

Halbjahresbericht
zum 31. August 2021.

**Deka iBoxx € Liquid
Corporates 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 2021

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2021 bis zum 31. August 2021.

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

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

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

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Abschnitt Anlagepolitik. Gerne nehmen wir die Gelegenheit zum Anlass, um Ihnen für das uns entgegengebrachte Vertrauen zu danken.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.deka-etf.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. August 2021	9
Vermögensaufstellung zum 31. August 2021	10
Anhang	15
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	18

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 Corporates Diversified UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Corporates 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 Corporates Diversified (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der 75 größten und umsatzstärksten europäischen Unternehmensanleihen 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 Corporates Diversified UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	0,9%	1,5%	2,2%

ISIN DE000ETFL375

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

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS2235996217	0.000000 % Novartis Finance S.A. EO-Notes 2020(20/28) 20280922
Löschung	XS2282093769	0.000000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(23) 20230711
Löschung	DE000A289DB1	0.101000 % BASF SE MTN v.2020(2020/2023) 20230604
Löschung	FR00140022B3	0.125000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2021(28) 20280217
Löschung	XS2176534282	0.250000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230518
Löschung	XS2177575177	0.375000 % E.ON SE Medium Term Notes v.20(23/23) 20230419
Löschung	XS1856791873	0.500000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(23) 20230716
Löschung	XS2113889351	0.500000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(27) 20270203
Löschung	XS1856833543	0.500000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2018(22) 20221115
Löschung	FR0013324332	0.500000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/23) 20230320
Löschung	XS2170384130	0.500000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(24) 20240510
Löschung	XS2171316859	0.625000 % Danske Bank AS EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250525
Löschung	XS2182404298	0.750000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2020(25) 20250603
Löschung	XS1789751531	1.000000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/26) 20260325
Löschung	XS2176783319	1.250000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(26) 20260517
Löschung	CH0409606354	1.250000 % UBS Group AG EO-FLR Notes 2018(24/25) 20250416
Löschung	FR0013324357	1.375000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/30) 20300320
Löschung	XS1840618059	1.500000 % Bayer Capital Corp. B.V. EO-Notes 2018(18/26) 20260625
Löschung	XS1789752182	1.500000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/30) 20300325
Löschung	XS2178832379	3.375000 % Fiat Chrysler Automobiles N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/23) 20230706
Löschung	XS2178833773	3.875000 % Fiat Chrysler Automobiles N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26) 20260104
Neuaufnahme	FR0014003Q41	0.000000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25) 20251130
Neuaufnahme	XS2350621863	0.000000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(26/26) 20260613
Neuaufnahme	XS2343821794	0.000000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(24) 20240718
Neuaufnahme	XS2326546434	0.010000 % UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2021(26) 20260330
Neuaufnahme	XS2322289385	0.125000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Preferred MTN 21(26/27) 20270323
Neuaufnahme	XS2355599197	0.125000 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260617
Neuaufnahme	FR00140022B3	0.125000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2021(28) 20280217
Neuaufnahme	XS2298304499	0.200000 % Banco Santander S.A. EO-Pref. Med-T. Nts 2021(28) 20280210
Neuaufnahme	XS2345982362	0.250000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260104
Neuaufnahme	XS2306517876	0.250000 % DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) 20290222
Neuaufnahme	FR0014004GE5	0.250000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2021(27) 20270707
Neuaufnahme	XS2343563214	0.300000 % Swedbank AB EO-Non-Pref. FLR MTN 21(26/27) 20270519
Neuaufnahme	XS2356049069	0.375000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280620
Neuaufnahme	XS2325733413	0.625000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) 20270329
Neuaufnahme	XS2199266003	0.750000 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/27) 20270105
Neuaufnahme	FR0013386539	0.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(23) 20230614
Neuaufnahme	XS2356040357	0.750000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290117
Neuaufnahme	XS1992927902	1.231000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(31) 20310507
Neuaufnahme	XS2301292400	1.500000 % Gaz Finance PLC EO-M.-T.LPN 21(27)Gazprom RegS 20270216
Neuaufnahme	DE000A2TSTG3	1.625000 % SAP SE Inh.-Schuld.v.2018(2030/2031) 20310309
Neuaufnahme	XS1962571011	1.875000 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(31) 20310314

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
FR0013398070	2.125000 %	BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) 20270122	2,33
XS2149270477	0.750000 %	UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2020(23/23) 20230420	1,95
XS2079723552	0.050000 %	DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231113	1,93
FR0013505633	2.750000 %	Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300401	1,72
XS1909186451	2.500000 %	ING Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(30) 20301114	1,72
FR0013482833	0.125000 %	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) 20280210	1,70
DE000A2R9ZT1	0.250000 %	Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231105	1,69
FR0013412947	0.750000 %	Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(26) 20260607	1,64
XS2148623106	3.500000 %	Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2020(25/26) 20260331	1,61
XS1948611840	1.500000 %	BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290205	1,59
DE000A289RN6	2.625000 %	Daimler AG Medium Term Notes v.20(25) 20250406	1,58
XS1958307461	1.750000 %	Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 20290304	1,57
XS2153406868	1.491000 %	Total Capital Intl S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270407	1,55
XS1960678255	1.125000 %	Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/27) 20270306	1,52
FR0013386539	0.750000 %	Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(23) 20230614	1,51
XS2168647357	1.375000 %	Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26) 20260104	1,51
XS2199266268	1.125000 %	Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/30) 20300105	1,49
FR0013506508	0.750000 %	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) 20250406	1,48
FR0013508512	1.000000 %	Crédit Agricole S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(25/26) 20260421	1,48
XS1935139995	0.875000 %	ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24) 20240114	1,48
FR0013463668	0.375000 %	EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20271126	1,47
FR0013509726	0.625000 %	BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250427	1,47
XS2199266003	0.750000 %	Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/27) 20270105	1,47
XS2171210862	0.375000 %	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25) 20250511	1,47
XS1948612905	0.625000 %	BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231005	1,46
FR0013463650	0.125000 %	EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/25) 20250526	1,45
FR0013476199	0.250000 %	BPCE S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(26) 20260114	1,45
XS1960678099	0.375000 %	Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/23) 20230306	1,45
XS2345982362	0.250000 %	Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260104	1,44
XS2326546434	0.010000 %	UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2021(26) 20260330	1,44
XS2281155254	0.250000 %	ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(29/30) 20300131	1,41
FR0013422011	1.375000 %	BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 20290527	1,38
FR0013396520	2.000000 %	Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) 20290114	1,36
DE000A2TSTG3	1.625000 %	SAP SE Inh.-Schuld.v.2018(2030/2031) 20310309	1,35
XS2185867913	1.625000 %	Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300608	1,31
XS2177441990	1.201000 %	Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270820	1,27
XS2185867830	1.375000 %	Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260608	1,27
BE6312821612	1.125000 %	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270630	1,27
XS2156510021	1.000000 %	Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250414	1,25
DE000CZ40NS9	1.000000 %	Commerzbank AG MTN-IHS S.923 v.19(26) 20260303	1,25
XS2234567233	0.875000 %	Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2020(28) 20280921	1,24
XS1917601582	1.500000 %	HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/24) 20241203	1,24
FR0013396512	1.125000 %	Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24) 20240714	1,24
XS2171874519	0.500000 %	Nordea Bank Abp EO-Preferred Med.-T.Nts 20(27) 20270513	1,24
XS2002491517	1.000000 %	NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240527	1,23
XS2024715794	0.500000 %	Deutsche Telekom AG MTN v.2019(2027) 20270704	1,23

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS1956955980	0.625000	% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240226	1,22
XS2050404800	0.450000	% DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/28) 20280317	1,21
DE000CZ40M21	0.500000	% Commerzbank AG MTN-IHS S.903 v.18(23) 20230827	1,21
XS2325733413	0.625000	% Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) 20270329	1,21
XS2050404636	0.200000	% DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/26) 20260317	1,21
FR0013367638	1.750000	% VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/30) 20300925	1,21
XS2350621863	0.000000	% Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(26/26) 20260613	1,21
FR0013486701	0.125000	% Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26) 20260223	1,21
XS2118276539	0.000000	% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230219	1,20
XS2356040357	0.750000	% Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290117	1,20
XS2298304499	0.200000	% Banco Santander S.A. EO-Pref. Med-T. Nts 2021(28) 20280210	1,20
XS2355599197	0.125000	% NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260617	1,20
FR0013444304	0.100000	% HSBC France S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(27) 20270902	1,20
XS2343821794	0.000000	% Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(24) 20240718	1,20
XS1962571011	1.875000	% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(31) 20310314	1,15
XS1992927902	1.231000	% BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(31) 20310507	1,11
XS1992931508	0.831000	% BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(27) 20271107	1,09
XS2182054887	0.375000	% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(26) 20260604	0,98
DE000A289DC9	0.250000	% BASF SE MTN v.2020(2020/2027) 20270604	0,98
XS2207657417	0.250000	% Nationwide Building Society EO-Preferred MTN 2020(25) 20250721	0,97
XS2197342129	0.125000	% OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(24) 20240630	0,97
FR0014003Q41	0.000000	% Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25) 20251130	0,96
XS2356049069	0.375000	% Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2021(28) 20280620	0,96
XS2343563214	0.300000	% Swedbank AB EO-Non-Pref. FLR MTN 21(26/27) 20270519	0,96
FR0014004GE5	0.250000	% Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2021(27) 20270707	0,96
XS2258389415	0.100000	% OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(27) 20271115	0,96
XS2322289385	0.125000	% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Preferred MTN 21(26/27) 20270323	0,96
XS2301292400	1.500000	% Gaz Finance PLC EO-M.-T.LPN 21(27)Gazprom RegS 20270216	0,95
XS2306517876	0.250000	% DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) 20290222	0,95

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		341.233.765,58	100,02
1. Anleihen		336.035.717,23	98,49
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	66.442.480,69		19,47
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	103.360.148,45		30,30
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	93.117.777,78		27,29
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	73.115.310,31		21,43
2. Forderungen		1.431.082,29	0,42
3. Bankguthaben		3.766.966,06	1,10
II. Verbindlichkeiten		-61.311,27	-0,02
III. Fondsvermögen		341.172.454,31	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified 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									
DE000A289DC9	0,2500 % BASF SE - Anleihe 2020/2027		EUR	3.200	1.000	600	% 102,456	3.278.598,40	0,96
XS2199266003	0,7500 % Bayer AG - Anleihe 2020/2027		EUR	4.800	4.800	0	% 102,413	4.915.802,40	1,44
XS2199266268	1,1250 % Bayer AG - Anleihe 2020/2030		EUR	4.800	1.400	800	% 103,641	4.974.780,00	1,46
DE000CZ40M21	0,5000 % Commerzbank AG - Medium Term Notes 2018/2023		EUR	4.030	1.145	617	% 101,411	4.086.879,02	1,20
DE000CZ40NS9	1,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2019/2026		EUR	4.030	1.145	617	% 104,342	4.204.978,57	1,23
DE000A289RN6	2,6250 % Daimler AG - Anleihe 2020/2025		EUR	4.836	1.373	739	% 109,948	5.317.108,49	1,56
XS2024715794	0,5000 % Deutsche Telekom AG - Medium Term Notes 2019/2027		EUR	4.030	1.145	617	% 102,994	4.150.663,04	1,22
XS2171210862	0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Anleihe 2020/2025		EUR	4.800	1.400	800	% 102,190	4.905.132,96	1,44
XS2343821794	0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2021/2024		EUR	4.030	4.030	0	% 100,044	4.031.783,28	1,18
							EUR	39.865.726,16	11,68
Ausland									
XS1935139995	0,8750 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	4.836	1.454	820	% 102,823	4.972.522,21	1,46
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2030		EUR	4.800	1.400	800	% 120,089	5.764.263,36	1,69
XS2185867830	1,3750 % Airbus SE - Anleihe 2020/2026		EUR	4.030	1.153	625	% 106,335	4.285.290,43	1,26
XS2185867913	1,6250 % Airbus SE - Anleihe 2020/2030		EUR	4.030	1.153	625	% 109,859	4.427.307,63	1,30
BE6312821612	1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2019/2027		EUR	4.030	1.153	625	% 106,088	4.275.350,43	1,25
XS2322289385	0,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Floating Rate Medium Term 2021/2027		EUR	3.200	3.700	500	% 100,220	3.207.031,36	0,94
XS2298304499	0,2000 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	4.000	4.600	600	% 100,188	4.007.500,00	1,17
XS2168647357	1,3750 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	4.800	1.400	800	% 105,270	5.052.944,16	1,48
FR0013386539	0,7500 % Banque Fédérative du Crédit Mutuel - Anleihe 2019/2023		EUR	5.000	5.000	0	% 102,050	5.102.500,00	1,50
XS1948612905	0,6250 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2023		EUR	4.836	1.373	739	% 101,954	4.930.495,44	1,45
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029 ²⁾		EUR	4.836	1.373	739	% 110,715	5.354.163,38	1,57
FR0013422011	1,3750 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2019/2029		EUR	4.400	1.200	600	% 107,022	4.708.967,12	1,38
FR0013398070	2,1250 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2019/2027		EUR	7.300	2.000	1.000	% 108,087	7.890.345,16	2,31
XS1992931508	0,8310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2027		EUR	3.546	960	496	% 103,769	3.679.658,67	1,08
XS1992927902	1,2310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2031 ²⁾		EUR	3.546	3.546	0	% 105,827	3.752.627,19	1,10
FR0013476199	0,2500 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	4.800	1.400	800	% 101,321	4.863.395,52	1,43
FR0013509726	0,6250 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2025		EUR	4.800	1.400	800	% 102,634	4.926.420,00	1,44
FR0013412947	0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2019/2026		EUR	5.300	1.800	800	% 103,661	5.494.023,46	1,61
XS1962571011	1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. - Medium Term Notes 2019/2031 ²⁾		EUR	3.400	3.700	300	% 114,945	3.908.143,94	1,15
XS1956955980	0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	4.000	1.200	700	% 102,131	4.085.249,60	1,20
XS1958307461	1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2019/2029		EUR	4.800	1.400	800	% 109,722	5.266.637,76	1,54
FR0013508512	1,0000 % Crédit Agricole S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	4.800	1.400	800	% 103,311	4.958.937,60	1,45
XS2345982362	0,2500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	4.836	4.836	0	% 100,633	4.866.632,67	1,43
DE000A2R9ZT1	0,2500 % Daimler Intl Finance B.V. - Anleihe 2019/2023		EUR	5.641	1.602	864	% 100,924	5.693.104,22	1,67
FR0014003Q41	0,0000 % Danone S.A. - Medium Term Notes 2021/2025		EUR	3.200	3.200	0	% 100,841	3.226.914,56	0,95
XS2050404636	0,2000 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Anleihe 2019/2026		EUR	4.030	1.153	625	% 101,010	4.070.686,88	1,19
XS2050404800	0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Anleihe 2019/2028		EUR	4.030	1.153	625	% 101,547	4.092.340,88	1,20
XS2079723552	0,0500 % DNB Bank ASA - Anleihe 2019/2023		EUR	6.447	1.892	1.048	% 100,918	6.506.199,58	1,91
XS2306517876	0,2500 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2021/2029		EUR	3.224	3.564	340	% 99,465	3.206.735,48	0,94

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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
FR0013463650	0,1250 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2025		EUR	4.800	1.400	800	% 101,337	4.864.190,40	1,43
FR0013463668	0,3750 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2027		EUR	4.800	1.400	800	% 102,699	4.929.561,60	1,44
XS2301292400	1,5000 % Gaz Finance PLC - Loan Particip.Certific. 2021/2027		EUR	3.224	3.564	340	% 99,813	3.217.955,00	0,94
FR0013444304	0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. - Anleihe 2019/2027		EUR	4.000	1.200	700	% 100,054	4.002.152,00	1,17
XS1917601582	1,5000 % HSBC Holdings PLC - Floating Rate Medium Term 2018/2024		EUR	4.030	1.153	625	% 103,713	4.179.621,81	1,23
XS2281155254	0,2500 % ING Groep N.V. - Floating Rate Medium Term 2021/2030		EUR	4.800	1.400	800	% 98,279	4.717.376,16	1,38
XS1909186451	2,5000 % ING Groep N.V. - Medium Term Notes 2018/2030 ²⁾		EUR	4.800	1.400	800	% 119,823	5.751.514,08	1,69
XS2148623106	3,5000 % Lloyds Banking Group PLC - Anleihe 2020/2026		EUR	4.836	1.454	820	% 112,412	5.436.258,83	1,59
FR0013482833	0,1250 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2028		EUR	5.600	1.500	800	% 101,613	5.690.343,68	1,67
FR0013506508	0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2025		EUR	4.800	1.400	800	% 103,398	4.963.108,80	1,45
XS1960678099	0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2023		EUR	4.836	1.454	820	% 101,089	4.888.659,20	1,43
XS1960678255	1,1250 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2027		EUR	4.836	1.454	820	% 105,949	5.123.708,63	1,50
XS2207657417	0,2500 % Nationwide Building Society - Anleihe 2020/2025		EUR	3.224	910	488	% 101,369	3.268.134,30	0,96
XS2355599197	0,1250 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	4.030	4.030	0	% 100,101	4.034.083,60	1,18
XS2002491517	1,0000 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	4.030	1.153	625	% 103,217	4.159.662,83	1,22
XS2350621863	0,0000 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	4.030	4.030	0	% 100,824	4.063.207,20	1,19
XS2171874519	0,5000 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2020/2027		EUR	4.030	1.153	625	% 103,282	4.162.277,90	1,22
XS2258389415	0,1000 % OP Yrityspankki Oyj - Medium Term Notes 2020/2027		EUR	3.224	910	488	% 100,454	3.238.636,96	0,95
XS2197342129	0,1250 % OP Yrityspankki Oyj - Anleihe 2020/2024		EUR	3.224	910	488	% 101,115	3.259.958,24	0,96
FR0013396512	1,1250 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	4.000	1.200	700	% 103,601	4.144.050,80	1,21
FR0013396520	2,0000 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2029		EUR	4.000	1.200	700	% 113,641	4.545.648,80	1,33
DE000A2TSTG3	1,6250 % SAP SE - Inh. Schuldverschreibung 2018/2031 ²⁾		EUR	4.000	4.600	600	% 112,998	4.519.936,00	1,32
XS2118276539	0,0000 % Siemens Finan.maatschappij NV - Anleihe 2020/2023		EUR	4.000	1.200	700	% 100,593	4.023.700,00	1,18
XS2182054887	0,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2020/2026 ²⁾		EUR	3.200	1.000	600	% 102,677	3.285.660,80	0,96
XS2356049069	0,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	3.224	3.224	0	% 100,787	3.249.372,88	0,95
FR0013486701	0,1250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	4.000	1.200	700	% 100,774	4.030.973,20	1,18
FR0014004GE5	0,2500 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2021/2027		EUR	3.200	3.200	0	% 100,601	3.219.225,60	0,94
XS2325733413	0,6250 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2027		EUR	4.030	4.455	425	% 101,365	4.084.993,38	1,20
XS2356040357	0,7500 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	4.030	4.030	0	% 100,406	4.046.356,96	1,19
XS2156510021	1,0000 % Svenska Handelsbanken AB - Anleihe 2020/2025		EUR	4.030	1.153	625	% 104,530	4.212.548,93	1,23
XS2343563214	0,3000 % Swedbank AB - Floating Rate Medium Term 2021/2021		EUR	3.224	3.224	0	% 100,672	3.245.650,77	0,95
XS2177441990	1,2010 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2020/2027		EUR	4.000	1.200	700	% 106,390	4.255.601,20	1,25
XS2153406868	1,4910 % Total Capital Intl S.A. - Anleihe 2020/2027		EUR	4.800	1.400	800	% 108,354	5.201.007,84	1,52
XS2326546434	0,0100 % UBS AG (London Branch) - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	4.836	5.359	523	% 100,287	4.849.895,28	1,42
XS2149270477	0,7500 % UBS AG (London Branch) - Anleihe 2020/2023		EUR	6.447	1.820	976	% 101,717	6.557.716,27	1,92
FR0013367638	1,7500 % VINCI S.A. - Medium Term Notes 2018/2030		EUR	3.500	1.000	600	% 114,698	4.014.432,45	1,18
XS2234567233	0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028 ²⁾		EUR	4.000	1.200	700	% 103,911	4.156.420,00	1,22
Summe Wertpapiervermögen							EUR EUR	296.169.991,07 336.035.717,23	86,81 98,49

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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
	Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	3.766.966,06	1,10
	EUR-Guthaben bei: Verwahrstelle	EUR		3.766.966,06			% 100,000	3.766.966,06	1,10
	Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	1.431.082,29	0,42
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen	EUR		121.253,58				121.253,58	0,04
	Zinsansprüche	EUR		1.309.828,71				1.309.828,71	0,38
	Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-61.311,27	-0,02
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR		-61.311,27				-61.311,27	-0,02
	Fondsvermögen						EUR	341.172.454,31	100,00 ¹⁾
	Anteilwert						EUR	114,47	
	Umlaufende Anteile	STK						2.980.331,00	

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:					
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	3.975.000	4.400.909,72	
XS1992927902	1,2310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2031	EUR	2.200.000	2.328.195,10	
XS1962571011	1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. - Medium Term Notes 2019/2031	EUR	2.000.000	2.298.908,20	
XS1909186451	2,5000 % ING Groep N.V. - Medium Term Notes 2018/2030	EUR	1.100.000	1.318.055,31	
DE000A2TSTG3	1,6250 % SAP SE - Inh. Schuldverschreibung 2018/2031	EUR	3.600.000	4.067.942,40	
XS2182054887	0,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2020/2026	EUR	300.000	308.030,70	
XS2234567233	0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028	EUR	400.000	415.642,00	
	Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen			15.137.683,43	15.137.683,43

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 (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					
DE000A289DB1	0,1010 % BASF SE - Anleihe 2020/2023	EUR	700	3.500	
XS2177575177	0,3750 % E.ON SE - Anleihe 2020/2023	EUR	701	3.503	
XS2282093769	0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2021/2023	EUR	701	3.503	
Ausland					
XS1856791873	0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2018/2023	EUR	932	4.434	
XS2182404298	0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Anleihe 2020/2025	EUR	700	3.500	
XS2113889351	0,5000 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2027	EUR	400	3.900	
XS1840618059	1,5000 % Bayer Capital Corp. B.V. - Guaranteed Registered Notes 2018/2026	EUR	1.100	6.000	
XS1856833543	0,5000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2018/2022	EUR	1.100	6.000	
XS2171316859	0,6250 % Danske Bank A/S - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	331	3.133	
XS2176783319	1,2500 % ENI S.p.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	733	3.535	
XS2235996217	0,0000 % Novartis Finance S.A. - Anleihe 2020/2028	EUR	1.218	6.401	
XS1789751531	1,0000 % Richemont Intl Holding S.A. - EO-Notes 2018/2026	EUR	477	4.679	
XS1789752182	1,5000 % Richemont International Holding S.A. - Anleihe 2018/2030	EUR	439	3.941	
FR0013324332	0,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2023	EUR	500	5.400	
FR0013324357	1,3750 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2030	EUR	600	6.200	
XS2170384130	0,5000 % Shell International Finance BV - Anleihe 2020/2024	EUR	331	3.133	
XS2176534282	0,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken - Anleihe 2020/2023	EUR	1.000	3.717	
FR00140022B3	0,1250 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	3.400	3.400	
XS2178832379	3,3750 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2020/2023	EUR	439	3.941	
XS2178833773	3,8750 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2020/2026	EUR	917	4.419	
CH0409606354	1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG - GFL 2018/2025	EUR	655	5.558	

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
	Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes): unbefristet	EUR			173.461

(Basiswerte: 1,3750 % Airbus SE - Anleihe 2020/2026 (XS2185867830); 1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2019/2027 (BE6312821612); 0,2000 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2021/2028 (XS2298304499); 0,5000 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2027 (XS2113889351); 0,1010 % BASF SE - Anleihe 2020/2023 (DE000A289DB1); 0,2500 % BASF SE - Anleihe 2020/2027 (DE000A289DC9); 1,1250 % Bayer AG - Anleihe 2020/2030 (XS2199266268); 1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029 (XS1948611840); 0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2019/2026 (FR0013412947); 0,5000 % Commerzbank AG - Medium Term Notes 2018/2023 (DE000CZ40M21); 1,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2019/2026 (DE000CZ40NS9); 1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. - Medium Term Notes 2019/2031 (XS1962571011); 2,6250 % Daimler AG - Anleihe 2020/2025 (DE000A289RN6); 0,6250 % Danske Bank A/S - Medium Term Notes 2020/2025 (XS2171316859); 1,2500 % ENI S.p.A. - Anleihe 2020/2026 (XS2176783319); 0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. - Anleihe 2019/2027 (FR0013444304); 3,5000 % Lloyds Banking Group PLC - Anleihe 2020/2026 (XS2148623106); 0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2025 (FR0013506508); 1,1250 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2027 (XS1960678255); 0,2500 % Nationwide Building Society - Anleihe 2020/2025 (XS2207657417); 2,0000 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2029 (FR0013396520); 1,3750 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2030 (FR0013324357); 0,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2020/2026 (XS2182054887); 0,1250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2020/2026 (FR0013486701); 0,1250 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2021/2028 (FR00140022B3); 0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Anleihe 2020/2025 (XS2182404298); 2,5000 % ING Groep N.V. - Medium Term Notes 2018/2030 (XS1909186451); 0,6250 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2027 (XS2325733413); 0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028 (XS2234567233))

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		168.481,02	0,057
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		1.279.680,81	0,429
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		11.693,70	0,004
Summe der Erträge		1.459.855,53	0,490
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-330.964,93	-0,111
2. Sonstige Aufwendungen davon: Verwahrtgelt	-6.173,81	-6.173,81	-0,002
Summe der Aufwendungen		-337.138,74	-0,113
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.122.716,79	0,377
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.062.022,18	0,356
2. Realisierte Verluste		-387.736,99	-0,130
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		674.285,19	0,226
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.797.001,98	0,603
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		541.714,65	0,182
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		506.759,90	0,170
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.048.474,55	0,352
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.845.476,53	0,955

Entwicklung des Sondervermögens

	2021 / 2022
	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	303.675.261,26
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-464.052,96
2. Zwischenausschüttungen	-641.776,13
3. Mittelzufluss (netto)	35.808.531,25
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	88.298.894,25
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-52.490.363,00
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-50.985,64
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	2.845.476,53
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	541.714,65
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	506.759,90
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	341.172.454,31

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

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 15.137.683,43

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

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten	EUR		15.458.150,64

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich) EUR 11.663,45

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 11.663,45. 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	114,47
Umlaufende Anteile	STK	2.980.331,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,49
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2021 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2021 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert) 0,07

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

Angaben zu den sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -6.144,30.

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

Verwendete Vermögensgegenstände		
	absolut	15.137.683,43
	in % des Fondsvermögens	4,44

10 größte Gegenparteien

	Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte		15.137.683,43
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	15.137.683,43

Deka iBoxx € Liquid Corporates 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)	15.458.150,64
	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	11.663,45
	in % der Bruttoerträge	100,00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	absolut	0,00
	in % der Bruttoerträge	0,00

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (absoluter Betrag)

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

4,50

Die hier angegebene Prozentzahl bezieht sich auf das gesamte Wertpapiervermögen des Fonds einschließlich / ausschließlich Anteilen an Zielfonds/ Geldmarktfonds. Die Anlagebedingungen können jedoch Beschränkungen enthalten, so dass das Verleihen ggf. nur in geringerem Umfang zulässig ist.

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Bankia S.A.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.285.050,50
2. Name	Bremen, Freie Hansestadt
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	823.610,97
3. Name	Italien, Republik
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	690.103,92
4. Name	NRW.BANK
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	456.056,72
5. Name	BPCE S.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	434.439,39
6. Name	BNP Paribas S.A.
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	394.016,53
7. Name	Agence Française de Développement
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	364.899,04
8. Name	Porsche Automobil Holding SE
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	346.861,35
9. Name	Landwirtschaftliche Rentenbank
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	345.282,83
10. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	322.475,68

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	15.458.150,64

Deka iBoxx € Liquid Corporates 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 2021
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

17. Mai 1995; die Gesellschaft übernahm das Investmentgeschäft der am 17. August 1956 gegründeten Deka Deutsche Kapitalanlagegesellschaft mbH.

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2020

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH, Köln
und der Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Thomas Schneider
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A., Luxemburg;
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Square
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. August 2021

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39
www.deka-etf.de