

Halbjahresbericht
zum 31. August 2021.

**Deka iBoxx € Liquid
Non-Financials 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 Non-Financials 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	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2021	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 beigefügt sind, erfolgen.

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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 Markt iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet die Wertentwicklung der 40 größten und umsatzstärksten europäischen Unternehmensanleihen ohne Finanztitel 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 Non-Financials Diversified UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	1,5%	2,7%	3,0%

ISIN DE000ETFL383

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

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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	XS2325733413	0.625000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) 20270329
Löschung	XS1992931508	0.831000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(27) 20271107
Löschung	XS1956028168	0.875000 % Fortum Oyj EO-Medium-Term Nts 2019(19/23) 20230226
Löschung	XS2234567233	0.875000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2020(28) 20280921
Löschung	XS1789751531	1.000000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/26) 20260325
Löschung	FR0013507654	1.125000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2020(20/28) 20280723
Löschung	XS2176783319	1.250000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(26) 20260517
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	XS1937665955	1.500000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/25) 20250720
Löschung	XS2148390755	1.500000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(30/30) 20300331
Löschung	XS1967635977	2.375000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270926
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	XS2325733413	0.625000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) 20270329
Neuaufnahme	XS2356040357	0.750000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290117
Neuaufnahme	DE000A3KNP96	0.750000 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(28/29) 20290323
Neuaufnahme	XS2344385815	0.875000 % Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260524
Neuaufnahme	XS2199266268	1.125000 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/30) 20300105
Neuaufnahme	XS1992927902	1.231000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(31) 20310507
Neuaufnahme	FR0013505112	1.500000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300331
Neuaufnahme	DE000A2TSTG3	1.625000 % SAP SE Inh.-Schuldv.v.2018(2030/2031) 20310309
Neuaufnahme	XS1962571011	1.875000 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(31) 20310314
Neuaufnahme	XS2176785447	2.000000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(31) 20310517
Neuaufnahme	XS1967636199	3.000000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/31) 20310326

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
FR0013505633	2.750000	% Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300401	3,56
FR0013482833	0.125000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) 20280210	3,52
DE000A2R9ZT1	0.250000	% Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231105	3,49
XS1948611840	1.500000	% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290205	3,28
XS2153406868	1.491000	% Total Capital Intl S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270407	3,21
XS2199266268	1.125000	% Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/30) 20300105	3,07
FR0013463668	0.375000	% EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20271126	3,05
FR0013396520	2.000000	% Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) 20290114	2,81
DE000A2TSTG3	1.625000	% SAP SE Inh.-Schuld.v.2018(2030/2031) 20310309	2,79
XS2185867913	1.625000	% Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300608	2,71
XS2177441990	1.201000	% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270820	2,63
BE6312821612	1.125000	% Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270630	2,62
XS2024715794	0.500000	% Deutsche Telekom AG MTN v.2019(2027) 20270704	2,54
DE000A3KNP96	0.750000	% TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(28/29) 20290323	2,52
FR0013367638	1.750000	% VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/30) 20300925	2,49
XS2350621863	0.000000	% Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(26/26) 20260613	2,49
XS2118276539	0.000000	% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230219	2,49
XS2356040357	0.750000	% Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290117	2,48
XS2343821794	0.000000	% Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(24) 20240718	2,47
XS2344385815	0.875000	% Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260524	2,41
XS1962571011	1.875000	% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(31) 20310314	2,37
XS1967636199	3.000000	% Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/31) 20310326	2,34
FR0013444551	0.375000	% Dassault Systemes SE EO-Notes 2019(19/29) 20290915	2,33
XS1992927902	1.231000	% BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(31) 20310507	2,30
FR0013505260	2.625000	% Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20271214	2,28
XS2176785447	2.000000	% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(31) 20310517	2,25
FR0013506532	1.750000	% Pernod-Ricard S.A. EO-Bonds 2020(20/30) 20300407	2,25
FR0013507860	2.000000	% Capgemini SE EO-Notes 2020(20/29) 20290414	2,24
FR0013505112	1.500000	% Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300331	2,22
FR0013510179	2.875000	% Auchan Holding S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/26) 20260128	2,19
XS2002018500	1.625000	% Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2019(30) 20301123	2,18
XS2001737910	1.125000	% Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) 20290530	2,12
XS2156506854	1.250000	% Naturgy Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260114	2,08
FR0013504644	1.375000	% Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20250326	2,08
XS2054210252	1.332000	% Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/28) 20280924	2,06
DE000A289DC9	0.250000	% BASF SE MTN v.2020(2020/2027) 20270604	2,03
FR0013447604	0.375000	% La Poste EO-Medium-Term Notes 2019(27) 20270916	2,02
XS2170384130	0.500000	% Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(24) 20240510	2,02
XS2177575177	0.375000	% E.ON SE Medium Term Notes v.20(23/23) 20230419	2,00
FR0014003Q41	0.000000	% Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25) 20251130	1,99

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2021.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		343.951.682,52	100,02
1. Anleihen		339.548.865,72	98,74
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	42.339.218,33		12,31
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	44.920.310,87		13,06
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	81.122.062,14		23,59
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	171.167.274,38		49,77
2. Forderungen		1.765.036,11	0,51
3. Bankguthaben		2.637.780,69	0,77
II. Verbindlichkeiten		-62.160,02	-0,02
III. Fondsvermögen		343.889.522,50	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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	6.700	1.400	400	% 102,456	6.864.565,40	2,00
XS2199266268	1,1250 % Bayer AG - Anleihe 2020/2030		EUR	10.100	10.100	0	% 103,641	10.467.766,25	3,04
XS2024715794	0,5000 % Deutsche Telekom AG - Medium Term Notes 2019/2027		EUR	8.386	1.737	480	% 102,994	8.637.086,90	2,51
XS2177575177	0,3750 % E.ON SE - Anleihe 2020/2023		EUR	6.709	1.391	385	% 101,056	6.779.824,90	1,97
XS2343821794	0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2021/2024		EUR	8.386	8.386	0	% 100,044	8.389.710,81	2,44
							EUR	41.138.954,26	11,96
Ausland									
XS1967636199	3,0000 % Abertis Infraestructuras S.A. - Medium Term Notes 2019/2031		EUR	6.700	7.100	400	% 118,135	7.915.077,83	2,30
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2030		EUR	10.100	2.000	500	% 120,089	12.128.970,82	3,53
XS2185867913	1,6250 % Airbus SE - Anleihe 2020/2030		EUR	8.386	1.788	484	% 109,859	9.212.754,78	2,68
BE6312821612	1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2019/2027		EUR	8.386	1.788	484	% 106,088	8.896.548,07	2,59
FR0013510179	2,8750 % Auchan Holding S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	6.700	1.400	400	% 110,906	7.430.695,30	2,16
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029 ²⁾		EUR	10.063	2.086	577	% 110,715	11.141.221,27	3,24
XS1992927902	1,2310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2031		EUR	7.382	7.382	0	% 105,827	7.812.152,83	2,27
FR0013507860	2,0000 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2029		EUR	6.700	1.400	400	% 113,546	7.607.608,80	2,21
FR0013505260	2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027 ²⁾		EUR	6.700	1.400	400	% 115,332	7.727.244,00	2,25
XS1962571011	1,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. - Medium Term Notes 2019/2031		EUR	7.000	7.400	400	% 114,945	8.046.178,70	2,34
DE000A2R9ZT1	0,2500 % Daimler Intl Finance B.V. - Anleihe 2019/2023		EUR	11.740	2.433	673	% 100,924	11.848.438,86	3,45
FR0014003Q41	0,0000 % Danone S.A. - Medium Term Notes 2021/2025		EUR	6.700	6.700	0	% 100,841	6.756.352,36	1,96
FR0013444551	0,3750 % Dassault Systemes SE - Anleihe 2019/2029		EUR	7.700	1.500	400	% 102,522	7.894.224,80	2,30
FR0013504644	1,3750 % Engie S.A. - Anleihe 2020/2025		EUR	6.700	1.400	400	% 105,106	7.042.073,19	2,05
XS2176785447	2,0000 % ENI S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2031		EUR	6.720	6.720	0	% 114,037	7.663.264,22	2,23
FR0013463668	0,3750 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2027		EUR	10.100	2.000	500	% 102,699	10.372.619,20	3,02
FR0013447604	0,3750 % La Poste - Anleihe 2019/2027		EUR	6.700	1.400	400	% 102,309	6.854.694,96	1,99
FR0013482833	0,1250 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2028		EUR	11.700	2.500	800	% 101,613	11.888.753,76	3,46
XS2156506854	1,2500 % Naturgy Finance B.V. - Anleihe 2020/2026		EUR	6.700	1.400	400	% 105,472	7.066.607,25	2,05
XS2350621863	0,0000 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	8.386	8.386	0	% 100,824	8.455.100,64	2,46
FR0013396520	2,0000 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2029		EUR	8.400	1.700	400	% 113,641	9.545.862,48	2,78
FR0013506532	1,7500 % Pernod-Ricard S.A. - Anleihe 2020/2030		EUR	6.700	1.400	400	% 113,673	7.616.076,26	2,21
XS2344385815	0,8750 % Ryanair DAC - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	8.050	8.050	0	% 101,484	8.169.482,13	2,38
FR0013505112	1,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2020/2030 ²⁾		EUR	6.700	7.100	400	% 112,126	7.512.458,75	2,18
DE000A2TSTG3	1,6250 % SAP SE - Inh. Schuldverschreibung 2018/2031		EUR	8.400	8.800	400	% 112,998	9.491.865,60	2,76
XS2170384130	0,5000 % Shell International Finance BV - Anleihe 2020/2024		EUR	6.727	1.449	420	% 102,148	6.871.473,76	2,00
XS2118276539	0,0000 % Siemens Finan.maatschappij NV - Anleihe 2020/2023		EUR	8.400	1.700	400	% 100,593	8.449.770,00	2,46
XS2356040357	0,7500 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	8.386	8.386	0	% 100,406	8.420.037,10	2,45
XS2177441990	1,2010 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2020/2027		EUR	8.400	1.700	400	% 106,390	8.936.762,52	2,60
XS2001737910	1,1250 % Telenor ASA - Medium Term Notes 2019/2029		EUR	6.727	1.487	420	% 107,345	7.221.081,33	2,10
XS2153406868	1,4910 % Total Capital Intl S.A. - Anleihe 2020/2027		EUR	10.100	2.000	500	% 108,354	10.943.787,33	3,18
DE000A3KNP96	0,7500 % TRATON Finance Luxembourg S.A. - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	8.400	8.800	400	% 102,086	8.575.203,84	2,49
FR0013367638	1,7500 % VINCI S.A. - Medium Term Notes 2018/2030		EUR	7.400	1.600	500	% 114,698	8.487.657,18	2,47

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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
XS2002018500	1,6250 % Vodafone Group PLC - Medium Term Notes 2019/2030		EUR	6.727	1.475	408	% 110,146	7.409.543,62	2,15
XS2054210252	1,3320 % Wintershall Dea Finance B.V. - Anleihe 2019/2028		EUR	6.700	1.400	400	% 104,452	6.998.267,92	2,04
Summe Wertpapiervermögen								EUR 298.409.911,46	86,77
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR 339.548.865,72	98,74
EUR-Guthaben bei: Verwahrstelle								EUR 2.637.780,69	0,77
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 1.765.036,11	0,51
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen								EUR 618,72	0,00
Zinsansprüche								EUR 1.764.417,39	0,51
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -62.160,02	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung								EUR -62.160,02	-0,02
Fondsvermögen								EUR 343.889.522,50	100,00 ¹⁾
Anteilwert								EUR 114,09	
Umlaufende Anteile								STK 3.014.308,00	

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 befristet	unbefristet	gesamt
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 300.000		332.144,13	
FR0013505260	2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027	EUR 200.000		230.664,00	
FR0013505112	1,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2020/2030	EUR 100.000		112.126,25	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				674.934,38	674.934,38

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					
Ausland					
XS1967635977	2,3750 % Abertis Infraestructuras S.A. - Medium Term Notes 2019/2027	EUR	600	6.300	
XS1840618059	1,5000 % Bayer Capital Corp. B.V. - Guaranteed Registered Notes 2018/2026	EUR	2.200	12.200	
FR0013507654	1,1250 % Bouygues S.A. - Anleihe 2020/2028	EUR	600	6.300	
XS1992931508	0,8310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2027	EUR	1.395	7.621	
XS1937665955	1,5000 % ENEL Finance Intl N.V. - Anleihe 2019/2025	EUR	657	6.317	
XS2176783319	1,2500 % ENI S.p.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	1.249	6.947	
XS1956028168	0,8750 % Fortum Oyj - Medium Term Notes 2019/2023	EUR	1.287	6.947	
XS2148390755	1,5000 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Anleihe 2020/2030	EUR	1.209	6.912	
XS2235996217	0,0000 % Novartis Finance S.A. - Anleihe 2020/2028	EUR	2.257	12.787	
XS1789751531	1,0000 % Richemont Intl Holding S.A. - EO-Notes 2018/2026	EUR	957	9.476	
FR0013324357	1,3750 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2030	EUR	1.100	11.700	
XS2325733413	0,6250 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2027	EUR	8.643	8.643	
XS2178833773	3,8750 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2020/2026	EUR	815	7.897	
XS2234567233	0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028	EUR	1.500	8.600	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet					
EUR					174.311

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

(Basiswerte: 0,2500 % BASF SE - Anleihe 2020/2027 (DE000A289DC9); 2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027 (FR0013505260); 0,3750 % Dassault Systemes SE - Anleihe 2019/2029 (FR0013444551); 1,2500 % ENI S.p.A. - Anleihe 2020/2026 (XS2176783319); 0,3750 % La Poste - Anleihe 2019/2027 (FR0013447604); 1,5000 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Anleihe 2020/2030 (XS2148390755); 1,7500 % Pernod-Ricard S.A. - Anleihe 2020/2030 (FR0013506532); 0,5000 % Shell International Finance BV - Anleihe 2020/2024 (XS2170384130); 1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029 (XS1948611840); 0,6250 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2027 (XS2325733413); 0,7500 % TRATON Finance Luxembourg S.A. - Medium Term Notes 2021/2029 (DE000A3KNP96); 0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028 (XS2234567233))

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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		94.314,14	0,031
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		1.767.488,33	0,586
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		11.592,40	0,004
Summe der Erträge		1.873.394,87	0,622
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-339.306,20	-0,113
2. Sonstige Aufwendungen		-6.745,33	-0,002
davon: Negative Einlagezinsen	-6.745,33		-0,002
Summe der Aufwendungen		-346.051,53	-0,115
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.527.343,34	0,507
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.343.330,38	0,446
2. Realisierte Verluste		-395.330,38	-0,131
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		948.000,00	0,315
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.475.343,34	0,821
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.547.252,77	0,513
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		720.430,43	0,239
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.267.683,20	0,752
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.743.026,54	1,574

Entwicklung des Sondervermögens

	2021	2022
	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		298.681.014,04
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-615.154,68
2. Zwischenausschüttungen		-906.535,48
3. Mittelzufluss (netto)		42.029.476,50
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	61.819.701,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-19.790.225,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-42.304,42
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.743.026,54
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	1.547.252,77	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	720.430,43	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		343.889.522,50

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

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **674.934,38**

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		748.607,72

Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	EUR		11.385,16
---	------------	--	------------------

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 11.385,16. 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	114,09
Umlaufende Anteile	STK	3.014.308,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,74
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)	0,10
--	------

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 -6.682,66.

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

Verwendete Vermögensgegenstände		
	absolut	674.934,38
	in % des Fondsvermögens	0,20

10 größte Gegenparteien

	Name	Clearstream Banking AG
	Bruttovolumen offene Geschäfte	674.934,38
	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	674.934,38

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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)	748.607,72
	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	11.385,16
	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

0,20

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	NRW.BANK
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		64.709,67
	2. Name	Bankia S.A.
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		57.460,34
	3. Name	Bremen, Freie Hansestadt
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		36.826,76
	4. Name	Italien, Republik
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		30.857,81
	5. Name	BPCE S.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		19.426,21
	6. Name	BNP Paribas S.A.
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		17.618,21
	7. Name	Agence Française de Développement
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		16.316,11
	8. Name	Porsche Automobil Holding SE
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		15.485,58
	9. Name	Landwirtschaftliche Rentenbank
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		15.439,51
	10. Name	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		14.418,99

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	748.607,72

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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