

Halbjahresbericht
zum 31. August 2022.

**Deka iBoxx € Liquid Germany
Covered Diversified 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 2022

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified 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-Knappheit 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 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	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	16

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 Germany Covered Diversified UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified 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 Germany Covered Diversified (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der 30 größten und umsatzstärksten deutschen Jumbo Pfandbriefe ab. 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 Germany Covered Diversified UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	-8,6%	-12,6%	-4,9%

ISIN DE000ETFL359

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

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	DE000A2YNVM8	0.010000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15292 v.19(25) 20251015
Löschung	DE000A289PH2	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1233 20(28) 20281026
Löschung	DE000LB2CQG8	0.010000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.812 v.20(27) 20270715
Löschung	DE000HV2ASU1	0.010000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2064 v.19(27) 20271118
Löschung	DE000AAR0249	0.125000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024) 20240131
Löschung	DE000CZ40NNO	0.125000 % Commerzbank AG MTH S.P29 v.19(24) 20240108
Löschung	DE000A1KRJT0	0.125000 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.2019(2027) 20270522
Löschung	DE000CZ40MW3	0.250000 % Commerzbank AG MTH S.P25 v.18(23) 20230912
Löschung	DE000A2LQNP8	0.250000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15286 v.19(24) 20240128
Löschung	DE000A1KRJR4	0.250000 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.2018(2023) 20231008
Löschung	DE000DHY5025	0.750000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.502 v.19(29) 20290304
Neuaufnahme	DE000A3E5K73	0.010000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15304 v.21(26) 20260824
Neuaufnahme	DE000CZ45W16	0.500000 % Commerzbank AG MTH S.P49 v.22(27) 20270314
Neuaufnahme	DE000HV2AYU9	0.500000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-OPF S.2118 v.22(27) 20270222
Neuaufnahme	DE000A2YNWA1	0.625000 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(29) 20290224
Neuaufnahme	DE000A3MP619	0.750000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1242 22(29) 20291120
Neuaufnahme	DE000A3T0YH5	1.000000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15317 v.22(26) 20260412
Neuaufnahme	DE000MHB30J1	1.250000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1989 v.22(30) 20300213
Neuaufnahme	DE000AAR0330	1.375000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.243 v.2022(2029) 20290131
Neuaufnahme	DE000BHY0SB0	1.750000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(32) 20320509
Neuaufnahme	DE000A30WFU3	1.750000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15322 v.22(27) 20270228
Neuaufnahme	DE000LB2ZV93	1.750000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.829 v.22(28) 20280227

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
DE000CZ45W16	0.500000 % Commerzbank AG MTH S.P49 v.22(27) 20270314	5,20
DE000A2YNWA1	0.625000 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(29) 20290224	5,05
DE000HV2AS10	0.250000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2071 v.20(32) 20320114	4,60
XS2106576494	0.010000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H342 v.20(25) 20250121	4,45
XS2433126807	0.010000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H346 v.22(27) 20270718	4,20
DE000A1KRJV6	0.010000 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.2021(2028) 20281006	4,08
DE000CZ45VS1	0.010000 % Commerzbank AG MTH S.P36 v.20(30) 20300310	3,92
DE000LB2ZV93	1.750000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.829 v.22(28) 20280227	3,66
XS1883355601	0.500000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H321 v.18(25) 20250924	3,56
DE000HV2AYU9	0.500000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-OPF S.2118 v.22(27) 20270222	3,47
DE000MHB30J1	1.250000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1989 v.22(30) 20300213	3,47
DE000A3E5UY4	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1239 21(26) 20261025	3,42
DE000A3MP619	0.750000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1242 22(29) 20291120	3,35
DE000HV2ATM6	0.010000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2091 v.20(28) 20280914	3,26
DE000A3H2TQ6	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1235 21(29) 20290419	3,22
DE000BHY0H34	0.125000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.21(30) 20300117	3,18
DE000A3H2TK9	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1234 21(30) 20300328	3,14
DE000HV2AYA1	0.010000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2100 v.20(30) 20300623	3,12
DE000CZ45WY7	0.250000 % Commerzbank AG MTH S.P47 v.22(32) 20320111	3,06
XS2056484889	0.010000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H337 v.2019(29) 20290925	2,97
DE000A30WFU3	1.750000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15322 v.22(27) 20270228	2,75
DE000A3T0YH5	1.000000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15317 v.22(26) 20260412	2,69
DE000BHY0SB0	1.750000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(32) 20320509	2,65
DE000AAR0330	1.375000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.243 v.2022(2029) 20290131	2,64
DE000BHY0HZ2	0.010000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.21(26) 20260823	2,58
DE000A3E5K73	0.010000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15304 v.21(26) 20260824	2,57
DE000A2YNVY3	0.100000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15294 v.20(28) 20280120	2,50
DE000MHB29J3	0.125000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1980 v.22(29) 20290131	2,45
DE000LB2ZSM3	0.125000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.827 v.22(29) 20290723	2,42
DE000AAR0314	0.125000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.240 v.2022(2030) 20300131	2,37

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2022.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		105.309.332,27	100,01
1. Anleihen		104.239.595,91	98,99
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	4.656.992,34		4,42
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	31.690.385,90		30,10
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	30.487.769,11		28,95
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	37.404.448,56		35,52
2. Forderungen		177.265,80	0,17
3. Bankguthaben		892.470,56	0,85
II. Verbindlichkeiten		-8.846,94	-0,01
III. Fondsvermögen		105.300.485,33	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified 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										
DE000AAR0314	0,1250 % Aareal Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2030	EUR		2.900	500	600	% 84,454	2.449.177,89	2,33	
DE000AAR0330	1,3750 % Aareal Bank AG - Pfandbriefe 2022/2029	EUR		2.900	2.900	0	% 94,026	2.726.754,00	2,59	
DE000BHY0H22	0,0100 % Berlin Hyp AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2026 ²⁾	EUR		2.933	505	612	% 91,638	2.687.732,86	2,55	
DE000BHY0H34	0,1250 % Berlin Hyp AG - Hyp. Pfandbriefe 2021/2030	EUR		3.911	673	815	% 84,967	3.323.040,99	3,16	
DE000BHY0S80	1,7500 % Berlin Hyp AG - Pfandbriefe 2022/2032	EUR		2.933	2.933	0	% 94,294	2.765.628,65	2,63	
DE000CZ45VS1	0,0100 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2020/2030 ²⁾	EUR		4.888	841	1.020	% 83,681	4.090.320,93	3,88	
DE000CZ45WY7	0,2500 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2032	EUR		3.911	1.944	2.007	% 81,581	3.190.618,05	3,03	
DE000A3E5K73	0,0100 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Pfandbriefe 2021/2026	EUR		2.900	2.900	0	% 91,559	2.655.196,50	2,52	
DE000A2YNVY3	0,1000 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2028	EUR		2.900	500	600	% 88,823	2.575.858,01	2,45	
DE000A30WUFU3	1,7500 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Pfandbriefe 2022/2027	EUR		2.933	2.933	0	% 97,799	2.868.444,96	2,72	
DE000A3E5UY4	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2026	EUR		3.911	673	815	% 91,217	3.567.483,96	3,39	
DE000A3H2TQ6	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2029	EUR		3.911	673	815	% 85,779	3.354.824,90	3,19	
DE000A3H2TK9	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2030	EUR		3.911	673	815	% 83,823	3.278.319,09	3,11	
DE000A1KRJV6	0,0100 % ING-DiBa AG - Hyp. Pfandbriefe 2021/2028	EUR		4.900	800	1.000	% 86,977	4.261.863,20	4,05	
DE000LB2ZSM3	0,1250 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2029	EUR		2.900	500	600	% 86,096	2.496.795,60	2,37	
DE000LB2ZV93	1,7500 % Landesbank Baden-Württemberg - Pfandbriefe 2022/2028	EUR		3.911	3.911	0	% 97,571	3.816.009,24	3,62	
XS2106576494	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2025	EUR		4.900	800	1.000	% 95,041	4.656.992,34	4,42	
XS2433126807	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027 ²⁾	EUR		4.900	800	1.000	% 89,738	4.397.151,22	4,18	
XS2056484889	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Öff. MT Pfandbriefe 2019/2029	EUR		3.700	1.300	500	% 84,901	3.141.352,17	2,98	
XS1883355601	0,5000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2018/2025	EUR		3.900	600	800	% 95,051	3.706.987,44	3,52	
DE000MHB29J3	0,1250 % Münchener Hypothekenbank eG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2029	EUR		2.933	505	612	% 86,989	2.551.383,26	2,42	
DE000A2YNWA1	0,6250 % NG-DiBa AG - Pfandbriefe 2022/2029	EUR		5.900	6.800	900	% 89,850	5.301.160,62	5,03	
DE000HV2ATM6	0,0100 % UniCredit Bank AG - Pfandbriefe 2020/2028	EUR		3.911	673	815	% 87,014	3.403.120,28	3,23	
DE000HV2AYA1	0,0100 % UniCredit Bank AG - Pfandbriefe 2020/2030	EUR		3.911	1.376	606	% 83,229	3.255.083,45	3,09	
DE000HV2AS10	0,2500 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2032	EUR		5.866	1.009	1.223	% 81,727	4.794.126,35	4,55	
DE000HV2AYU9	0,5000 % UniCredit Bank AG - Pfandbriefe 2022/2027	EUR		3.900	4.500	600	% 92,536	3.608.913,75	3,43	
							EUR	88.924.339,71	84,45	
Ausland										
DE000CZ45W16	0,5000 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2022/2027	EUR		5.866	6.776	910	% 92,413	5.420.944,82	5,15	
DE000A3TOYH5	1,0000 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Pfandbriefe 2022/2026	EUR		2.900	3.400	500	% 95,777	2.777.530,39	2,64	
DE000A3MP619	0,7500 % DZ HYP AG - Pfandbriefe 2022/2029	EUR		3.911	4.517	606	% 89,452	3.498.461,46	3,32	
DE000MHB30J1	1,2500 % Münchener Hypothekenbank eG - Pfandbriefe 2022/2030 ²⁾	EUR		3.911	4.517	606	% 92,516	3.618.319,53	3,44	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	15.315.256,20	14,54
Bankguthaben, nicht verbrieft								EUR	104.239.595,91	98,99
Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds										
EUR-Guthaben bei:								EUR	892.470,56	0,85

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

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
	Verwahrstelle		EUR	892.470,56			% 100,000	892.470,56	0,85
	Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	176.100,58	0,17
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	1.165,22				1.165,22	0,00
	Zinsansprüche		EUR	176.100,58				176.100,58	0,17
	Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-8.846,94	-0,01
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-8.846,94				-8.846,94	-0,01
	Fondsvermögen						EUR	105.299.320,11	100,00 ¹⁾
	Anteilwert						EUR	99,90	
	Umlaufende Anteile						STK	1.054.010,00	

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.

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:					
DE000BHY0H22	0,0100 % Berlin Hyp AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2026	EUR	1.075.000	985.104,95	
DE000CZ45V51	0,0100 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2020/2030	EUR	1.150.000	962.330,01	
XS2433126807	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027	EUR	4.500.000	4.038.200,10	
DE000MHB30J1	1,2500 % Münchener Hypothekenbank eG - Pfandbriefe 2022/2030	EUR	2.695.000	2.493.319,14	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				8.478.954,20	8.478.954,20

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Inland					
DE000AAR0249	0,1250 % Aareal Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2019/2024	EUR	505	3.545	
DE000CZ40NNO	0,1250 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2019/2024	EUR	673	4.726	
DE000CZ40MW3	0,2500 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2018/2023	EUR	673	4.726	
DE000A2YNNM8	0,0100 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2019/2025	EUR	500	3.500	
DE000A2LQNP8	0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Pfandbriefe 2019/2024	EUR	500	3.500	
DE000A289PH2	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2028	EUR	673	4.726	
DE000A1KRJT0	0,1250 % ING-DiBa AG - Hyp. Pfandbriefe 2019/2027	EUR	500	3.500	
DE000A1KRJR4	0,2500 % ING-DiBa AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2018/2023	EUR	600	4.700	
DE000LB2CQG8	0,0100 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2027	EUR	505	3.545	
DE000DHY5025	0,7500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2019/2029	EUR	505	3.545	
DE000HV2ASU1	0,0100 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2019/2027	EUR	673	4.726	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			92.520

(Basiswerte: 0,1250 % Aareal Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2030 (DE000AAR0314); 0,0100 % Berlin Hyp AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2026 (DE000BHY0H22); 0,2500 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2032 (DE000CZ45WY7); 0,5000 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2022/2027 (DE000CZ45W16); 0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Pfandbriefe 2019/2024 (DE000A2LQNP8); 1,0000 % Deutsche Pfandbriefbank AG - Pfandbriefe 2022/2026 (DE000A3T0YH5); 0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2029 (DE000A3H2TQ6); 0,7500 % DZ HYP AG - Pfandbriefe 2022/2029 (DE000A3MP619); 0,1250 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2029 (DE000LB2ZSM3); 1,7500 % Landesbank Baden-Württemberg - Pfandbriefe 2022/2028 (DE000LB2ZV93); 0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2025 (XS2106576494); 0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027 (XS2433126807); 0,1250 % Münchener Hypothekenbank eG - Medium Term

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Hyp. Pfandbriefe 2022/2029 (DE000MHB29J3); 1,2500 % Münchener Hypothekenbank eG - Pfandbriefe 2022/2030 (DE000MHB30J1); 0,6250 % NG-DiBa AG - Pfandbriefe 2022/2029 (DE000A2YNWA1); 0,0100 % UniCredit Bank AG - Pfandbriefe 2020/2028 (DE000HV2ATM6)

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified 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 ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		136.773,71	0,130
2. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		6.733,21	0,006
3. Sonstige Erträge		47,74	0,000
Summe der Erträge		143.554,66	0,136
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-49.881,63	-0,047
2. Sonstige Aufwendungen		-2.424,24	-0,002
davon: Negative Einlagezinsen	-2.424,24		-0,002
Summe der Aufwendungen		-52.305,87	-0,050
III. Ordentlicher Nettoertrag		91.248,79	0,087
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		2.291,88	0,002
2. Realisierte Verluste		-3.264.094,73	-3,097
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-3.261.802,85	-3,095
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-3.170.554,06	-3,008
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		0,00	0,000
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-6.747.128,16	-6,401
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-6.747.128,16	-6,401
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-9.917.682,22	-9,409

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023
	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	111.970.328,84
2. Zwischenausschüttungen	-20.880,20
3. Mittelzufluss (netto)	-31.620,30
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	3.507.236,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	17.984.852,00
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	-14.477.616,00
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-206.896,79
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	-9.917.682,22
	105.300.485,33

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

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **8.478.954,20**

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

Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten EUR **8.720.668,06**

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich) EUR **6.989,82**

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 6.989,82. 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 99,90
 Umlaufende Anteile STK 1.054.010,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) **98,99**
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 31.08.2022 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) 0,06

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von Währung -2.532,55 enthalten.

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

Verwendete Vermögensgegenstände

	absolut	8.478.954,20
	in % des Fondsvermögens	8,05

10 größte Gegenparteien

	Name	Clearstream Banking AG
	Bruttovolumen offene Geschäfte	8.478.954,20
	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	8.478.954,20

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified 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)	8.720.668,06
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	6.989,82
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.

8,13

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1. Name	Spanien, Königreich
		5.771.951,30
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2. Name	Italien, Republik
		331.602,83
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.
		290.393,74
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4. Name	Portugal, Republik
		282.014,17
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5. Name	Sociedad de Gestión de Activos Procedentes de la Reestructuración Bancaria
		135.608,99
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau
		108.951,42
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	7. Name	European Financial Stability Facility [EFSF]
		108.266,90
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	8. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
		103.617,82
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9. Name	BPCE SFH
		92.899,95
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	10. Name	HSBC SFH [France]
		89.941,33

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	8.720.668,06

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified 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

