

Halbjahresbericht
zum 31. August 2023.

**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 2023

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 2023 bis zum 31. August 2023.

Im Berichtszeitraum entfernten sich die Teuerungsraten sukzessive von ihren Höchstständen und sorgten damit für eine gewisse Entlastung an den Finanzmärkten. Demgegenüber hat sich in Deutschland und im Euroraum die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,25 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 4,1 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen wies trotz zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren im Bankensektor sowie der Auswirkungen steigender Leitzinsen eine Aufwärtsbewegung aus. Insbesondere in den USA und Japan konnten die Indizes starke Zuwächse verbuchen. Der Euro bewegte sich im Verhältnis zum US-Dollar in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende August bei 1,09 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte unter Schwankungen seitwärts und beendete die Berichtsperiode bei 86,9 US-Dollar je Barrel (Brent).

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 2023 | 10 |
| Vermögensaufstellung zum 31. August 2023 | 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 beigelegt sind, erfolgen.

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF ist ein börsengehandelter 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 Gewinne und 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 | 3 Jahre p.a. |
|----------------------|--------------|--------|--------------|
| Performance * | 1,6% | 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 | FR0014006XE5 | 0.010000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2021(25) 20250306 |
| Löschung | DE000A289DB1 | 0.101000 % BASF SE MTN v.2020(2020/2023) 20230604 |
| Löschung | XS2051659915 | 0.125000 % LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Bonds 2019(23) 20230912 |
| Löschung | XS1492825051 | 0.125000 % Novartis Finance S.A. EO-Notes 2016(16/23) Reg.S 20230919 |
| Löschung | XS2310747915 | 0.128000 % Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2021(21/26) 20260307 |
| Löschung | XS1443997223 | 0.250000 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Notes 2016(23) 20230711 |
| Löschung | XS2199265617 | 0.375000 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/24) 20240705 |
| Löschung | XS2102931594 | 0.375000 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250202 |
| Löschung | DE000A185QA5 | 0.375000 % Evonik Industries AG Medium Term Notes v.16(16/24) 20240906 |
| Löschung | DE000CZ40LR5 | 0.500000 % Commerzbank AG MTN-Anl. v.16(23) S.871 20230912 |
| Löschung | XS2051914963 | 0.500000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) EO-Med.-Term Nts 2019(24/24) 20240912 |
| Löschung | XS1948612905 | 0.625000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231005 |
| Löschung | XS1493320656 | 0.625000 % Cadent Finance PLC EO-Med.-Term Nts 2016(16/24) 5 20240921 |
| Löschung | XS1720922175 | 1.000000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24) 20241120 |
| Löschung | XS1882544627 | 1.000000 % ING Groep N.V. EO-Med.-Term Notes 2018(23) 20230919 |
| Löschung | FR0013324340 | 1.000000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/26) 20260320 |
| Löschung | XS1858912915 | 1.000000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2018(23) 20230722 |
| Löschung | XS1586555861 | 1.125000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2017(23) 20231001 |
| Löschung | DE000A189ZX0 | 1.250000 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2016(16/24) 20241205 |
| Löschung | XS1652512457 | 1.375000 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2017(17/24) 20240725 |
| Löschung | XS2206380573 | 1.500000 % AMCO - Asset Management Co.SpA EO-Medium-Term Nts 2020(23) 20230716 |
| Löschung | XS1550951211 | 1.528000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2017(25) 20250116 |
| Löschung | XS2135797202 | 1.876000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2020(24) 20240406 |
| Löschung | FR0013369493 | 2.000000 % Eutelsat S.A. EO-Bonds 2018(18/25) 20251001 |
| Löschung | FR0013393774 | 2.000000 % RCI Banque S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(24/24) 20240710 |
| Löschung | XS0895249620 | 2.875000 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23) 20230925 |
| Löschung | XS2228260043 | 2.875000 % Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250914 |
| Löschung | FR0000476087 | 4.375000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2003(23) 20230625 |
| Löschung | FR0000475758 | 5.750000 % GIE ENGIE Alliance EO-Medium-Term-Notes 2003(23) 20230623 |
| Neuaufnahme | XS2326546434 | 0.010000 % UBS AG EO-Medium-Term Nts 2021(26) 20260330 |
| Neuaufnahme | XS2447561403 | 0.500000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250221 |
| Neuaufnahme | FR0013412947 | 0.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(26) 20260607 |
| Neuaufnahme | XS2001737324 | 0.750000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2019(19/26) 20260530 |
| Neuaufnahme | XS2344385815 | 0.875000 % Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260524 |
| Neuaufnahme | XS1401174633 | 1.000000 % Heineken N.V. EO-Med.-T. Nts 2016(16/26) 20260503 |
| Neuaufnahme | XS1517174626 | 1.000000 % Lloyds Banking Group PLC EO-Medium-Term Notes 2016(23) 20231108 |
| Neuaufnahme | FR0013332988 | 1.125000 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/25) 20250914 |
| Neuaufnahme | FR0013403441 | 1.250000 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240214 |
| Neuaufnahme | ES0211845302 | 1.375000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Obl. 2016(26) 20260519 |
| Neuaufnahme | XS1405780963 | 1.375000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2016(16/26) 20260706 |
| Neuaufnahme | XS2013574038 | 1.375000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(26) 20260618 |
| Neuaufnahme | ES0205032032 | 1.382000 % Ferrovial Emisiones S.A. EO-Notes 2020(20/26) 20260513 |
| Neuaufnahme | XS1394764689 | 1.460000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2016(26) 20260412 |
| Neuaufnahme | XS1840618059 | 1.500000 % Bayer Capital Corp. B.V. EO-Notes 2018(18/26) 20260625 |

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 | XS1614416193 | 1.500000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(25) 20251116 |
| Neuaufnahme | XS1377679961 | 1.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2016(16/26) 20260309 |
| Neuaufnahme | FR0012146801 | 1.750000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2014(14/26) 20260909 |
| Neuaufnahme | XS1933820372 | 2.125000 % ING Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(26) 20260109 |
| Neuaufnahme | DE000A18V146 | 2.250000 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2015(16/23) 20231214 |
| Neuaufnahme | FR0011911247 | 2.375000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(26) 20260518 |
| Neuaufnahme | XS2178586157 | 2.500000 % Continental AG MTN v.20(26/26) 20260826 |
| Neuaufnahme | XS1048519679 | 2.500000 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Notes 2014(26) 20260324 |
| Neuaufnahme | XS1014610254 | 2.625000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.14(24) 20240114 |
| Neuaufnahme | BE6265142099 | 2.700000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2014(14/26) 20260330 |
| Neuaufnahme | FR0013512944 | 2.750000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26) 20260514 |
| Neuaufnahme | XS2613658470 | 3.750000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(25) 20250419 |
| Neuaufnahme | FR001400FOU6 | 4.625000 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(26/26) 20260712 |
| Neuaufnahme | XS0203712939 | 4.900000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Notes 2004(24) 20241027 |

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|---|------|
| XS0525602339 | 4.125000 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2010(25) 20250713 | 2,71 |
| FR0010800540 | 4.625000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Medium-Term Notes 2009(24) 20240910 | 2,45 |
| XS2079723552 | 0.050000 % DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231113 | 1,94 |
| XS1485597329 | 0.875000 % HSBC Holdings PLC EO-Medium-Term Notes 2016(24) 20240905 | 1,89 |
| XS0452314536 | 5.125000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2009(24) 20240915 | 1,73 |
| DE000A2R9ZT1 | 0.250000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231105 | 1,70 |
| XS2575952424 | 3.750000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2023(26) 20260115 | 1,70 |
| FR0013403441 | 1.250000 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240214 | 1,69 |
| XS1840618059 | 1.500000 % Bayer Capital Corp. B.V. EO-Notes 2018(18/26) 20260625 | 1,61 |
| FR0013412947 | 0.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(26) 20260607 | 1,59 |
| XS2613658470 | 3.750000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(25) 20250419 | 1,46 |
| FR0013234689 | 0.972000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2017(24) 20240730 | 1,42 |
| FR0013506508 | 0.750000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) 20250406 | 1,40 |
| FR0012146801 | 1.750000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2014(14/26) 20260909 | 1,40 |
| FR0013509726 | 0.625000 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250427 | 1,39 |
| XS2168647357 | 1.375000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26) 20260104 | 1,38 |
| FR0013463650 | 0.125000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/25) 20250526 | 1,38 |
| XS2171210862 | 0.375000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25) 20250511 | 1,38 |
| XS1789751531 | 1.000000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/26) 20260325 | 1,38 |
| XS2326546434 | 0.010000 % UBS AG EO-Medium-Term Nts 2021(26) 20260330 | 1,32 |
| XS2178833773 | 3.875000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26) 20260104 | 1,22 |
| XS1014610254 | 2.625000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.14(24) 20240114 | 1,21 |
| XS1377679961 | 1.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2016(16/26) 20260309 | 1,21 |
| XS2523390271 | 2.500000 % RWE AG Medium Term Notes v.22(25/25) 20250823 | 1,20 |
| FR0013396512 | 1.125000 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24) 20240714 | 1,19 |
| XS2022425297 | 1.000000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(24) 20240703 | 1,19 |
| XS1394764689 | 1.460000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2016(26) 20260412 | 1,18 |
| XS1550149204 | 1.000000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Medium-Term Notes 2017(24) 20240915 | 1,18 |
| FR0013429073 | 0.625000 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240925 | 1,18 |
| FR0013216918 | 0.709000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/24) 20241102 | 1,18 |
| FR0011911247 | 2.375000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(26) 20260518 | 1,17 |
| XS0970852348 | 3.750000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2013(25) 20250911 | 1,17 |
| XS2180510732 | 1.250000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2020(25) 20250527 | 1,17 |
| XS2447561403 | 0.500000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250221 | 1,16 |
| XS1476654238 | 0.375000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2016(25) 20250214 | 1,16 |
| XS1614416193 | 1.500000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(25) 20251116 | 1,16 |
| XS2013574038 | 1.375000 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(26) 20260618 | 1,13 |
| XS2344385815 | 0.875000 % Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260524 | 1,08 |
| XS2397239000 | 0.250000 % Heimstaden Bostad Treasury B.V EO-Medium-Term Nts 2021(21/24) 20241012 | 1,06 |
| XS1048519679 | 2.500000 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Notes 2014(26) 20260324 | 1,04 |
| XS0193945655 | 5.875000 % Autostrade per l'Italia S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2004(24) 20240608 | 0,99 |
| XS1531174388 | 1.875000 % Barclays PLC EO-Medium-Term Nts 2016(23) 20231207 | 0,97 |
| BE0002631126 | 1.125000 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240124 | 0,97 |
| XS1071713470 | 2.500000 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2014(24/24) 20240527 | 0,97 |
| FR0014009E10 | 0.375000 % LOréal S.A. EO-Notes 2022(22/24) 20240328 | 0,96 |
| FR0013512944 | 2.750000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26) 20260514 | 0,95 |

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) | | |
|-------------------------------|---|------|
| BE6265142099 | 2.700000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2014(14/26) 20260330 | 0,95 |
| XS2182055181 | 0.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(24) 20240604 | 0,95 |
| XS1147605791 | 1.375000 % GlaxoSmithKline Cap. PLC EO-Medium-Term Notes 2014(24) 20241201 | 0,95 |
| XS1849518276 | 2.875000 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S 20260114 | 0,95 |
| XS1195056079 | 0.875000 % Roche Finance Europe B.V. EO-Med.-Term Notes 2015(15/25) 20250224 | 0,94 |
| FR0013201308 | 0.250000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2016(16/24) 20240908 | 0,94 |
| XS1529515584 | 1.500000 % HeidelbergCement AG Medium Term Notes v.16(16/25) 20250206 | 0,94 |
| XS2147133495 | 1.250000 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20250324 | 0,94 |
| XS1933820372 | 2.125000 % ING Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(26) 20260109 | 0,94 |
| XS2058729653 | 0.375000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20241001 | 0,94 |
| XS1575444622 | 1.000000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Med.-Term Notes 2017(24/25) 20250306 | 0,94 |
| FR0013506524 | 1.125000 % Pernod-Ricard S.A. EO-Bonds 2020(20/25) 20250406 | 0,94 |
| XS1109802568 | 1.875000 % Vodafone Group PLC EO-Med.-Term Notes 2014(25/25) 20250910 | 0,94 |
| XS1639488771 | 1.500000 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA EO-Medium-Term Notes 2017(25) 20250626 | 0,93 |
| FR0013060209 | 1.625000 % RTE Réseau de Transp.dElectr. EO-Medium-Term Nts 2015(15/25) 20251126 | 0,93 |
| XS1405780963 | 1.375000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2016(16/26) 20260706 | 0,92 |
| XS2148372696 | 1.125000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(26/26) 20260331 | 0,92 |
| XS2156506854 | 1.250000 % Naturgy Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260114 | 0,92 |
| XS2028816028 | 0.875000 % Banco de Sabadell S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 19(25) 20250721 | 0,92 |
| XS2020670779 | 0.250000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/25) 20250701 | 0,92 |
| DE000A3KNP88 | 0.125000 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(25/25) 20250323 | 0,92 |
| XS1401174633 | 1.000000 % Heineken N.V. EO-Med.-T. Nts 2016(16/26) 20260503 | 0,91 |
| XS1288849471 | 2.375000 % Kerry Group Financial Services EO-Notes 2015(15/25) 20250909 | 0,91 |
| XS2054209833 | 0.840000 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/25) 20250924 | 0,91 |
| XS2001737324 | 0.750000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2019(19/26) 20260530 | 0,90 |
| XS2289133915 | 0.325000 % UniCredit S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(26) 20260118 | 0,90 |
| DE000A18V146 | 2.250000 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2015(16/23) 20231214 | 0,85 |
| ES0211845302 | 1.375000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Obl. 2016(26) 20260519 | 0,82 |
| XS2153593103 | 2.375000 % B.A.T. Netherlands Finance BV EO-Medium-Term Nts 2020(20/24) 20241006 | 0,82 |
| XS1557096267 | 0.875000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(24) 20240129 | 0,80 |
| FR0013282571 | 0.875000 % Vivendi SE EO-Med.-Term Notes 2017(17/24) 20240917 | 0,80 |
| FR0013510179 | 2.875000 % ELO S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/26) 20260128 | 0,80 |
| XS2241090088 | 0.125000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/24) 20241004 | 0,80 |
| XS0203712939 | 4.900000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Notes 2004(24) 20241027 | 0,79 |
| XS0982019126 | 3.000000 % E.ON Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2013(24) 20240116 | 0,78 |
| XS2462324745 | 1.250000 % GSK Consumer Health.Cap.NL BV EO-Med.-Term Notes 2022(22/26) 20260328 | 0,78 |
| XS1517174626 | 1.000000 % Lloyds Banking Group PLC EO-Medium-Term Notes 2016(23) 20231108 | 0,76 |
| FR0013507852 | 1.625000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/26) 20260414 | 0,74 |
| FR0013332988 | 1.125000 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/25) 20250914 | 0,74 |
| FR001400F0U6 | 4.625000 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(26/26) 20260712 | 0,74 |
| DE000DB7XJP9 | 1.125000 % Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.2015(2025) 20250316 | 0,74 |
| ES0205032032 | 1.382000 % Ferrovial Emisiones S.A. EO-Notes 2020(20/26) 20260513 | 0,72 |
| XS2178586157 | 2.500000 % Continental AG MTN v.20(26/26) 20260826 | 0,71 |
| XS1685798370 | 0.875000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2017(17/24) 20240918 | 0,71 |

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens ¹⁾ |
|--------------------------------|--------------------|----------------------|---|
| I. Vermögensgegenstände | | 85.775.780,84 | 100,01 |
| 1. Anleihen | | 84.776.696,65 | 98,85 |
| - Restlaufzeit bis 3 Jahre | 83.542.531,09 | | 97,41 |
| - Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre | 1.234.165,56 | | 1,44 |
| 2. Forderungen | | 800.146,70 | 0,93 |
| 3. Bankguthaben | | 198.937,49 | 0,23 |
| II. Verbindlichkeiten | | -12.310,00 | -0,01 |
| III. Fondsvermögen | | 85.763.470,84 | 100,00 |

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

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2023.

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|------------------------------|---|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------|----------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | |
| XS2178586157 | 2,5000 % Continental AG - Medium Term Notes 2020/2026 | EUR | | 628 | 628 | 0 | % 97,115 | 609.883,46 | 0,71 |
| DE000DB7XJP9 | 1,1250 % Deutsche Bank AG - Medium Term Notes 2015/2025 | EUR | | 700 | 200 | 100 | % 94,944 | 664.609,40 | 0,77 |
| XS1529515584 | 1,5000 % HeidelbergCement AG - Medium Term Notes 2016/2025 | EUR | | 838 | 201 | 30 | % 96,476 | 808.467,20 | 0,94 |
| XS2171210862 | 0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Anleihe 2020/2025 | EUR | | 1.300 | 400 | 100 | % 94,033 | 1.222.434,20 | 1,43 |
| XS2523390271 | 2,5000 % RWE AG - Medium Term Notes 2022/2025 | EUR | | 1.047 | 252 | 39 | % 97,880 | 1.024.803,60 | 1,19 |
| XS1014610254 | 2,6250 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2014/2024 | EUR | | 1.047 | 1.047 | 0 | % 99,367 | 1.040.372,49 | 1,21 |
| | | | | | | | EUR | 5.370.570,35 | 6,26 |
| Ausland | | | | | | | | | |
| ES0211845302 | 1,3750 % Abertis Infraestructuras S.A. - Obligaciones 2016/2026 | EUR | | 700 | 700 | 0 | % 94,214 | 659.500,80 | 0,77 |
| XS2180510732 | 1,2500 % ABN AMRO Bank N.V. - Anleihe 2020/2025 | EUR | | 1.000 | 300 | 100 | % 95,418 | 954.176,00 | 1,11 |
| XS2613658470 | 3,7500 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2023/2025 | EUR | | 1.300 | 1.300 | 0 | % 99,767 | 1.296.971,00 | 1,51 |
| XS1685798370 | 0,8750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. - Senior Notes 2017/2024 | EUR | | 591 | 100 | 0 | % 96,969 | 573.084,43 | 0,67 |
| BE6265142099 | 2,7000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2014/2026 | EUR | | 867 | 867 | 0 | % 97,436 | 844.770,10 | 0,98 |
| XS1405780963 | 1,3750 % ASML Holding N.V. - Senior Notes 2016/2026 | EUR | | 867 | 867 | 0 | % 94,482 | 819.157,21 | 0,96 |
| XS0452314536 | 5,1250 % Assicurazioni Generali S.p.A. - Medium Term Notes 2009/2024 | EUR | | 1.483 | 390 | 53 | % 101,061 | 1.498.734,63 | 1,75 |
| FR0013510179 | 2,8750 % Auchan Holding S.A. - Anleihe 2020/2026 | EUR | | 700 | 100 | 0 | % 96,029 | 672.202,15 | 0,78 |
| XS0193945655 | 5,8750 % Autostrade per L'Italia S.p.A. - Medium Term Notes 2004/2024 | EUR | | 800 | 100 | 0 | % 101,250 | 810.000,00 | 0,94 |
| XS2153593103 | 2,3750 % B.A.T. Netherlands Finance B.V. - Medium Term Notes 2020/2024 | EUR | | 757 | 300 | 100 | % 98,243 | 743.699,51 | 0,87 |
| XS2058729653 | 0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. - Medium Term Notes 2019/2024 | EUR | | 800 | 100 | 0 | % 96,150 | 769.200,00 | 0,90 |
| XS2028816028 | 0,8750 % Banco de Sabadell S.A. - Medium Term Notes 2019/2025 | EUR | | 800 | 100 | 0 | % 93,906 | 751.249,60 | 0,88 |
| XS2168647357 | 1,3750 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2026 | EUR | | 1.300 | 400 | 100 | % 94,113 | 1.223.463,80 | 1,43 |
| XS2575952424 | 3,7500 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2023/2026 | EUR | | 1.500 | 400 | 100 | % 99,161 | 1.487.418,00 | 1,73 |
| XS1531174388 | 1,8750 % Barclays PLC - Medium Term Notes 2016/2023 | EUR | | 854 | 200 | 0 | % 99,453 | 849.332,04 | 0,99 |
| XS1840618059 | 1,5000 % Bayer Capital Corp. B.V. - Guaranteed Registered Notes 2018/2026 | EUR | | 1.500 | 1.600 | 100 | % 93,884 | 1.408.260,00 | 1,64 |
| XS2447561403 | 0,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2022/2025 | EUR | | 1.047 | 1.047 | 0 | % 95,357 | 998.389,88 | 1,16 |
| XS1614416193 | 1,5000 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2017/2025 | EUR | | 1.062 | 1.062 | 0 | % 95,190 | 1.010.922,05 | 1,18 |
| FR0013509726 | 0,6250 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2025 | EUR | | 1.300 | 400 | 100 | % 94,646 | 1.230.398,00 | 1,43 |
| FR0013429073 | 0,6250 % BPCE S.A. - Medium Term Notes 2019/2024 | EUR | | 1.000 | 300 | 100 | % 96,386 | 963.856,58 | 1,12 |
| FR0013412947 | 0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2019/2026 | EUR | | 1.500 | 1.500 | 0 | % 91,666 | 1.374.990,00 | 1,60 |
| XS1377679961 | 1,7500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2016/2026 | EUR | | 1.104 | 1.104 | 0 | % 94,939 | 1.048.130,98 | 1,22 |
| XS2013574038 | 1,3750 % CaixaBank S.A. - Medium Term Notes 2019/2026 | EUR | | 1.000 | 1.000 | 0 | % 92,221 | 922.210,00 | 1,08 |
| FR0013507852 | 1,6250 % Capgemini SE - Senior Notes 2020/2026 | EUR | | 700 | 200 | 0 | % 95,135 | 665.946,40 | 0,78 |
| XS1071713470 | 2,5000 % Carlsberg Breweries A/S - Medium Term Notes 2014/2024 | EUR | | 855 | 200 | 0 | % 98,813 | 844.847,73 | 0,99 |
| XS0525602339 | 4,1250 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium Term Notes 2010/2025 | EUR | | 2.304 | 555 | 85 | % 100,879 | 2.324.247,55 | 2,71 |
| FR0013216918 | 0,7090 % Danone S.A. - Medium Term Notes 2016/2024 | EUR | | 1.000 | 300 | 100 | % 96,317 | 963.168,00 | 1,12 |
| XS1557096267 | 0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. - Medium Term Notes 2017/2024 | EUR | | 699 | 193 | 328 | % 98,737 | 690.171,63 | 0,80 |
| XS2079723552 | 0,0500 % DNB Bank ASA - Anleihe 2019/2023 | EUR | | 1.699 | 489 | 100 | % 99,250 | 1.686.264,30 | 1,97 |
| XS0982019126 | 3,0000 % E.ON Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2013/2024 | EUR | | 670 | 162 | 25 | % 99,590 | 667.253,00 | 0,78 |
| FR0010800540 | 4,6250 % Electricité de France (E.D.F.) - Medium Term Notes 2009/2024 | EUR | | 2.100 | 500 | 50 | % 100,553 | 2.111.621,40 | 2,46 |

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--------------|---|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------|----------------------|
| XS1550149204 | 1,0000 % ENEL Finance International N.V. - Medium Term Notes 2017/2024 | | EUR | 1.062 | 243 | 0 | % 96,948 | 1.029.587,76 | 1,20 |
| FR0011911247 | 2,3750 % Engie S.A. - Medium Term Notes 2014/2026 | | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 96,447 | 964.470,00 | 1,12 |
| XS0970852348 | 3,7500 % ENI S.p.A. - Medium Term Notes 2013/2025 | | EUR | 1.024 | 200 | 0 | % 99,881 | 1.022.781,44 | 1,19 |
| FR0013463650 | 0,1250 % EssilorLuxottica S.A. - Anleihe 2019/2025 | | EUR | 1.300 | 400 | 100 | % 94,111 | 1.223.443,00 | 1,43 |
| ES0205032032 | 1,3820 % Ferrovial Emisiones S.A. - Guaranteed Notes 2020/2026 | | EUR | 700 | 800 | 100 | % 93,992 | 657.945,40 | 0,77 |
| XS1639488771 | 1,5000 % Ferrovie dello Stato Italiane S.p.A. - Anleihe 2017/2025 | | EUR | 887 | 300 | 100 | % 95,704 | 848.897,87 | 0,99 |
| XS1147605791 | 1,3750 % GlaxoSmithKline Capital PLC - Medium Term Notes 2014/2024 | | EUR | 887 | 300 | 100 | % 97,055 | 860.874,14 | 1,00 |
| XS2462324745 | 1,2500 % GSK Consumer Health.Cap.NL BV - Medium Term Notes 2022/2026 | | EUR | 667 | 200 | 100 | % 93,669 | 624.772,23 | 0,73 |
| XS2397239000 | 0,2500 % Heimstaden Bostad Treasury B.V. - Medium Term Notes 2021/2024 | | EUR | 1.019 | 200 | 0 | % 90,700 | 924.235,29 | 1,08 |
| XS1401174633 | 1,0000 % Heineken N.V. - Medium Term Notes 2016/2026 | | EUR | 867 | 867 | 0 | % 93,643 | 811.883,48 | 0,95 |
| XS1485597329 | 0,8750 % HSBC Holdings PLC - Medium Term Notes 2016/2024 | | EUR | 1.699 | 489 | 100 | % 96,870 | 1.645.814,50 | 1,92 |
| XS1575444622 | 1,0000 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2017/2025 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 96,040 | 768.323,20 | 0,90 |
| XS1933820372 | 2,1250 % ING Groep N.V. - Medium Term Notes 2019/2026 | | EUR | 800 | 800 | 0 | % 96,242 | 769.939,20 | 0,90 |
| XS2022425297 | 1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2019/2024 | | EUR | 1.062 | 243 | 0 | % 97,383 | 1.034.207,46 | 1,21 |
| BE0002631126 | 1,1250 % KBC Groep N.V. - Medium Term Notes 2019/2024 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 98,871 | 790.969,60 | 0,92 |
| XS1288849471 | 2,3750 % Kerry Group Financial Services - Anleihe 2015/2025 | | EUR | 753 | 200 | 100 | % 97,905 | 737.224,65 | 0,86 |
| XS1517174626 | 1,0000 % Lloyds Banking Group PLC - Medium Term Notes 2016/2023 | | EUR | 652 | 652 | 0 | % 99,451 | 648.420,52 | 0,76 |
| FR0014009E10 | 0,3750 % L'Oréal S.A. - Anleihe 2022/2024 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 98,055 | 784.438,40 | 0,91 |
| FR0013506508 | 0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE - Anleihe 2020/2025 | | EUR | 1.300 | 400 | 100 | % 95,654 | 1.243.502,00 | 1,45 |
| XS2020670779 | 0,2500 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2025 | | EUR | 867 | 200 | 0 | % 93,752 | 812.826,37 | 0,95 |
| DE000A2R9ZT1 | 0,2500 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. - Anleihe 2019/2023 | | EUR | 1.466 | 352 | 53 | % 99,364 | 1.456.676,24 | 1,70 |
| XS2156506854 | 1,2500 % Naturgy Finance B.V. - Anleihe 2020/2026 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 94,123 | 752.984,00 | 0,88 |
| XS2148372696 | 1,1250 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Anleihe 2020/2026 | | EUR | 838 | 201 | 30 | % 94,366 | 790.783,73 | 0,92 |
| FR0013396512 | 1,1250 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2024 | | EUR | 1.000 | 300 | 100 | % 97,501 | 975.008,00 | 1,14 |
| FR0013506524 | 1,1250 % Pernod-Ricard S.A. - Bonds 2020/2025 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 96,005 | 768.036,80 | 0,90 |
| FR0013512944 | 2,7500 % Peugeot S.A. - Anleihe 2020/2026 | | EUR | 800 | 800 | 0 | % 97,493 | 779.944,00 | 0,91 |
| FR001400FOU6 | 4,6250 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2023/2026 | | EUR | 628 | 628 | 0 | % 100,570 | 631.582,11 | 0,74 |
| XS2241090088 | 0,1250 % Repsol Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2020/2024 | | EUR | 700 | 100 | 0 | % 95,860 | 671.016,58 | 0,78 |
| XS1789751531 | 1,0000 % Richemont Intl Holding S.A. - EO-Notes 2018/2026 | | EUR | 1.274 | 274 | 0 | % 93,891 | 1.196.173,89 | 1,39 |
| XS1195056079 | 0,8750 % Roche Finance Europe B.V. - Medium Term Notes 2015/2025 | | EUR | 838 | 201 | 30 | % 96,587 | 809.397,38 | 0,94 |
| FR0013060209 | 1,6250 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. - Medium Term Notes 2015/2025 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 95,595 | 764.756,80 | 0,89 |
| XS2344385815 | 0,8750 % Ryanair DAC - Medium Term Notes 2021/2026 | | EUR | 1.005 | 1.005 | 0 | % 91,931 | 923.908,56 | 1,08 |
| FR0012146801 | 1,7500 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2014/2026 | | EUR | 1.300 | 1.300 | 0 | % 94,936 | 1.234.165,56 | 1,44 |
| FR0013201308 | 0,2500 % Schneider Electric SE - Medium Term Notes 2016/2024 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 96,572 | 772.573,06 | 0,90 |
| XS1476654238 | 0,3750 % Shell International Finance BV - Medium Term Notes 2016/2025 | | EUR | 1.062 | 203 | 0 | % 95,200 | 1.011.024,00 | 1,18 |
| XS2182055181 | 0,0000 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Medium Term Notes 1900/1900 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 97,274 | 778.190,40 | 0,91 |
| XS1849518276 | 2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. - Guaranteed Registered Notes 2018/2026 | | EUR | 887 | 300 | 100 | % 96,798 | 858.601,81 | 1,00 |
| FR0013403441 | 1,2500 % Société Générale S.A. - Anleihe 2019/2024 | | EUR | 1.500 | 1.600 | 100 | % 98,748 | 1.481.214,00 | 1,73 |
| XS2178833773 | 3,8750 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2020/2026 | | EUR | 1.062 | 228 | 0 | % 100,166 | 1.063.760,37 | 1,24 |
| XS1394764689 | 1,4600 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium Term Notes 2016/2026 | | EUR | 1.100 | 1.200 | 100 | % 94,750 | 1.042.247,80 | 1,22 |

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|---|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------|----------------------|
| XS2001737324 | 0,7500 % Telenor ASA - Anleihe 2019/2026 | | EUR | 838 | 838 | 0 | % 92,442 | 774.660,61 | 0,90 |
| XS0203712939 | 4,9000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - NTS (Notes) 2004/2024 | | EUR | 680 | 730 | 50 | % 100,850 | 685.780,00 | 0,80 |
| XS1048519679 | 2,5000 % Total Capital Intl S.A. - Medium Term Notes 2014/2026 | | EUR | 900 | 900 | 0 | % 97,040 | 873.359,96 | 1,02 |
| DE000A3KNP88 | 0,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. - Anleihe 2021/2025 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 93,731 | 749.849,60 | 0,87 |
| XS2326546434 | 0,0100 % UBS AG (London Branch) - Medium Term Notes 2021/2026 | | EUR | 1.350 | 1.550 | 200 | % 90,114 | 1.216.539,00 | 1,42 |
| FR0013332988 | 1,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE - Medium Term Notes 2018/2025 | | EUR | 700 | 700 | 0 | % 94,331 | 660.317,00 | 0,77 |
| XS2289133915 | 0,3250 % UniCredit S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2026 | | EUR | 867 | 200 | 0 | % 91,686 | 794.917,62 | 0,93 |
| XS2147133495 | 1,2500 % Unilever N.V. - Anleihe 2020/2025 | | EUR | 887 | 300 | 100 | % 96,417 | 855.217,02 | 1,00 |
| FR0013282571 | 0,8750 % Vivendi SE - Medium Term Notes 2017/2024 | | EUR | 700 | 100 | 0 | % 96,529 | 675.701,60 | 0,79 |
| XS1109802568 | 1,8750 % Vodafone Group PLC - Medium Term Notes 2014/2025 | | EUR | 887 | 300 | 100 | % 95,936 | 850.952,32 | 0,99 |
| DE000A18V146 | 2,2500 % Vonovia Finance B.V. - Medium Term Notes 2015/2023 | | EUR | 700 | 700 | 0 | % 99,354 | 695.478,00 | 0,81 |
| XS2054209833 | 0,8400 % Wintershall Dea Finance B.V. - Anleihe 2019/2025 | | EUR | 800 | 100 | 0 | % 92,889 | 743.115,20 | 0,87 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 79.406.126,30 | 92,59 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 198.937,49 | 0,23 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | | | | | EUR | 198.937,49 | 0,23 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 800.146,70 | 0,93 |
| Sonstige Forderungen | | | | | | | EUR | 396,56 | 0,00 |
| Zinsansprüche | | | | | | | EUR | 799.750,14 | 0,93 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -12.310,00 | -0,01 |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung | | | | | | | EUR | -12.310,00 | -0,01 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 85.763.470,84 | 100,00 ¹⁾ |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 920,15 | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | | STK | 93.206,00 | |

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 31.08.2023

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 | 100 | 800 | |
| XS2199265617 | 0,3750 % Bayer AG - Anleihe 2020/2024 | EUR | 100 | 1.100 | |
| DE000CZ40LR5 | 0,5000 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2016/2023 | EUR | 182 | 849 | |
| DE000A185QA5 | 0,3750 % Evonik Industries AG - Medium Term Notes 2016/2024 | EUR | 65 | 565 | |
| Ausland | | | | | |
| XS2206380573 | 1,5000 % AMCO - Asset Management Co.SpA - Medium Term Notes 2020/2023 | EUR | 100 | 919 | |
| XS1948612905 | 0,6250 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2023 | EUR | 274 | 1.274 | |
| XS0895249620 | 2,8750 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2013/2023 | EUR | 314 | 1.461 | |
| XS2135797202 | 1,8760 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2020/2024 | EUR | 200 | 855 | |
| FR00140006XE5 | 0,0100 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Anleihe 2021/2025 | EUR | 300 | 1.500 | |
| XS1720922175 | 1,0000 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2017/2024 | EUR | 100 | 820 | |
| XS1493320656 | 0,6250 % Cadent Finance PLC - Medium Term Notes 2016/2024 | EUR | 100 | 591 | |
| XS2102931594 | 0,3750 % CaixaBank S.A. - Medium Term Notes 2020/2025 | EUR | 100 | 800 | |
| XS1652512457 | 1,3750 % DS Smith PLC - Medium Term Notes 2017/2024 | EUR | 100 | 591 | |
| XS2310747915 | 0,1280 % Eaton Capital Unlimited Co. - Guaranteed Registered Notes 2021/2026 | EUR | 200 | 800 | |
| FR0013369493 | 2,0000 % Eutelsat S.A. - Anleihe 2018/2025 | EUR | 200 | 700 | |

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 |
|--------------|---|---|-------------------|----------------------|---------------------|
| XS2051914963 | 0,5000 % FCA Bank S.p.A. - Medium Term Notes 2019/2024 | EUR | 100 | | 667 |
| FR0000475758 | 5,7500 % GIE ENGIE Alliance - Medium Term Notes 2003/2023 | EUR | 86 | | 753 |
| XS1882544627 | 1,0000 % ING Groep N.V. - Anleihe 2018/2023 | EUR | 100 | | 800 |
| FR0000476087 | 4,3750 % La Poste - Medium Term Notes 2003/2023 | EUR | 86 | | 753 |
| XS2051659915 | 0,1250 % LeasePlan Corporation N.V. - Anleihe 2019/2023 | EUR | 200 | | 855 |
| XS1492825051 | 0,1250 % Novartis Finance S.A. - EO-Notes 2016/2023 | EUR | 243 | | 1.062 |
| FR0013393774 | 2,0000 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2019/2024 | EUR | 65 | | 565 |
| XS2228260043 | 2,8750 % Ryanair DAC - Medium Term Notes 2020/2025 | EUR | 200 | | 767 |
| FR0013324340 | 1,0000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2026 | EUR | 300 | | 1.300 |
| XS1550951211 | 1,5280 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium Term Notes 2017/2025 | EUR | 0 | | 800 |
| XS1858912915 | 1,0000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2018/2023 | EUR | 100 | | 755 |
| XS1443997223 | 0,2500 % Total Capital Intl S.A. - Medium Term Notes 2016/2023 | EUR | 100 | | 900 |
| XS1586555861 | 1,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Senior Notes 2017/2023 | EUR | 300 | | 1.300 |
| DE000A189ZX0 | 1,2500 % Vonovia Finance B.V. - Medium Term Notes 2016/2024 | EUR | 200 | | 800 |

Deka Euro Corporates 0-3 Liquid UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2023 bis zum 31.08.2023

| | insgesamt EUR | insgesamt EUR | je Anteil ¹⁾ EUR |
|--|------------------|------------------|--------------------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 32.643,33 | 0,350 |
| 2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | 639.849,08 | 6,865 |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | 25.456,62 | 0,273 |
| Summe der Erträge | | 697.949,03 | 7,488 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Verwaltungsvergütung | | -65.346,25 | -0,701 |
| Summe der Aufwendungen | | -65.346,25 | -0,701 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 632.602,78 | 6,787 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 50.646,83 | 0,543 |
| 2. Realisierte Verluste | | -408.470,01 | -4,382 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -357.823,18 | -3,839 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 274.779,60 | 2,948 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | 115.566,12 | 1,240 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | 809.307,25 | 8,683 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 924.873,37 | 9,923 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 1.199.652,97 | 12,871 |

Entwicklung des Sondervermögens

| | EUR | 2022 / 2023 EUR |
|--|---------------|--------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 68.701.251,41 |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -273.749,84 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | -358.843,10 |
| 3. Mittelzufluss (netto) | | 16.507.372,45 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 20.177.346,85 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -3.669.974,40 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -12.213,05 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 1.199.652,97 |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne | 115.566,12 | |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste | 809.307,25 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | 85.763.470,84 |

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 | 920,15 |
| Umlaufende Anteile | STK | 93.206,00 |

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,85

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 31.08.2023 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 31.08.2023 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)

0,09

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.

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 2023

Deka Investment GmbH

Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,1 Mio.

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

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

Stellvertretende Vorsitzende

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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

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

Jörg Boysen

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

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

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 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 2023

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



Deka Investment GmbH

Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

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

