

Halbjahresbericht
zum 31. August 2020.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign
Diversified 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 2020

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2020 bis zum 31. August 2020.

Zu Beginn des Berichtszeitraums befand sich die globale Wirtschaft bereits tief in der Corona-Krise. Die Beschränkungen der Verkehrsfreiheit und weitgehende Lockdown-Maßnahmen trübten die weltweiten Konjunkturperspektiven in unvergleichbarem Ausmaß ein. Die Ende Juli veröffentlichten BIP-Daten der USA und Deutschlands für das zweite Quartal 2020 dokumentierten den dramatischen Einbruch der Wirtschaftsleistung, wobei sich seit Mai die Anzeichen für eine Erholung häufen. Die positiven Tendenzen setzten sich auch gegen Ende der Berichtsperiode mit ermutigenden Zahlen fort. So erholte sich beispielsweise das ifo Geschäftsklima und auch der Arbeitsmarkt in den USA zeigte sich stabiler.

Seitens der Geld- und Fiskalpolitik erfolgte als Reaktion auf die durch die Corona-Krise gestiegenen konjunkturellen Risiken die Implementierung umfangreicher Unterstützungspakete. Die EZB stockte im Verlauf der Pandemie ihr PEPP-Anleihekaufprogramm auf 1,35 Bio. Euro auf. Auch die US-Notenbank kauft mittlerweile direkt Unternehmensanleihen und senkte die Leitzinsen massiv. Zudem verkündete sie im August eine bemerkenswerte Umorientierung, die die bisherige Ausrichtung der Geldpolitik an der Inflationsmarke von 2 Prozent flexibler sieht und die Beschäftigung stärker in den Fokus nimmt. Ende August rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei knapp minus 0,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries mit plus 0,7 Prozent und damit auf signifikant niedrigerem Niveau als Anfang März.

Ein Großteil der Aktienmärkte befand sich aufgrund der pessimistischen Pandemie-Szenarien Anfang März bereits im freien Fall. Die staatlichen Hilfspakete, die Versorgung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken sowie die Hoffnung auf eine Eindämmung der Pandemie sorgten im Anschluss jedoch für eine spürbare Beruhigung der Märkte und eine kräftige Gegenbewegung. Das Gros der etablierten Aktienbörsen konnte auf Halbjahressicht dementsprechend teils deutliche Kurszuwächse verbuchen.

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 2020	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2020	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	13

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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 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 mindestens 10 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 10+ UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	-2,0%	-1,7%	9,2%

ISIN	DE000ETFL169
-------------	--------------

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FI4000306758	1.125000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2018(34) 20340414
Löschung	FR0013154044	1.250000 % Frankreich EO-OAT 2016(36) 20360524
Löschung	ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030
Löschung	IE00BFZRPZ02	1.300000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(33) 20330514
Löschung	AT0000A1K9F1	1.500000 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2016(47) 20470219
Löschung	BE0000338476	1.600000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(47) Ser. 78 20470621
Löschung	BE0000340498	2.150000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(66) Ser. 80 20660621
Löschung	IT0005162828	2.700000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(47) 20470228
Löschung	ES00000128C6	2.900000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(46) 20461030
Neuaufnahme	DE0001102515	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2035) 20350514
Neuaufnahme	BE0000350596	0.400000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2020(40) 20400621
Neuaufnahme	FI4000306758	1.125000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2018(34) 20340414
Neuaufnahme	ES0000012G42	1.200000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(40) 20401030
Neuaufnahme	ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030
Neuaufnahme	IE00BH3SQB22	1.500000 % Irland EO-Treasury Bonds 2019(50) 20500514
Neuaufnahme	FR0013234333	1.750000 % Frankreich EO-OAT 2017(39) 20390624
Neuaufnahme	BE0000343526	2.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(57) Ser. 83 20570621
Neuaufnahme	IT0005358806	3.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(35) 20350228

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
DE0001102432	1.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2048) 20480814		8,98
ES00000128Q6	2.350000 % Spanien EO-Obligaciones 2017(33) 20330729		6,28
IT0005273013	3.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(48) 20480229		5,62
FR0013313582	1.250000 % Frankreich EO-OAT 2018(34) 20340524		5,56
ES0000012B47	2.700000 % Spanien EO-Bonos 2018(48) 20481030		5,29
ES0000012E69	1.850000 % Spanien EO-Bonos 2019(35) 20350729		5,22
FR0013257524	2.000000 % Frankreich EO-OAT 2017(48) 20480524		5,07
IT0005240350	2.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(33) 20330831		4,99
IT0005358806	3.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(35) 20350228		4,83
FR0013234333	1.750000 % Frankreich EO-OAT 2017(39) 20390624		4,83
IT0005321325	2.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(38) 20380831		4,70
FR0013404969	1.500000 % Frankreich EO-OAT 2019(50) 20500524		4,62
DE0001102515	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2035) 20350514		3,88
DE0001102481	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2050) 20500814		3,85
ES0000012G42	1.200000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(40) 20401030		3,35
AT0000A1XML2	2.100000 % Österreich, Republik EO-Med.-Term Notes 2017(2117) 21170919		3,27
NL0013552060	0.500000 % Niederlande EO-Anl. 2019(40) 20400114		2,76
BE0000348574	1.700000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(50) 20500621		2,71
BE0000343526	2.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(57) Ser. 83 20570621		2,65
BE0000346552	1.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86 20330421		2,42
PTOTEWOE0017	2.250000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2018(34) 20340417		2,34
IE00BV8C9B83	1.700000 % Irland EO-Treasury Bonds 2017(37) 20370514		1,97
IE00BH3SQB22	1.500000 % Irland EO-Treasury Bonds 2019(50) 20500514		1,79
IE00BFZRQ242	1.350000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31) 20310317		1,60
BE0000350596	0.400000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2020(40) 20400621		1,40

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2020.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		18.553.300,98	100,01
1. Anleihen		18.345.350,09	98,89
- Restlaufzeit über 10 Jahre	18.345.350,09		98,89
2. Forderungen		99.565,58	0,54
3. Bankguthaben		108.385,31	0,58
II. Verbindlichkeiten		-2.555,44	-0,01
III. Fondsvermögen		18.550.745,54	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2020.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2020	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE0001102481	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2050		EUR	719	866.000	440	% 98,300	706.776,93	3,81
DE0001102515	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2035		EUR	693	693.000	0	% 102,670	711.501,37	3,84
DE0001102432	1,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2048		EUR	1.232	1.629.000	1.187	% 133,752	1.647.825,63	8,88
							EUR	3.066.103,93	16,53
Ausland									
BE0000343526	0,0000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2017/2057		EUR	318	597	279	% 152,980	486.475,35	2,62
BE0000350596	0,4000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2040		EUR	257	257	0	% 100,338	257.867,71	1,39
BE0000346552	1,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2018/2033		EUR	384	530	457	% 115,688	444.243,26	2,39
BE0000348574	1,7000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2050		EUR	380	469	363	% 130,724	496.752,00	2,68
FR0013313582	1,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2034		EUR	881	1.149	778	% 115,890	1.020.993,28	5,50
FR0013234333	1,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2016/2039		EUR	697	1.317	620	% 127,115	885.988,76	4,78
FR0013257524	2,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2048		EUR	673	848	698	% 138,234	930.313,81	5,01
FR0013404969	1,5000 % Frankreich, Republik - Obl. ass. du Trésor 2018/2050		EUR	675	851	701	% 125,518	847.246,37	4,57
IE00BFZRQ242	1,3500 % Irland - Treasury Bonds 2018/2031		EUR	257	367	336	% 114,574	294.454,00	1,59
IE00BH3SQB22	1,5000 % Irland - Treasury Bonds 2019/2050		EUR	263	263	0	% 124,823	328.285,31	1,77
IE00BV8C9B83	1,7000 % Irland - Treasury Bonds 2017/2037		EUR	293	418	383	% 123,425	361.633,79	1,95
IT0005240350	2,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2033		EUR	809	1.086	829	% 113,096	914.945,51	4,93
IT0005321325	2,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2038		EUR	720	1.021	820	% 119,809	862.624,66	4,65
IT0005358806	3,3500 % Italien, Republik - Medium Term Notes 2018/2035		EUR	712	1.399	687	% 124,522	886.593,44	4,78
IT0005273013	3,4500 % Italien, Republik - B.T.P. 2017/2048		EUR	788	1.118	898	% 130,773	1.030.493,60	5,55
NL0013552060	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2019/2040		EUR	462	578	448	% 109,792	507.237,24	2,73
AT0000A1XML2	2,1000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2017/2117		EUR	308	432	390	% 194,576	599.293,77	3,23
PTOTEWOE0017	2,2500 % Portugal, Republik - Obligations 2018/2034		EUR	356	503	424	% 120,695	429.672,56	2,32
ES0000012B47	2,7000 % Spanien - Bonos 2018/2048		EUR	714	911	679	% 136,080	971.611,20	5,24
ES00000128Q6	2,3500 % Spanien - Obligaciones 2017/2033		EUR	946	1.225	901	% 121,739	1.151.650,94	6,21
ES0000012G42	1,2000 % Spanien, Königreich - Anleihe 2020/2040		EUR	591	593	2	% 103,890	613.989,90	3,31
ES0000012E69	1,8500 % Spanien, Königreich - Bonos 2019/2035		EUR	826	1.061	652	% 115,845	956.879,70	5,16
Summe Wertpapiervermögen							EUR	15.279.246,16	82,36
							EUR	18.345.350,09	98,89
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	108.385,31	0,58
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle			EUR	108.385,31		% 100,000		108.385,31	0,58
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	99.565,58	0,54
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	3,04				3,04	0,00
Zinsansprüche			EUR	99.562,54				99.562,54	0,54
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-2.555,44	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-2.555,44				-2.555,44	-0,01
Fondsvermögen							EUR	18.550.745,54	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	159,12	
Umlaufende Anteile							STK	116.581,00	

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.08.2020

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					
Ausland					
BE0000338476	1,6000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2047	EUR	810	1.310	
BE0000340498	2,1500 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2066	EUR	508	748	
FI4000306758	1,1250 % Finnland, Republik - Government Bonds 2018/2034	EUR	512	512	
FR0013154044	1,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2036	EUR	1.069	1.728	
IE00BFZRPZ02	1,3000 % Irland - Treasury Bonds 2018/2033	EUR	338	547	
IT0005162828	2,7000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2047	EUR	974	1.575	
AT0000A1K9F1	1,5000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2047	EUR	497	804	
ES00000128C6	2,9000 % Spanien - Obligaciones 2016/2046	EUR	933	1.509	
ES0000012G34	1,2500 % Spanien, Königreich - Anleihe 2020/2030	EUR	1.442	1.442	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			15.497

(Basiswerte: 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2050 (DE0001102481); 1,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2048 (DE0001102432); 1,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2036 (FR0013154044); 2,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2048 (FR0013257524); 1,5000 % Frankreich, Republik - Obl. ass. du Trésor 2018/2050 (FR0013404969); 1,3000 % Irland - Treasury Bonds 2018/2033 (IE00BFZRPZ02); 1,3500 % Irland - Treasury Bonds 2018/2031 (IE00BFZRQ242); 1,7000 % Irland - Treasury Bonds 2017/2037 (IE00BV8C9B83); 2,2500 % Portugal, Republik - Obligations 2018/2034 (PTOTIEWOE0017))

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2020 bis zum 31.08.2020

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		7.347,85	0,063
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		132.636,62	1,138
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		242,60	0,002
Summe der Erträge		140.227,07	1,203
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-13.674,08	-0,117
2. Sonstige Aufwendungen		-293,16	-0,003
davon: Negative Einlagezinsen	-293,16		-0,003
Summe der Aufwendungen		-13.967,24	-0,120
III. Ordentlicher Nettoertrag		126.259,83	1,083
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		978.203,80	8,391
2. Realisierte Verluste		-1.533,68	-0,013
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		976.670,12	8,378
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.102.929,95	9,461
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-570.690,73	-4,895
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-57.958,89	-0,497
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-628.649,62	-5,392
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		474.280,33	4,068

Entwicklung des Sondervermögens		2020 / 2021
	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		14.112.002,74
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-33.952,65
2. Zwischenausschüttungen		-107.254,52
3. Mittelzufluss (netto)		3.590.191,06
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	21.054.603,66	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-17.464.412,60	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		515.478,58
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		474.280,33
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-570.690,73	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-57.958,89	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		18.550.745,54

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich) EUR **418,55**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betrugen im Geschäftszeitraum EUR 418,55. 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	159,12
Umlaufende Anteile	STK	116.581,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,89
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 31.08.2020 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 31.08.2020 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	0,09
---	------

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 EUR -423,29 enthalten.

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

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

	absolut	418,55
	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.
---	---

Frankfurt am Main, den 1. September 2020
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 2019

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
Ostsächsischen Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)

Jörg Boysen

Thomas Ketter

Mitglied der Geschäftsführung der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Thomas Schneider

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,
Luxemburg
Mitglied der Geschäftsführung der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The 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 2020

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