

Halbjahresbericht
zum 31. August 2020.

**Deka Euro Corporates 0-3
Liquid UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Lizenzvermerk

Das Finanzinstrument wird von der Solactive AG (dem „Lizenzgeber“) nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt und der Lizenzgeber bietet keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung, weder hinsichtlich der Ergebnisse aus einer Nutzung des Index und/oder der Index-Marke noch hinsichtlich des Index-Stands zu irgendeinem bestimmten Zeitpunkt noch in sonstiger Hinsicht. Der Index wird durch den Lizenzgeber berechnet und veröffentlicht, wobei sich der Lizenzgeber nach besten Kräften bemüht, für die Richtigkeit der Berechnung des Index Sorge zu tragen. Es besteht für den Lizenzgeber – unbeschadet seiner Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten – keine Verpflichtung gegenüber Dritten, einschließlich Investoren und/oder Finanzintermediären des Finanzinstruments, auf etwaige Fehler in dem Index hinzuweisen. Weder die Veröffentlichung des Index durch den Lizenzgeber noch die Lizenzierung des Index sowie der Index-Marke für die Nutzung im Zusammenhang mit dem Finanzinstrument stellt eine Empfehlung des Lizenzgebers zur Kapitalanlage dar oder beinhaltet in irgendeiner Weise eine Zusicherung oder Meinung des Lizenzgebers hinsichtlich einer etwaigen Investition in dieses Finanzinstrument. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2020

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2020 bis zum 31. August 2020.

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

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

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

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

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die 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 2020	10
Vermögensaufstellung zum 31. August 2020	11
Anhang	16
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	17

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 Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF ist ein börsenhandelter Indexfonds (ExchangeTraded Fund, ETF).

Die Auswahl der für den Fonds vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den Solactive Euro Corporates 0-3 Year Liquid EUR (Preisindex) nachzubilden. Der Index besteht aus Unternehmensanleihen von Emittenten mit Sitz in einem Euroland, der Schweiz, Großbritannien, Schweden, Norwegen oder Dänemark mit einer Restlaufzeit zwischen 3 Monaten und 3 Jahren. Es wird nur in Anleihen mit Investmentgrade Rating investiert. 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 Fonds von dem zugrunde liegenden Index abhängig sind (passives Management).

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

Die realisierten Verluste resultieren im Wesentlichen aus Transaktionen mit Anleihen, die aufgrund von Indexveränderungen und der Rücknahme von Anteilscheinen durchgeführt wurden.

Wichtige Kennzahlen

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	seit Auflegung p.a.
Performance *	-0,4%	-0,8%	-0,7%
ISIN	DE000ETFL532		

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

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS1548436556	0.125000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2017(21) 20210111
Löschung	DE000A194DC1	0.250000 % Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(21) 20210808
Löschung	XS1388661651	0.375000 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.16(21/21) 20210331
Löschung	XS1616411036	0.375000 % E.ON SE Medium Term Notes v.17(17/21) 20210822
Löschung	XS2010044464	0.375000 % TLG IMMOBILIEN AG Anleihe v.2019(2019/2022) 20220922
Löschung	XS1178970106	0.500000 % Unilever N.V. EO-Medium-Term Notes 2015(22) 20220202
Löschung	XS2001270995	0.625000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) EO-Med.-Term Nts 2019(22/22) 20221123
Löschung	XS1517181167	0.750000 % Lloyds Banking Group PLC EO-Medium-Term Notes 2016(21) 20211108
Löschung	FR0013412699	0.750000 % RCI Banque S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(23/23) 20230409
Löschung	XS1647404554	0.875000 % ALD S.A. EO-Med.-Term Notes 2017(17/22) 20220717
Löschung	XS1143486865	0.875000 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Notes 2014(21) 20211123
Löschung	XS1169630602	0.875000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Med.-Term Nts 2015(22) 20220118
Löschung	XS1956028168	0.875000 % Fortum Oyj EO-Medium-Term Nts 2019(19/23) 20230226
Löschung	XS2082323630	1.000000 % ArcelorMittal S.A. EO-Medium-Term Notes 19(19/23) 20230518
Löschung	XS1204254715	1.000000 % NN Group N.V. EO-Medium-Term Notes 2015(22) 20220317
Löschung	XS1759603761	1.000000 % Prosegur - Cia de Seguridad SA EO-Notes 2018(18/23) 20230207
Löschung	DE000A2YB699	1.125000 % Schaeffler AG MTN v.2019(2022/2022) 20220325
Löschung	XS1111559768	1.125000 % Total Capital Canada Ltd. EO-Medium-Term Notes 2014(22) 20220317
Löschung	XS1202846819	1.250000 % Glencore Finance (Europe) Ltd. EO-Med.-Term Nts 2015(20/21) 20210316
Löschung	XS1375956569	1.373000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2016(22) 20220302
Löschung	XS1851268463	1.400000 % BPP Europe Holdings S.A.R.L. EO-Med.-Term Notes 2018(18/22) 20220705
Löschung	DE000A1UDWM7	1.750000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2013(21) 20210311
Löschung	FR0012332203	1.787000 % Mercialis EO-Bonds 2014(14/23) 20230330
Löschung	XS1077584024	1.875000 % Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2014(21) 20210616
Löschung	XS0944838241	2.125000 % Rolls-Royce PLC EO-Medium-Term Notes 2013(21) 20210617
Löschung	XS1040508167	2.250000 % Imperial Brands Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2014(14/21) 20210225
Löschung	FR0011372622	2.375000 % Auchan Holding S.A. EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20221211
Löschung	XS0856014583	2.375000 % B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2012(23) 20230118
Löschung	XS1052843908	2.500000 % Enagás Financiaciones S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2014(22) 20220410
Löschung	XS0809847667	2.625000 % Akzo Nobel Sweden Finance AB EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20220726
Löschung	XS0996354956	2.625000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2013(21) 20211121
Löschung	FR0011318658	2.750000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Medium-Term Notes 2012(23) 20230309
Löschung	FR0013016631	2.875000 % TDF Infrastructure SAS EO-Obl. 2015(15/22) 20221018
Löschung	XS1167308128	3.125000 % ArcelorMittal S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(22) 20220113
Löschung	XS0562852375	3.750000 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2010(20) 20201124
Löschung	DE000CZ302M3	4.000000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.755 v.10(20) 20200915
Löschung	XS0767278301	4.000000 % Telekom Finanzmanagement GmbH EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20220403
Löschung	XS0635033631	4.125000 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2011(22) 20220113
Löschung	XS0525787874	4.250000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2010(22) 20220712
Neuaufnahme	XS2170609403	0.125000 % GlaxoSmithKline Cap. PLC EO-Medium-Term Nts 2020(23/23) 20230511
Neuaufnahme	XS2182049291	0.125000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(22) 20220604
Neuaufnahme	XS2109806369	0.250000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) EO-Med.-Term Notes 2020(23/23) 20230227

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	DK0009525917	0.250000 % Nykredit Realkredit A/S EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20230119
Neuaufnahme	XS1443997223	0.250000 % Total Capital Intl S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(23) 20230711
Neuaufnahme	XS1747444245	0.375000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(23) 20230709
Neuaufnahme	XS2177575177	0.375000 % E.ON SE Medium Term Notes v.20(23/23) 20230419
Neuaufnahme	XS2054209320	0.452000 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/23) 20230924
Neuaufnahme	XS1769040111	0.500000 % Novartis Finance S.A. EO-Notes 2018(18/23) 20230813
Neuaufnahme	FR0013201597	0.500000 % RCI Banque S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/23) 20230914
Neuaufnahme	DE000A2RYD83	0.625000 % Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20230226
Neuaufnahme	XS1382792197	0.625000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2016(23) 20230402
Neuaufnahme	XS1752476538	0.750000 % Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(23) 20230417
Neuaufnahme	XS2194282948	0.750000 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/23) 20230623
Neuaufnahme	XS1517181167	0.750000 % Lloyds Banking Group PLC EO-Medium-Term Notes 2016(21) 20211108
Neuaufnahme	XS2149270477	0.750000 % UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2020(23/23) 20230420
Neuaufnahme	XS1203854960	0.875000 % B.A.T. Intl Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2015(23/23) 20231012
Neuaufnahme	XS1731105612	0.875000 % Banco de Sabadell S.A. EO-Medium-Term Notes 2017(23) 20230304
Neuaufnahme	XS1956028168	0.875000 % Fortum Oyj EO-Medium-Term Nts 2019(19/23) 20230226
Neuaufnahme	XS2082323630	1.000000 % ArcelorMittal S.A. EO-Medium-Term Notes 19(19/23) 20230518
Neuaufnahme	FR0013179553	1.000000 % JCDecaux S.A. EO-Bonds 2016(16/23) 20230531
Neuaufnahme	XS1190973559	1.109000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2015(23) 20230215
Neuaufnahme	XS1951313680	1.125000 % Imperial Brands Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2019(19/23) 20230813
Neuaufnahme	XS1199964575	1.125000 % Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2015(23) 20230309
Neuaufnahme	XS1420337633	1.375000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2016(16/23) 20230525
Neuaufnahme	XS1896851224	1.375000 % Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Notes 18(23/23) 20231023
Neuaufnahme	FR0012939841	1.500000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2015(15/23) 20230907
Neuaufnahme	DE000A18V138	1.625000 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2015(16/20) 20201214
Neuaufnahme	XS1767050351	1.750000 % Bevco Lux Sàrl EO-Notes 2018(18/23) 20230208
Neuaufnahme	DE000A181034	1.750000 % JAB Holdings B.V. EO-Notes 2016(23) 20230524
Neuaufnahme	FR0012821940	2.500000 % Capgemini SE EO-Notes 2015(15/23) 20230630
Neuaufnahme	FR0011318658	2.750000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Medium-Term Notes 2012(23) 20230309
Neuaufnahme	XS0909369489	3.125000 % CRH Finance DAC EO-Medium-Term Notes 2013(23) 20230402
Neuaufnahme	XS0951155869	3.125000 % Vier Gas Transport GmbH Med.Term.Notes v.2013(2023) 20230709
Neuaufnahme	XS0951565091	3.250000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23) 20230709
Neuaufnahme	XS0562852375	3.750000 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2010(20) 20201124
Neuaufnahme	DE000CZ302M3	4.000000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.755 v.10(20) 20200915
Neuaufnahme	XS0635033631	4.125000 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2011(22) 20220113
Neuaufnahme	FR0000475758	5.750000 % GIE ENGIE Alliance EO-Medium-Term-Notes 2003(23) 20230623

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS0304159576	4.750000	% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2007(22) 20220605	2,65
XS0452187916	5.000000	% ENEL Finance Intl N.V. EO-Medium-Term Notes 2009(22) 20220913	2,19
XS1379182006	1.500000	% HSBC Holdings PLC EO-Medium-Term Notes 2016(22) 20220314	1,95
XS0595092098	4.375000	% DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2011(21) 20210223	1,95
XS2149270477	0.750000	% UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2020(23/23) 20230420	1,95
XS0748187902	4.500000	% ING Bank N.V. EO-Medium-Term Nts 2012(22) 20220220	1,79
XS1115479559	1.375000	% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2014(22) 20220130	1,71
XS1382792197	0.625000	% Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2016(23) 20230402	1,70
FR0013324332	0.500000	% Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/23) 20230320	1,70
XS0635033631	4.125000	% BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2011(22) 20220113	1,70
XS1856833543	0.500000	% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2018(22) 20221115	1,69
FR0010491720	5.625000	% Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Notes 2007(22) 20220703	1,66
BE6285452460	0.875000	% Anheuser-Busch InBev N.V./S.A. EO-Medium-Term Nts 2016(16/22) 20220316	1,59
XS0874864860	3.987000	% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2013(23) 20230122	1,57
DE000A1G0RU9	3.500000	% Allianz Finance II B.V. EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20220213	1,51
DE000DB7XJB9	1.250000	% Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.2014(2021) 20210907	1,49
XS1330948818	1.375000	% Banco Santander S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(22) 20221213	1,48
XS1109741246	1.500000	% Sky Ltd. EO-Medium-Term Notes 2014(21) 20210914	1,46
XS1197351577	1.125000	% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2015(22) 20220303	1,45
DE000A2RYD83	0.625000	% Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20230226	1,45
XS2182049291	0.125000	% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(22) 20220604	1,44
XS1377680381	0.625000	% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2016(16/21) 20210309	1,44
XS1586555606	0.500000	% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2017(21) 20210329	1,44
XS0271758301	4.875000	% Holding dlnfrastr. de Transp. EO-Notes 2006(21) 20211026	1,36
XS0479869744	4.650000	% Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2010(22) 20220119	1,27
DE000A1ROXG3	2.000000	% BASF SE MTN v.2012(2012/2022) 20221204	1,25
XS1190973559	1.109000	% BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2015(23) 20230215	1,23
XS0605214336	4.750000	% Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2011(21) 20210314	1,22
XS1292484323	1.250000	% Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2015(22) 20220314	1,22
XS0563306314	3.875000	% Orange S.A. EO-Medium-Term Notes 2010(21) 20210113	1,21
BE0002272418	0.750000	% KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20220228	1,21
XS1014627571	3.250000	% UniCredit S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2014(21) 20210113	1,21
XS1443997223	0.250000	% Total Capital Intl S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(23) 20230711	1,21
XS1747444245	0.375000	% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(23) 20230709	1,20
XS1385051112	1.875000	% Barclays PLC EO-Medium-Term Notes 2016(21) 20210322	1,13
FR0000475758	5.750000	% GIE ENGIE Alliance EO-Medium-Term-Notes 2003(23) 20230623	1,11
XS0951565091	3.250000	% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23) 20230709	1,04
FR0012821940	2.500000	% Capgemini SE EO-Notes 2015(15/23) 20230630	1,02
XS0412842857	6.500000	% innogy Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2009(21) 20210809	1,01
XS1387174375	2.250000	% HeidelbergCement AG Medium Term Notes v.16(22/23) 20230329	1,00
XS0975256685	3.625000	% Repsol Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2013(21) 20211006	0,99
XS1111324700	2.625000	% EDP Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2014(22) 20220117	0,99
XS1086835979	1.750000	% Carrefour S.A. EO-Med.-Term Notes 2014(14/22) 20220714	0,98
DE000A13SL26	1.125000	% SAP SE Med.Term Nts. v.2014(22/23) 20230219	0,98
XS1909057215	1.500000	% Logicor Financing S.à.r.l. EO-Medium-Term Nts 2018(18/22) 20221113	0,97
XS1752476538	0.750000	% Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(23) 20230417	0,97

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS0879869187	3.500000	% Iberdrola International B.V. EO-Medium-Term Notes 2013(21) 20210131	0,97
XS1840614900	0.625000	% Bayer Capital Corp. B.V. EO-Notes 2018(18/22) 20221214	0,97
XS1077631635	1.625000	% Standard Chartered PLC EO-Medium-Term Notes 2014(21) 20210612	0,97
FR0013216900	0.424000	% Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/22) 20221102	0,97
XS2177575177	0.375000	% E.ON SE Medium Term Notes v.20(23/23) 20230419	0,96
FR0013176302	0.750000	% Vivendi S.A. EO-Bonds 2016(16/21) 20210525	0,96
XS1518704900	0.250000	% Linde Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20220117	0,96
XS1731105612	0.875000	% Banco de Sabadell S.A. EO-Medium-Term Notes 2017(23) 20230304	0,95
XS2054209320	0.452000	% Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/23) 20230924	0,94
XS0760364116	3.625000	% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20220327	0,91
FR0010709451	6.375000	% Engie S.A. EO-Medium-Term Notes 2009(21) 20210117	0,88
XS1896661870	0.250000	% Diageo Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2018(21/21) 20211021	0,86
XS1420337633	1.375000	% Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2016(16/23) 20230525	0,86
XS0826531120	1.750000	% Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20220911	0,84
FR0011193515	4.500000	% Bouygues S.A. EO-Obl. 2012(22) 20220208	0,82
XS2109806369	0.250000	% FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) EO-Med.-Term Notes 2020(23/23) 20230227	0,80
FR0012939841	1.500000	% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2015(15/23) 20230907	0,80
XS0951155869	3.125000	% Vier Gas Transport GmbH Med.Term.Notes v.2013(2023) 20230709	0,78
XS1199964575	1.125000	% Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2015(23) 20230309	0,78
XS1203854960	0.875000	% B.A.T. Intl Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2015(23/23) 20231012	0,78
XS1767050351	1.750000	% Bevco Lux Sàrl EO-Notes 2018(18/23) 20230208	0,77
XS0909369489	3.125000	% CRH Finance DAC EO-Medium-Term Notes 2013(23) 20230402	0,77
FR0013257615	0.375000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Med.Term Notes 2017(17/22) 20220525	0,77
XS0854746343	2.625000	% Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20221114	0,76
XS0834367863	2.625000	% OMV AG EO-Medium-Term Notes 2012(22) 20220926	0,76
XS0811690550	2.625000	% Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN-Anleihe v.2012(2022) 20220801	0,75
XS1329671132	2.125000	% EXOR N.V. EO-Notes 2015(22/22) 20221201	0,74
XS1896851224	1.375000	% Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Notes 18(23/23) 20231023	0,74
BE6282459609	1.625000	% Solvay S.A. EO-Notes 2015(16/22) 20221201	0,74
XS1170787797	1.000000	% Evonik Industries AG Medium Term Notes v.15(22/23) 20230122	0,73
XS1951313680	1.125000	% Imperial Brands Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2019(19/23) 20230813	0,73
XS2194282948	0.750000	% Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/23) 20230623	0,73
XS1769040111	0.500000	% Novartis Finance S.A. EO-Notes 2018(18/23) 20230813	0,73
XS1398336351	2.225000	% Merlin Properties SOCIMI S.A. EO-Medium-T.Notes 2016(16/23) 20230424	0,73
XS1699951767	0.750000	% Unio.di Banche Italiane S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20221016	0,72
DE000A18V138	1.625000	% Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2015(16/20) 20201214	0,72
XS2170609403	0.125000	% GlaxoSmithKline Cap. PLC EO-Medium-Term Nts 2020(23/23) 20230511	0,72
XS1689739347	0.625000	% Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20220926	0,72
FR0013179553	1.000000	% JCDecaux S.A. EO-Bonds 2016(16/23) 20230531	0,72
XS1693260702	0.750000	% LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20221002	0,72
DK0009525917	0.250000	% Nykredit Realkredit A/S EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20230119	0,71
FR0013201597	0.500000	% RCI Banque S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/23) 20230914	0,70
DE000A181034	1.750000	% JAB Holdings B.V. EO-Notes 2016(23) 20230524	0,70
XS1517181167	0.750000	% Lloyds Banking Group PLC EO-Medium-Term Notes 2016(21) 20211108	0,61

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2020.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		65.608.445,06	100,01
1. Anleihen		64.932.042,94	98,98
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	62.432.599,14		95,17
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	2.499.443,80		3,81
2. Forderungen		682.577,95	1,04
3. Bankguthaben		-6.175,83	-0,01
II. Verbindlichkeiten		-8.585,40	-0,01
III. Fondsvermögen		65.599.859,66	100,00

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

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2020.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2020	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE000A1R0XG3	2,0000 % BASF SE - Medium Term Notes 2012/2022	EUR		775	119.000	246	% 104,710	811.504,05	1,24
XS0811690550	2,6250 % Bertelsmann SE & Co. KGaA - Medium Term Notes 2012/2022	EUR		500	100.000	100	% 105,265	526.327,00	0,80
DE000DB7XJB9	1,2500 % Deutsche Bank AG - Medium Term Notes 2014/2021	EUR		1.012	200.000	500	% 100,720	1.019.286,40	1,55
XS2177575177	0,3750 % E.ON SE - Anleihe 2020/2023	EUR		620	620.000	0	% 101,018	626.310,36	0,95
XS1170787797	1,0000 % Evonik Industries AG - Medium-Term Notes 2015/2023	EUR		465	71.000	147	% 102,246	475.443,90	0,72
XS1387174375	2,2500 % HeidelbergCement AG - Medium Term Notes 2016/2023	EUR		620	95.000	196	% 104,258	646.399,60	0,99
XS2194282948	0,7500 % Infineon Technologies AG - Anleihe 2020/2023	EUR		500	500.000	0	% 101,930	509.651,00	0,78
DE000A13SL26	1,1250 % SAP SE - Medium-Term Notes 2014/2023	EUR		620	95.000	196	% 102,766	637.150,44	0,97
XS0951155869	3,1250 % Vier Gas Transport GmbH - Medium Term Notes 2013/2023	EUR		440	440.000	0	% 109,440	481.536,00	0,73
							EUR	5.733.608,75	8,74
Ausland									
DE000A1G0RU9	3,5000 % Allianz Finance II B.V. - Medium Term Notes 2012/2022	EUR		940	200	300	% 105,488	991.589,08	1,51
BE6285452460	0,8750 % Anheuser-Busch InBev N.V./S.A. - Medium Term Notes 2016/2022	EUR		1.020	151	573	% 101,446	1.034.744,51	1,58
FR0010491720	5,6250 % Autoroutes du Sud de la France - Medium Term Notes 2007/2022	EUR		1.032	200	300	% 110,301	1.138.308,38	1,74
XS1203854960	0,8750 % B.A.T. Intl Finance PLC - Medium Term Notes 2015/2023	EUR		469	469	0	% 101,674	476.851,76	0,73
XS1731105612	0,8750 % Banco de Sabadell S.A. - Anleihe 2017/2023	EUR		600	700	100	% 99,927	599.562,00	0,91
XS1330948818	1,3750 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2015/2022	EUR		900	100	300	% 103,302	929.718,00	1,42
XS1385051112	1,8750 % Barclays PLC - Medium Term Notes 2016/2021	EUR		683	100	477	% 101,052	690.182,43	1,05
XS1840614900	0,6250 % Bayer Capital Corp. B.V. - Guaranteed Registered Notes 2018/2022	EUR		600	100	200	% 101,514	609.084,00	0,93
XS1767050351	1,7500 % Bevo Lux Sàrl - Anleihe 2018/2023	EUR		454	454	0	% 101,238	459.620,52	0,70
XS1747444245	0,3750 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2018/2023	EUR		775	775	0	% 100,941	782.292,75	1,19
XS0635033631	4,1250 % BNP Paribas S.A. - Medium-Term Notes 2011/2022	EUR		1.042	1.042	1.212	% 105,782	1.102.244,27	1,68
FR0011193515	4,5000 % Bouygues S.A. - Obligations 2012/2022	EUR		500	100	200	% 106,720	533.601,00	0,81
XS1190973559	1,1090 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2015/2023	EUR		815	915	100	% 102,960	839.124,00	1,28
XS1856833543	0,5000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2018/2022	EUR		1.100	200	400	% 101,268	1.113.943,60	1,70
XS1377680381	0,6250 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2016/2021	EUR		888	100	272	% 100,351	891.116,88	1,36
XS1752476538	0,7500 % Caixabank S.A. - Anleihe 2018/2023	EUR		600	700	100	% 101,524	609.146,40	0,93
FR0012821940	2,5000 % Capgemini SE - Senior Notes 2015/2023	EUR		600	700	100	% 106,374	638.244,00	0,97
XS0854746343	2,6250 % Carlsberg Breweries A/S - Medium Term Notes 2012/2022	EUR		441	0	100	% 105,802	466.588,58	0,71
XS1086835979	1,7500 % Carrefour S.A. - Medium Term Notes 2014/2022	EUR		598	100	262	% 102,883	615.240,34	0,94
XS0760364116	3,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. - Medium Term Notes 2012/2022	EUR		536	100	200	% 105,788	567.021,54	0,86
XS0304159576	4,7500 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium-Term Notes 2007/2022	EUR		1.581	242	500	% 108,799	1.720.115,35	2,62
XS1115479559	1,3750 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2014/2022	EUR		1.047	100	289	% 102,171	1.069.734,56	1,63
XS0909369489	3,1250 % CRH Finance DAC - Anleihe 2013/2023	EUR		425	425	0	% 107,780	458.065,00	0,70
DE000A2RYD83	0,6250 % Daimler Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2019/2023	EUR		930	993	63	% 101,079	940.038,42	1,43
FR0013216900	0,4240 % Danone S.A. - Medium Term Notes 2016/2022	EUR		600	100	200	% 101,073	606.438,00	0,92
XS1382792197	0,6250 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. - Medium Term Notes 2016/2023	EUR		1.085	1.159	74	% 101,706	1.103.512,27	1,68
XS1896661870	0,2500 % Diageo Finance PLC - Medium Term Notes 2018/2021	EUR		536	100	200	% 100,450	538.414,14	0,82

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2020	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS0595092098	4,3750 % DNB Bank ASA - Medium Term Notes 2011/2021		EUR	1.296	200	317	% 102,253	1.325.204,06	2,02
XS1111324700	2,6250 % EDP Finance B.V. - Medium Term Notes 2014/2022		EUR	598	100	262	% 103,697	620.109,26	0,95
XS0452187916	5,0000 % ENEL Finance Intl N.V. - Medium Term Notes 2009/2022		EUR	1.289	199	427	% 110,419	1.423.303,49	2,17
FR0010709451	6,3750 % Engie S.A. - Medium Term Notes 2009/2021		EUR	558	86	177	% 102,480	571.840,63	0,87
XS0951565091	3,2500 % ENI S.p.A. - Medium Term Notes 2013/2023		EUR	586	586	0	% 109,262	640.274,15	0,98
XS1329671132	2,1250 % EXOR N.V. - Senior Notes 2015/2022		EUR	494	100	100	% 103,357	510.582,59	0,78
XS2109806369	0,2500 % FCA Bank S.p.A. [Irish Branch] - Anleihe 2020/2023		EUR	582	582	0	% 98,977	576.044,39	0,88
FR0000475758	5,7500 % GIE ENGIE Alliance - Medium Term Notes 2003/2023		EUR	620	620	0	% 116,256	720.789,43	1,10
XS2170609403	0,1250 % GlaxoSmithKline Capital PLC - Anleihe 2020/2023		EUR	440	440	0	% 100,602	442.648,80	0,67
XS1420337633	1,3750 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. - Medium Term Notes 2016/2023		EUR	593	593	0	% 103,332	612.756,39	0,93
XS0271758301	4,8750 % Holding d'Infrastr. de Transp. - Guaranteed Notes 2006/2021		EUR	862	150	250	% 104,944	904.616,16	1,38
XS1379182006	1,5000 % HSBC Holdings PLC - Medium Term Notes 2016/2022		EUR	1.196	100	317	% 102,281	1.223.285,54	1,86
XS0879869187	3,5000 % Iberdrola International B.V. - Medium Term Notes 2013/2021		EUR	600	100	200	% 101,520	609.118,80	0,93
XS1951313680	1,1250 % Imperial Brands Finance PLC - Anleihe 2019/2023		EUR	440	440	0	% 102,024	448.905,60	0,68
XS0748187902	4,5000 % ING Bank N.V. - Medium Term Notes 2012/2022		EUR	1.047	100	289	% 106,870	1.118.928,90	1,71
XS0412842857	6,5000 % innogy Finance B.V. - Medium Term Notes 2009/2021		EUR	620	95	196	% 106,097	657.802,64	1,00
XS1197351577	1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2015/2022		EUR	888	100	272	% 101,175	898.434,00	1,37
DE000A181034	1,7500 % JAB Holdings B.V. - Guaranteed Notes 2016/2023		EUR	400	400	0	% 104,148	416.590,40	0,64
FR0013179553	1,0000 % JCDecaux S.A. - Anleihe 2016/2023		EUR	500	500	0	% 100,499	502.494,75	0,77
BE0002272418	0,7500 % KBC Groep N.V. - Medium Term Notes 2017/2022		EUR	800	100	200	% 101,251	810.008,00	1,23
XS1693260702	0,7500 % LeasePlan Corporation N.V. - Medium-Term Notes 2017/2022		EUR	494	100	100	% 100,441	496.179,18	0,76
XS1518704900	0,2500 % Linde Finance B.V. - Medium Term Notes 2017/2022		EUR	620	95	196	% 100,465	622.883,00	0,95
XS1517181167	0,7500 % Lloyds Banking Group PLC - Medium Term Notes 2016/2021		EUR	374	374	458	% 100,750	376.805,00	0,57
XS1909057215	1,0500 % Logicor Financing S.à.r.l. - Medium-Term Notes 2018/2022		EUR	598	100	261	% 101,889	609.297,42	0,93
FR0013257615	0,3750 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Medium Term Notes 2017/2022		EUR	496	76	157	% 100,760	499.771,58	0,76
XS1689739347	0,6250 % Mediobanca - Banca di Credito Finanziario S.p.A. - Medium-Term Notes 2017/2022		EUR	494	100	100	% 100,595	496.941,28	0,76
XS1398336351	2,2250 % Merlin Properties SOCIMI S.A. - Medium-Term Notes 2016/2023		EUR	508	200	305	% 102,764	522.039,09	0,80
XS0826531120	1,7500 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Medium Term Notes 2012/2022		EUR	527	81	167	% 104,032	548.246,53	0,84
XS1769040111	0,5000 % Novartis Finance S.A. - Anleihe 2018/2023		EUR	440	440	0	% 101,796	447.901,52	0,68
DK0009525917	0,2500 % Nykredit Realkredit A/S - Anleihe 2019/2023		EUR	525	525	0	% 99,753	523.701,15	0,80
XS0834367863	2,6250 % OMV AG - Medium-Term Notes 2012/2022		EUR	500	100	100	% 105,483	527.417,00	0,80
XS0563306314	3,8750 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2010/2021		EUR	800	150	250	% 101,485	811.883,20	1,24
FR0013201597	0,5000 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2016/2023		EUR	465	465	0	% 97,620	453.931,14	0,69
XS0975256685	3,6250 % Repsol Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2013/2021		EUR	600	100	200	% 103,942	623.652,00	0,95
XS1199964575	1,1250 % Ryanair DAC - Anleihe 2015/2023		EUR	582	582	0	% 96,116	559.395,12	0,85
FR0013324332	0,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2023		EUR	1.100	200	400	% 101,653	1.118.187,40	1,70
FR0012939841	1,5000 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2015/2023		EUR	500	500	0	% 104,307	521.534,50	0,80
XS1292484323	1,2500 % Shell International Finance BV - Medium Term Notes 2015/2022		EUR	748	100	235	% 102,416	766.071,68	1,17

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2020	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS2182049291	0,1250 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2022		EUR	900	900	0	% 100,400	903.600,00	1,38
XS1109741246	1,5000 % Sky Ltd. - Medium Term Notes 2014/2021		EUR	888	100	272	% 101,640	902.563,20	1,38
BE6282459609	1,6250 % Solvay S.A. - Senior Notes 2015/2022		EUR	500	100	100	% 103,038	515.190,00	0,79
XS1077631635	1,6250 % Standard Chartered PLC - Medium Term Notes 2014/2021		EUR	598	100	262	% 101,342	606.027,55	0,92
XS0874864860	3,9870 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium Term Notes 2013/2023		EUR	900	100	300	% 109,670	987.030,00	1,50
XS0605214336	4,7500 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2011/2021		EUR	775	127	235	% 102,548	794.743,90	1,21
XS1896851224	1,3750 % Tesco Corporate Treasury Services PLC - Anleihe 2018/2023		EUR	440	440	0	% 103,130	453.772,00	0,69
XS1443997223	0,2500 % Total Capital Intl S.A. - Medium Term Notes 2016/2023		EUR	800	800	0	% 101,014	808.112,32	1,23
XS2149270477	0,7500 % UBS AG [London Branch] - Anleihe 2020/2023		EUR	1.335	1.335	0	% 102,044	1.362.290,07	2,08
XS1014627571	3,2500 % UniCredit S.p.A. - Medium Term Notes 2014/2021		EUR	748	100	235	% 101,230	757.201,90	1,15
XS1699951767	0,7500 % Unione di Banche Italiane S.p.A. [UBI Banca] - Medium-Term Notes 2017/2022		EUR	494	100	100	% 100,693	497.424,41	0,76
FR0013176302	0,7500 % Vivendi S.A. - Bonds 2016/2021		EUR	660	100	200	% 100,476	663.142,92	1,01
XS0479869744	4,6500 % Vodafone Group PLC - Medium Term Notes 2010/2022		EUR	775	127	235	% 106,571	825.925,25	1,26
XS1586555606	0,5000 % Volkswagen International Finance N.V. - Medium Term Notes 2017/2021		EUR	940	200	300	% 100,199	941.868,72	1,44
DE000A18V138	1,6250 % Vonovia Finance B.V. - Medium-Term Notes 2015/2020		EUR	500	500	0	% 100,414	502.070,00	0,77
XS2054209320	0,4520 % Wintershall Dea Finance B.V. - Anleihe 2019/2023		EUR	600	600	0	% 98,892	593.354,40	0,90
Summe Wertpapiervermögen							EUR	59.198.434,19	90,24
							EUR	64.932.042,94	98,98
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	682.577,95	1,04
Sonstige Forderungen			EUR	397				396,56	0,00
Zinsansprüche			EUR	682.181				682.181,39	1,04
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-6.175,83	-0,01
EUR-Kredite bei:									
Verwahrstelle			EUR	-6.176		% 100,000		-6.175,83	-0,01
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-8.585,40	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-8.585				-8.585,40	-0,01
Fondsvermögen							EUR	65.599.859,66	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	983,96	
Umlaufende Anteile							STK	66.669,00	

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.08.2020

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Inland					
DE000CZ302M3	4,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2010/2020	EUR	614	614	
XS1388661651	0,3750 % Deutsche Post AG - Medium Term Notes 2016/2021	EUR	35	576	
XS1616411036	0,3750 % E.ON SE - Medium Term Notes 2017/2021	EUR	0	541	
DE000A2YB699	1,1250 % Schaeffler AG - Medium Term Notes 2019/2022	EUR	0	541	
XS2010044464	0,3750 % TLG IMMOBILIEN AG - Anleihe 2019/2022	EUR	0	400	

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Ausland					
XS0809847667	2,6250 % Akzo Nobel N.V. - Medium Term Notes 2012/2022	EUR	0	530	
XS1647404554	0,8750 % ALD S.A. - Medium Term Notes 2017/2022	EUR	0	436	
XS2082323630	1,0000 % ArcelorMittal S.A. - Anleihe 2019/2023	EUR	425	425	
XS1167308128	3,1250 % ArcelorMittal S.A. - Medium Term Notes 2015/2022	EUR	0	530	
XS1143486865	0,8750 % AstraZeneca PLC - Medium Term Notes 2014/2021	EUR	0	530	
FR0011372622	2,3750 % Auchan Holding S.A. - Medium Term Notes 2012/2022	EUR	0	500	
XS0856014583	2,3750 % B.A.T. International Finance PLC - Medium-Term Notes 2012/2023	EUR	0	541	
XS1548436556	0,1250 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2017/2021	EUR	59	961	
XS0562852375	3,7500 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2010/2020	EUR	1.260	1.260	
XS1375956569	1,3730 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2016/2022	EUR	0	883	
XS1851268463	1,4000 % BPP Europe Holdings S.A.R.L. - Medium Term Notes 2018/2022	EUR	0	433	
XS1169630602	0,8750 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2015/2022	EUR	0	1.040	
DE000A194DC1	0,2500 % Daimler Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2018/2021	EUR	0	1.082	
XS0525787874	4,2500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. - Medium Term Notes 2010/2022	EUR	0	902	
FR0011318658	2,7500 % Electricité de France (E.D.F.) - Medium Term Notes 2012/2023	EUR	1.100	1.100	
XS1052843908	2,5000 % Enagás Financiaciones S.A.U. - Medium Term Notes 2014/2022	EUR	0	520	
XS0996354956	2,6250 % ENI S.p.A. - Medium-Term Notes 2013/2021	EUR	100	677	
XS2001270995	0,6250 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) - Medium Term Notes 2019/2022	EUR	0	527	
XS1956028168	0,8750 % Fortum Oyj - Medium Term Notes 2019/2023	EUR	567	567	
XS1202846819	1,2500 % Glencore Finance (Europe) Ltd. - Medium Term Notes 2015/2021	EUR	100	970	
XS1040508167	2,2500 % Imperial Brands Finance PLC - Medium Term Notes 2014/2021	EUR	100	860	
FR0012332203	1,7870 % Mercialis - Bonds 2014/2023	EUR	0	500	
XS1204254715	1,0000 % NN Group N.V. - Medium Term Notes 2015/2022	EUR	0	433	
XS1759603761	1,0000 % Prosegur - Compañía de Seguridad S.A. - Senior Notes 2018/2023	EUR	0	500	
FR0013412699	0,7500 % RCI Banque S.A. - Medium-Term Notes 2019/2023	EUR	35	576	
XS0944838241	2,1250 % Rolls-Royce PLC - Medium Term Notes 2013/2021	EUR	0	541	
XS1077584024	1,8750 % Ryanair DAC - Medium Term Notes 2014/2021	EUR	0	600	
DE000A1UDWM7	1,7500 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2013/2021	EUR	59	961	
FR0013016631	2,8750 % TDF Infrastructure SAS - Obligations 2015/2022	EUR	0	436	
XS0767278301	4,0000 % Telekom Finanzmanagement GmbH - Medium Term Notes 2012/2022	EUR	0	541	
XS1111559768	1,1250 % Total Capital Canada Ltd. - Medium Term Notes 2014/2022	EUR	0	760	
XS1178970106	0,5000 % Unilever N.V. - Medium Term Notes 2015/2022	EUR	0	530	

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

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

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		39.893,73	0,598
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		587.836,81	8,817
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		0,33	0,000
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-402,05	-0,006
Summe der Erträge		627.328,82	9,410
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-62,65	-0,001
2. Verwaltungsvergütung		-45.348,37	-0,680
3. Sonstige Aufwendungen		-392,62	-0,006
davon: Negative Einlagezinsen			-0,006
Summe der Aufwendungen	-392,62	-45.803,64	-0,687
III. Ordentlicher Nettoertrag		581.525,18	8,723
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		28.683,51	0,430
2. Realisierte Verluste		-1.231.613,99	-18,474
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.202.930,48	-18,043
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-621.405,30	-9,321
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		163.118,84	2,447
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-216.406,91	-3,246
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-53.288,07	-0,799
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-674.693,37	-10,120

Entwicklung des Sondervermögens

	2020 / 2021
	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	74.632.325,83
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-255.257,80
2. Zwischenausschüttungen	-321.142,72
3. Mittelzufluss (netto)	-7.894.281,33
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	10.182.802,22
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-18.077.083,55
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	112.909,05
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	-674.693,37
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	163.118,84
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-216.406,91
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	65.599.859,66

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

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	983,96
Umlaufende Anteile	STK	66.669,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,98

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2020 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

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

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2020 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums

0,15

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -422,49 enthalten.

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

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

Frankfurt am Main, den 1. September 2020
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2019

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

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsischen Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)

Jörg Boysen

Thomas Ketter

Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Thomas Schneider

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Square
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. August 2020

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



Deka Investment GmbH

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

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