

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2021.

**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 2021

## 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 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](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 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 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.
<b>Performance *</b>	1,0%	0,8%	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	BE0000352618	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2021(31) 20311021
Löschung	IE00BMQ5JL65	0.000000 % Irland EO-Treasury Bonds 2021(31) 20311017
Löschung	FR0013234333	1.750000 % Frankreich EO-OAT 2017(39) 20390624
Löschung	FR0013257524	2.000000 % Frankreich EO-OAT 2017(48) 20480524
Löschung	BE0000343526	2.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(57) Ser. 83 20570621
Löschung	ES00000128Q6	2.350000 % Spanien EO-Obligaciones 2017(33) 20330729
Löschung	IT0005273013	3.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(48) 20480229
Neuaufnahme	DE0001102549	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2036) 20360514
Neuaufnahme	NL0015000B11	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(38) 20380114
Neuaufnahme	BE0000350596	0.400000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2020(40) 20400621
Neuaufnahme	FR0013515806	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2020(40) 20400524
Neuaufnahme	FR0013480613	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2020(52) 20520524
Neuaufnahme	IT0005433195	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(37) 20370228
Neuaufnahme	ES0000012B47	2.700000 % Spanien EO-Bonos 2018(48) 20481030

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
DE0001102432	1.250000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2048) 20480814	7,52
FR0013313582	1.250000	% Frankreich EO-OAT 2018(34) 20340524	6,41
ES0000012E69	1.850000	% Spanien EO-Bonos 2019(35) 20350729	6,33
FR0013404969	1.500000	% Frankreich EO-OAT 2019(50) 20500524	5,80
DE0001102481	0.000000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2050) 20500814	5,17
IT0005358806	3.350000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(35) 20350228	4,92
ES0000012B47	2.700000	% Spanien EO-Bonos 2018(48) 20481030	4,85
IT0005321325	2.950000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(38) 20380831	4,85
IT0005398406	2.450000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(50) 20500831	4,79
FR0013480613	0.750000	% Frankreich EO-OAT 2020(52) 20520524	4,68
ES0000012G00	1.000000	% Spanien EO-Obligaciones 2020(50) 20501030	4,53
DE0001102515	0.000000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2035) 20350514	4,38
ES0000012G42	1.200000	% Spanien EO-Obligaciones 2020(40) 20401030	4,28
IT0005433195	0.950000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(37) 20370228	3,62
BE0000348574	1.700000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(50) 20500621	3,29
FR0013515806	0.500000	% Frankreich EO-OAT 2020(40) 20400524	3,18
BE0000346552	1.250000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86 20330421	3,08
NL0013552060	0.500000	% Niederlande EO-Anl. 2019(40) 20400114	3,01
DE0001102549	0.000000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2036) 20360514	3,00
AT0000A1XML2	2.100000	% Österreich, Republik EO-Med.-Term Notes 2017(2117) 21170919	2,67
PTOTEWOE0017	2.250000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2018(34) 20340417	2,29
IE00BH3SQB22	1.500000	% Irland EO-Treasury Bonds 2019(50) 20500514	2,05
NL0015614579	0.000000	% Niederlande EO-Anl. 2020(52) 20520114	1,99
BE0000350596	0.400000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2020(40) 20400621	1,78
NL0015000B11	0.000000	% Niederlande EO-Anl. 2021(38) 20380114	1,51

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>13.647.793,57</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		13.498.079,25	98,92
- Restlaufzeit über 10 Jahre	13.498.079,25		98,92
2. Forderungen		68.008,74	0,50
3. Bankguthaben		81.705,58	0,60
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-1.852,71</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>13.645.940,86</b>	<b>100,00</b>

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



# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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									
DE0001102481	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2050		EUR	716	659	768	% 97,492	698.039,43	5,12
DE0001102515	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2035		EUR	575	593	995	% 102,771	590.933,25	4,33
DE0001102432	1,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2048		EUR	767	745	1.085	% 132,242	1.014.292,31	7,43
							EUR	2.303.264,99	16,88
Ausland									
BE0000350596	0,4000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2040		EUR	243	420	177	% 98,633	239.676,98	1,76
BE0000346552	1,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2018/2033		EUR	363	355	379	% 114,538	415.771,71	3,05
BE0000348574	1,7000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2050		EUR	354	347	315	% 125,168	443.093,27	3,25
DE0001102549	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2036		EUR	396	628	232	% 102,168	404.583,58	2,96
FR0013515806	0,5000 % Frankreich - Anleihe 2020/2040		EUR	427	526	99	% 100,769	430.282,95	3,15
FR0013480613	0,7500 % Frankreich - Anleihe 2019/2052		EUR	634	1.074	440	% 99,717	632.204,13	4,63
FR0013313582	1,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2034		EUR	759	717	771	% 113,924	864.686,35	6,34
FR0013404969	1,5000 % Frankreich - Anleihe 2018/2050		EUR	650	616	662	% 120,546	783.545,75	5,74
IE00BH3SQB22	1,5000 % Irland - Treasury Bonds 2019/2050		EUR	232	224	247	% 119,380	276.961,60	2,03
IT0005433195	0,9700 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2037		EUR	505	622	117	% 96,773	488.704,56	3,58
IT0005398406	2,4500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2050		EUR	551	489	625	% 117,429	647.032,14	4,74
IT0005321325	2,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2038		EUR	521	462	591	% 125,732	655.064,50	4,80
IT0005358806	3,3500 % Italien, Republik - Anleihe 2018/2035		EUR	515	457	585	% 129,026	664.481,33	4,87
NL0015614579	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2052		EUR	283	253	323	% 95,024	268.918,12	1,97
NL0015000B11	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2038		EUR	205	367	162	% 99,751	204.488,85	1,50
NL0013552060	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2019/2040		EUR	373	386	403	% 109,102	406.949,34	2,98
AT0000A1XML2	2,1000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2017/2117		EUR	209	185	236	% 172,885	361.330,01	2,65
PTOTEW0E0017	2,2500 % Portugal, Republik - Obligations 2018/2034		EUR	252	228	277	% 122,830	309.531,60	2,27
ES0000012G00	1,0000 % Spanien - Anleihe 2020/2050		EUR	651	643	652	% 93,961	611.685,26	4,48
ES0000012G42	1,2000 % Spanien - Anleihe 2020/2040		EUR	553	504	594	% 104,304	576.801,12	4,23
ES0000012E69	1,8500 % Spanien - Anleihe 2019/2035		EUR	733	713	880	% 116,474	853.754,57	6,26
ES0000012B47	2,7000 % Spanien - Bonos 2018/2048 <sup>2)</sup>		EUR	483	899	416	% 135,666	655.266,54	4,80
							EUR	11.194.814,26	82,04
							EUR	13.498.079,25	98,92
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
	Verwahrstelle		EUR	81.705,58			% 100,000	81.705,58	0,60
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	3,40			EUR	68.008,74	0,50
	Zinsansprüche		EUR	68.005,34			EUR	3,40	0,00
			EUR				EUR	68.005,34	0,50
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-1.852,71			EUR	-1.852,71	-0,01
Fondsvermögen									
	Anteilwert						EUR	13.645.940,86	100,00 <sup>1)</sup>
	Umlaufende Anteile						EUR	158,50	
							STK	86.096,00	

<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 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:						
ES0000012B47	2,7000 % Spanien - Bonos 2018/2048	EUR	430.000		583.363,59	
	Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				583.363,59	<b>583.363,59</b>

## 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
<b>Ausland</b>					
BE0000352618	0,0000 % Belgien, Königreich - Bons 2021/2031	EUR	60	320	
BE0000343526	2,2500 % Belgien, Königreich - Anleihe 2017/2057	EUR	62	331	
FR0013234333	1,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2016/2039	EUR	140	749	
FR0013257524	2,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2048	EUR	324	964	
IE00BMQ5JL65	0,0000 % Irland - Treasury Bonds 2021/2031	EUR	55	294	
IT0005273013	3,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2048	EUR	323	1.034	
ES00000128Q6	2,3500 % Spanien - Obligaciones 2017/2033	EUR	191	1.025	
<b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b>					
	unbefristet	EUR			8.325

(Basiswerte: 0,4000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2040 (BE0000350596); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2050 (DE0001102481); 0,7500 % Frankreich - Anleihe 2019/2052 (FR0013480613); 1,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2034 (FR0013313582); 1,5000 % Frankreich - Anleihe 2018/2050 (FR0013404969); 1,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2048 (DE0001102432); 2,7000 % Spanien - Bonos 2018/2048 (ES0000012B47))

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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 <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		6.169,14	0,072
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		91.232,69	1,060
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		252,47	0,003
Summe der Erträge		97.654,30	1,134
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-11.449,48	-0,133
2. Sonstige Aufwendungen		-234,98	-0,003
davon: Negative Einlagezinsen	-234,98		-0,003
Summe der Aufwendungen		-11.684,46	-0,136
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		85.969,84	0,999
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		336.685,80	3,911
2. Realisierte Verluste		-446.634,35	-5,188
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-109.948,55	-1,277
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-23.978,71	-0,279
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-207.167,14	-2,406
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		301.085,96	3,497
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		93.918,82	1,091
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		69.940,11	0,812

Entwicklung des Sondervermögens

	2021 / 2022
	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	17.214.782,29
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-50.956,48
2. Zwischenausschüttungen	-56.230,88
3. Mittelzufluss (netto)	-3.492.676,30
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	11.756.110,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-15.248.786,30
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-38.917,88
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	69.940,11
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-207.167,14
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	301.085,96
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	13.645.940,86

<sup>1)</sup> Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF Anhang.

<b>Angaben nach der Derivateverordnung</b>			
<b>Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure</b>	EUR		<b>583.363,59</b>
<b>Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen</b>			
Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)			
		<b>Kurswert in EUR</b>	
		<b>befristet</b>	<b>unbefristet</b>
<b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten</b>	EUR		<b>662.568,25</b>
<b>Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)</b>	EUR		<b>286,61</b>
Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 286,61. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.			
<b>Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.</b>			
<b>Sonstige Angaben</b>			
Anteilwert	EUR		158,50
Umlaufende Anteile	STK		86.096,00
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>			<b>98,92</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>			<b>0,00</b>
<b>Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände</b>			
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	
<b>Angaben für Indexfonds</b>			
Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)			0,08
<b>Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>			
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.			
<b>Angaben zu den sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)</b>			
In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -251,66.			
<b>Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte</b>			
		<b>Wertpapierleihe</b>	
		<b>EUR</b>	
<b>Verwendete Vermögensgegenstände</b>			
	absolut	583.363,59	
	in % des Fondsvermögens	4,27	
<b>10 größte Gegenparteien</b>			
	Name	Clearstream Banking AG	
	Bruttovolumen offene Geschäfte	583.363,59	
	Sitzstaat	Deutschland	
<b>Arten von Abwicklung und Clearing</b>			Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem) und 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	583.363,59	

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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)	662.568,25
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	286,61
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.

4,32

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	NRW.BANK
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	62.195,74
2. Name	Bankia S.A.
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	50.381,13
3. Name	Bremen, Freie Hansestadt
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	32.289,67
4. Name	Italien, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	27.055,39
5. Name	BPCE S.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	17.032,85
6. Name	BNP Paribas S.A.
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	15.447,51
7. Name	Agence Française de Développement
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	14.305,93
8. Name	Porsche Automobil Holding SE
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	13.608,54
9. Name	Landwirtschaftliche Rentenbank
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	13.538,05
10. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	12.642,86

## 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	662.568,25

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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 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 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](http://www.deka-etf.de)