5.226	5.226	0	% 104,155	5.443.114,17	4,55
							EUR	23.762.672,87	19,86
Ausland									
BE0000352618	0,0000 % Belgien, Königreich - Bons 2021/2031		EUR	2.755	2.755	0	% 100,507	2.768.977,49	2,31
BE0000349580	0,1000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2030		EUR	2.873	316	54	% 102,736	2.951.606,43	2,47
BE0000347568	0,9000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2029		EUR	3.797	417	71	% 109,432	4.155.114,06	3,47
FR0013451507	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2018/2029		EUR	6.064	1.021	403	% 101,828	6.174.848,71	5,16
FR0014002WK3	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2031		EUR	3.788	3.788	0	% 100,322	3.800.189,78	3,18
FR0013516549	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2030		EUR	6.860	2.446	0	% 101,183	6.941.120,19	5,80
FR0013407236	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2029		EUR	6.460	1.511	0	% 106,011	6.848.310,60	5,72
IT0005422891	0,9000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2031		EUR	5.059	5.059	0	% 102,352	5.178.007,41	4,33
IT0005383309	1,3500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 1905/1905		EUR	5.359	694	0	% 106,974	5.732.724,87	4,79
IT0005413171	1,6500 % Italien, Republik - Anleihe 2020/2030		EUR	5.212	572	97	% 109,360	5.699.819,75	4,76
IT0005365165	3,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2019/2029		EUR	4.910	757	0	% 119,939	5.889.025,52	4,92
NL0014555419	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2030		EUR	3.167	348	59	% 103,007	3.262.217,12	2,73
NL00150006U0	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2031		EUR	2.452	2.452	0	% 102,587	2.515.434,47	2,10
NL0013332430	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2019/2029		EUR	2.755	302	51	% 105,240	2.899.348,23	2,42
AT0000A2CQD2	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2020/2030		EUR	2.523	446	0	% 102,035	2.574.334,98	2,15
AT0000A269M8	0,5000 % Österreich, Republik - Anleihe 2019/2029		EUR	2.646	303	0	% 106,251	2.811.394,85	2,35
PTOTEXOE0024	1,9500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2019/2029		EUR	2.682	295	50	% 115,931	3.109.269,42	2,60
ES0000012F43	0,6000 % Spanien - Anleihe 2019/2029		EUR	4.892	539	92	% 104,376	5.106.073,92	4,27
ES0000012G34	1,2500 % Spanien - Anleihe 2020/2030		EUR	5.665	622	105	% 109,638	6.211.015,93	5,19
ES0000012H41	0,1000 % Spanien - Bonos 2021/2031		EUR	4.956	4.956	0	% 98,446	4.878.993,67	4,08
ES0000012E51	1,4500 % Spanien - Bonos 2019/2029		EUR	4.808	529	90	% 111,140	5.343.587,64	4,47
							EUR	94.851.415,04	79,29
							EUR	118.614.087,91	99,15
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
			EUR	791.964,08			% 100,000	791.964,08	0,66
Sonstige Vermögensgegenstände									
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen									
			EUR	503,63			EUR	237.291,87	0,20
Zinsansprüche									
			EUR	236.788,24			EUR	503,63	0,00
			EUR				EUR	236.788,24	0,20
Sonstige Verbindlichkeiten									
Sonstige Verbindlichkeiten									
			EUR	-0,30			EUR	-16.170,75	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
			EUR	-16.170,45			EUR	-0,30	-0,00
			EUR				EUR	-16.170,45	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
							EUR	119.627.173,11	100,00 ¹⁾
Umlaufende Anteile									
							EUR	134,53	
							STK	889.251,00	

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 7-10 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	4.835.601		5.140.259,82	
	Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				5.140.259,82	5.140.259,82

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurse per 31.08.2021

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuoordnung 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					
DE0001102499	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2030	EUR	5.090	5.090	
DE0001102457	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2018/2028	EUR	209	4.997	
Ausland					
FR0013341682	0,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2028	EUR	408	6.119	
IE00BH3SQ895	1,1000 % Irland - Anleihe 2019/2029	EUR	176	2.131	
IT0005340929	2,8000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2028	EUR	375	4.547	
PTOTEL0E0028	0,4750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2020/2030	EUR	2.142	2.142	
PTOTEV0E0018	2,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2018/2028	EUR	112	2.679	
ES0000012F76	0,5000 % Spanien - Obligaciones 2020/2030	EUR	387	4.704	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
	unbefristet	EUR			126.083

(Basiswerte: 0,1000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2030 (BE0000349580); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2030 (DE0001102507); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2030 (DE0001102499); 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2018/2028 (DE0001102457); 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029 (DE0001102465); 1,1000 % Irland - Anleihe 2019/2029 (IE00BH3SQ895); 0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2030 (NL0014555419); 0,2500 % Niederlande - Anleihe 2019/2029 (NL0013332430); 1,2500 % Spanien - Anleihe 2020/2030 (ES0000012G34))

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2021 bis zum 31.08.2021

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		8.913,01	0,010
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		404.151,66	0,454
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		3.272,72	0,004
Summe der Erträge		416.337,39	0,468
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-87.089,50	-0,098
2. Sonstige Aufwendungen		-1.437,81	-0,002
davon: Negative Einlagezinsen	-1.437,81		-0,002
Summe der Aufwendungen		-88.527,31	-0,100
III. Ordentlicher Nettoertrag		327.810,08	0,369
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		590.324,47	0,664
2. Realisierte Verluste		-95.808,79	-0,108
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		494.515,68	0,556
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		822.325,76	0,925
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-5.926,08	-0,007
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		506.950,16	0,570
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		501.024,08	0,563
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.323.349,84	1,488

Entwicklung des Sondervermögens

	2021	2022
	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		107.240.142,02
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-151.065,18
2. Zwischenausschüttungen		-193.027,73
3. Mittelzufluss (netto)		11.425.816,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	11.425.816,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-18.041,84
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.323.349,84
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-5.926,08	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	506.950,16	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		119.627.173,11

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 5.140.259,82

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen
 Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten	EUR		5.219.609,17

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	EUR	3.217,64
---	-----	----------

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 3.217,64. 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	134,53
Umlaufende Anteile	STK	889.251,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	99,15
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 31.08.2021 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 31.08.2021 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)	0,04
--	------

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 sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -1.408,61.

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

Wertpapierleihe

Verwendete Vermögensgegenstände	EUR	
	absolut	in % des Fondsvermögens
	5.140.259,82	4,30

10 größte Gegenparteien

Bruttovolumen offene Geschäfte	Name
	Clearstream Banking AG
	5.140.259,82
	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	5.140.259,82

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 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)	5.219.609,17
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	3.217,64
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

4,33

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	Bankia S.A.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	433.886,03
2. Name	Bremen, Freie Hansestadt
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	278.084,73
3. Name	Italien, Republik
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	233.008,48
4. Name	NRW.BANK
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	153.983,17
5. Name	BPCE S.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	146.684,33
6. Name	BNP Paribas S.A.
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	133.036,54
7. Name	Agence Française de Développement
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	123.205,14
8. Name	Porsche Automobil Holding SE
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	117.080,37
9. Name	Landwirtschaftliche Rentenbank
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	116.582,60
10. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	108.881,81

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	1,00
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	5.219.609,17

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 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 2021
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 2020

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Dr. Matthias Danne
Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main und der WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf

Stellvertretende Vorsitzende

Birgit Dietl-Benzin
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning
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 Square
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. August 2021

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