

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2022.

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

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

**.iDeka**  
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 7-10 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-Knappeheit 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](http://www.deka-etf.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. August 2022	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2022	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

**Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigefügt sind, erfolgen.**

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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.
<b>Performance *</b>	-11,3%	-16,2%	-5,8%

**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	DE0001102473	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290814
Löschung	DE0001102499	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300214
Löschung	FR0013451507	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20291124
Löschung	IE00BKFVC899	0.200000 % Irland EO-Treasury Bonds 2020(30) 20301017
Löschung	ES0000012F43	0.600000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20291030
Löschung	IE00BFZRQ242	1.350000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31) 20310317
Löschung	IT0005365165	3.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(29) 20290731
Neuaufnahme	DE0001102499	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300214
Neuaufnahme	DE0001102580	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2032) 20320214
Neuaufnahme	FR0014007L00	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2022(32) 20320524
Neuaufnahme	BE0000354630	0.350000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2022(32) 20320621
Neuaufnahme	NL0015000RP1	0.500000 % Niederlande EO-Bonds 2022(32) 20320714
Neuaufnahme	ES0000012I32	0.500000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20311030
Neuaufnahme	IT0005436693	0.600000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(31) 20310731

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

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0013516549	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(30) 20301124	7,90
FR0014002WK3	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(31) 20311124	6,85
DE0001102507	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814	5,78
ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030	5,28
FR0014007L00	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2022(32) 20320524	5,26
DE0001102564	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) 20310814	5,26
DE0001102580	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2032) 20320214	4,70
IT0005383309	1.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(30) 20300331	4,69
IT0005413171	1.650000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20301130	4,58
ES0000012F76	0.500000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20300429	4,55
ES0000012H41	0.100000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20310429	4,34
IT0005422891	0.900000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(31) 20310331	4,30
DE0001102531	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) 20310214	4,28
ES0000012I32	0.500000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20311030	4,17
IT0005436693	0.600000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(31) 20310731	3,75
NL0014555419	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(30) 20300714	2,82
BE0000352618	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2021(31) 20311021	2,69
NL00150006U0	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(31) 20310714	2,63
BE0000354630	0.350000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2022(32) 20320621	2,62
BE0000349580	0.100000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2020(30) 20300621	2,55
AT0000A2NW83	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(31) 20310219	2,54
AT0000A2CQD2	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(30) 20300219	2,34
PTOTELOE0028	0.475000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30) 20301017	2,22
NL0015000RP1	0.500000 % Niederlande EO-Bonds 2022(32) 20320714	2,16
IE00BMQ5JL65	0.000000 % Irland EO-Treasury Bonds 2021(31) 20311017	1,75

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

## Vermögensübersicht zum 31. August 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>13.958.634,82</b>	<b>100,02</b>
1. Anleihen		13.819.087,70	99,02
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	13.819.087,70		99,02
2. Forderungen		25.475,03	0,18
3. Bankguthaben		114.072,09	0,82
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-2.361,04</b>	<b>-0,02</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>13.956.273,78</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 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										
DE0001102507	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031 <sup>2)</sup>		EUR	893	826	3.225	% 89,483	799.083,19	5,73	
DE0001102564	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031 <sup>2)</sup>		EUR	826	748	3.106	% 87,953	726.491,78	5,21	
DE0001102580	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesschatzanweisungen 2022/2032		EUR	746	987	241	% 86,969	648.788,74	4,65	
DE0001102531	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Anleihe 2021/2031 <sup>2)</sup>		EUR	666	626	2.658	% 88,740	591.008,40	4,23	
							EUR	2.765.372,11	19,81	
Ausland										
BE0000352618	0,0000 % Belgien, Königreich - Bons 2021/2031		EUR	447	425	1.682	% 83,120	371.544,17	2,66	
BE0000349580	0,1000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2030		EUR	404	385	1.522	% 87,265	352.551,93	2,53	
BE0000354630	0,3500 % Belgien, Königreich - Anleihe 2022/2032		EUR	430	569	139	% 84,038	361.364,82	2,59	
FR0014002WK3	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2031		EUR	1.134	1.208	4.238	% 83,409	945.853,07	6,78	
FR0014007L00	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2022/2032		EUR	886	1.275	389	% 82,004	726.558,10	5,21	
FR0013516549	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2030 <sup>2)</sup>		EUR	1.275	1.315	4.423	% 85,643	1.091.943,53	7,82	
IE00BMQ5JL65	0,0000 % Irland - Treasury Bonds 2021/2031		EUR	292	277	1.097	% 82,930	242.155,60	1,74	
IT0005436693	0,5000 % Italien, Republik - Anleihe 2021/2031		EUR	675	1.083	408	% 76,737	517.973,94	3,71	
IT0005422891	0,9000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2031		EUR	743	729	2.699	% 79,989	594.318,27	4,26	
IT0005383309	1,3500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2031		EUR	753	719	2.840	% 85,988	647.489,64	4,64	
IT0005413171	1,6500 % Italien, Republik - Anleihe 2020/2030		EUR	733	700	2.762	% 86,299	632.571,67	4,53	
NL0014555419	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2030		EUR	445	424	1.677	% 87,664	390.104,80	2,80	
NL00150006U0	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2031		EUR	424	404	1.596	% 85,835	363.940,40	2,61	
NL0015000RP1	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2022/2032		EUR	341	512	171	% 87,721	299.128,61	2,14	
AT0000A2CQD2	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2020/2030		EUR	375	365	1.373	% 86,290	323.587,50	2,32	
AT0000A2NW83	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2021/2031		EUR	418	409	1.454	% 84,105	351.559,32	2,52	
PTOTELOE0028	0,4750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2020/2030		EUR	356	330	1.224	% 86,304	307.242,24	2,20	
ES0000012I32	0,0000 % Spanien - Anleihe 1900/1900		EUR	690	912	222	% 83,407	575.508,85	4,12	
ES0000012G34	1,2500 % Spanien - Anleihe 2020/2030		EUR	796	760	3.002	% 91,557	728.796,35	5,22	
ES0000012H41	0,1000 % Spanien - Bonos 2021/2031		EUR	736	679	2.601	% 81,579	600.421,44	4,30	
ES0000012F76	0,5000 % Spanien - Obligaciones 2020/2030		EUR	721	686	2.715	% 87,254	629.101,34	4,51	
							EUR	11.053.715,59	79,20	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	13.819.087,70	99,02
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	114.072,09	0,82
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle								EUR	114.072,09	0,82
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	25.475,03	0,18
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen								EUR	154,78	0,00
Zinsansprüche								EUR	25.320,25	0,18
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-2.361,04	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung								EUR	-2.361,04	-0,02
Fondsvermögen								EUR	13.956.273,78	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert								EUR	112,32	
Umlaufende Anteile								STK	124.251,00	

<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 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:						
FR0013516549	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2030	EUR	400.000		342.570,52	
DE0001102507	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031	EUR	350.000		313.190,50	
DE0001102531	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Anleihe 2021/2031	EUR	476.525		422.868,29	
DE0001102564	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031	EUR	196.000		172.387,88	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen					1.251.017,19	<b>1.251.017,19</b>

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte Kurse per 31.08.2022

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

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
<b>Inland</b>					
DE0001102473	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029	EUR	432	3.292	
DE0001102499	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2030	EUR	942	942	
<b>Ausland</b>					
FR0013451507	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2018/2029	EUR	689	4.563	
IE00BKFC899	0,2000 % Irland - Treasury Bonds 2020/2030	EUR	148	1.126	
IE00BFZRQ242	1,3500 % Irland - Treasury Bonds 2018/2031	EUR	125	953	
IT0005365165	3,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2019/2029	EUR	398	3.031	
ES0000012F43	0,6000 % Spanien - Anleihe 2019/2029	EUR	543	3.293	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
unbefristet		EUR			7.718

(Basiswerte: 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029 (DE0001102473); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031 (DE0001102507); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031 (DE0001102564); 0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Anleihe 2021/2031 (DE0001102531); 0,0000 % Irland - Treasury Bonds 2021/2031 (IE00BMQ5JL65); 1,3500 % Irland - Treasury Bonds 2018/2031 (IE00BFZRQ242))

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

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.03.2022 bis zum 31.08.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		33.926,17	0,273
2. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		881,40	0,007
Summe der Erträge		34.807,57	0,280
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-11.785,63	-0,095
2. Sonstige Aufwendungen		-369,20	-0,003
davon: Negative Einlagezinsen	-369,20		-0,003
Summe der Aufwendungen		-12.154,83	-0,098
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		22.652,74	0,182
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		22.174,90	0,178
2. Realisierte Verluste		-2.283.546,60	-18,378
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-2.261.371,70	-18,200
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-2.238.718,96	-18,018
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		0,00	0,000
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		446.606,14	3,594

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2022 / 2023 EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		59.623.987,20
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-17.625,10
2. Zwischenausschüttungen		-13.925,10
3. Mittelzufluss (netto)		-43.261.526,80
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	13.565.977,60	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-56.827.504,40	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-582.523,60
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.792.112,82
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	0,00	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	446.606,14	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		13.956.273,78

<sup>1)</sup> 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 **1.251.017,19**

**Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen**  
 Clearstream Banking AG

**Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten** EUR **1.289.880,90**

**Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)** EUR **1.112,60**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 1.112,60. 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	112,32
Umlaufende Anteile	STK	124.251,00

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>99,02</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>0,00</b>

**Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände**

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

**Angaben für Indexfonds**

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert) 0,09

**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 -431,41 enthalten.

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

<b>Verwendete Vermögensgegenstände</b>	absolut	1.251.017,18
	in % des Fondsvermögens	8,96

**10 größte Gegenparteien**

Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.251.017,18
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	1.251.017,18

# 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](http://www.eurexrepo.com) entnommen werden.

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

## Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

## Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	1.289.880,90
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	1.112,60
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.

9,05

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Spanien, Königreich
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	853.663,08
2. Name	Italien, Republik
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	49.042,83
3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	42.948,44
4. Name	Portugal, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	41.709,82
5. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	20.056,63
6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	16.114,11
7. Name	European Financial Stability Facility [EFSF]
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	16.012,75
8. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	15.324,63
9. Name	BPCE SFH
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	13.740,84
10. Name	HSBC SFH [France]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	13.301,77

## 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	1.289.880,90

# 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 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 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 2022

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



**Deka Investment GmbH**

Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
[www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de)

