

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2023.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 1-10 UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

**.iDeka**  
Investments

## **Lizenzvermerk**

Das geistige Eigentum des hier erwähnten Index ist Eigentum von oder lizenziert durch IHS Markit und/oder seinen Tochtergesellschaften (IHS Markit). Dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen werden von IHS Markit nicht gesponsert, gefördert oder unterstützt. IHS Markit gibt keinerlei Garantien oder Zusicherungen hinsichtlich der Richtigkeit, Vollständigkeit oder Eignung für einen bestimmten Zweck oder der Ergebnisse, die durch die Verwendung des Index oder der darin enthaltenen Informationen erzielt werden können. IHS Markit haftet gegenüber dem Empfänger in keiner Weise für Ungenauigkeiten, Fehler oder Auslassungen in den IHS Markit Daten, unabhängig von deren Ursache, oder für daraus resultierende (direkte oder indirekte) Schäden. Dieses Dokument stellt keine ausdrückliche oder stillschweigende Finanz-, Investitions-, Rechts-, Steuer- oder sonstige Beratung jeglicher Art oder Empfehlung von IHS Markit dar. Der Verkaufsprospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der eingeschränkten Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und der Deka Investment GmbH und jeglichen zugehörigen Fonds.

# Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2023

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 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](http://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	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2023	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	13

**Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.**

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der größten und umsatzstärksten europäischen Staatsanleihen ab und besteht aus maximal 25 Einzelwerten unterschiedlicher Euro-Länder mit einer Restlaufzeit von 1,5 bis 10,5 Jahren. Das Fondsmanagement strebt dabei als Anlageziel die Erzielung einer Wertentwicklung an, welche die des zugrunde liegenden Index widerspiegelt. Zu diesem Zweck wird eine exakte Nachbildung des Index angestrebt.

Grundlage hierfür ist, dass die Entscheidungen über den Erwerb oder die Veräußerung von Vermögensgegenständen sowie über deren Gewichtung im Sondervermögen von dem zugrunde liegenden Index abhängig sind (passives Management).

Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen üblicherweise ausgeschüttet.

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

## Wichtige Kennzahlen

### Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	3,0%	-3,2%	-5,8%
<b>ISIN</b>	DE000ETFL110		

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	DE0001102473	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290814
Löschung	FR0013415627	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(25) 20250324
Löschung	BE0000349580	0.100000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2020(30) 20300621
Löschung	ES0000012H41	0.100000 % Spanien EO-Bonos 2021(31) 20310429
Löschung	FR0013407236	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20290524
Löschung	AT0000A269M8	0.500000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290219
Löschung	ES0000012K20	0.700000 % Spanien EO-Bonos 2022(32) 20320429
Löschung	IT0005365165	3.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(29) 20290731
Löschung	ES0000012L52	3.150000 % Spanien EO-Bonos 2023(33) 20330429
Neuaufnahme	FR0013451507	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20291124
Neuaufnahme	AT0000A2CQD2	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(30) 20300219
Neuaufnahme	ES0000012I08	0.000000 % Spanien EO-Obligaciones 2021(28) 20280130
Neuaufnahme	ES0000012K53	0.800000 % Spanien EO-Bonos 2022(29) 20290729
Neuaufnahme	IT0005416570	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(27) 20270914
Neuaufnahme	FR001400BKZ3	2.000000 % Frankreich EO-OAT 2022(32) 20321124
Neuaufnahme	DE000BU2Z007	2.300000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) 20330214
Neuaufnahme	BE0000357666	3.000000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2023(33) 20330621
Neuaufnahme	ES0000012L52	3.150000 % Spanien EO-Bonos 2023(33) 20330429

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
DE000BU2Z007	2.300000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) 20330214	6,85
FR0013516549	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(30) 20301124	5,42
FR001400BKZ3	2.000000 % Frankreich EO-OAT 2022(32) 20321124	4,98
ES0000012108	0.000000 % Spanien EO-Obligaciones 2021(28) 20280130	4,97
FR0014002WK3	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(31) 20311124	4,97
ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030	4,73
ES0000012K53	0.800000 % Spanien EO-Bonos 2022(29) 20290729	4,65
DE0001102507	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814	4,64
FR0013451507	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20291124	4,63
ES0000012F76	0.500000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20300429	4,63
IT0005413171	1.650000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20301130	4,49
IT0005383309	1.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(30) 20300331	4,41
DE0001102564	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) 20310814	4,33
IT0005422891	0.900000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(31) 20310331	4,26
IT0005416570	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(27) 20270914	4,20
DE0001102580	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2032) 20320214	4,14
NL0015031501	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(27) 20270114	3,10
BE0000354630	0.350000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2022(32) 20320621	2,83
BE0000357666	3.000000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2023(33) 20330621	2,82
NL00150006U0	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(31) 20310714	2,63
AT0000A2NW83	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(31) 20310219	2,54
NL0014555419	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(30) 20300714	2,52
AT0000A2CQD2	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(30) 20300219	2,43
NL0015000RP1	0.500000 % Niederlande EO-Bonds 2022(32) 20320714	2,42
BE0000352618	0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2021(31) 20311021	2,39

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>32.210.448,44</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		32.086.166,81	99,63
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	3.933.657,88		12,21
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	8.957.323,86		27,81
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	19.195.185,07		59,60
2. Forderungen		119.054,94	0,37
3. Bankguthaben		5.226,69	0,02
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-4.592,99</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>32.205.855,45</b>	<b>100,00</b>

<sup>1)</sup> Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 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									
DE0001102507	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031	EUR		1.753	61	492	% 84,942	1.489.033,26	4,62
DE0001102564	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031	EUR		1.675	58	469	% 82,940	1.389.245,00	4,31
DE0001102580	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesschatzanweisungen 2022/2032	EUR		1.623	56	454	% 81,913	1.329.447,99	4,13
DE000BU2Z007	2,3000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2023/2033	EUR		2.224	2.224	0	% 98,872	2.198.913,28	6,83
							EUR	6.406.639,53	19,89
Ausland									
BE0000352618	0,0000 % Belgien, Königreich - Bons 2021/2031	EUR		974	30	133	% 78,813	767.633,75	2,38
BE0000354630	0,3500 % Belgien, Königreich - Anleihe 2022/2032	EUR		1.139	36	157	% 79,607	906.718,04	2,82
BE0000357666	3,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2023/2033	EUR		912	912	0	% 99,294	905.556,72	2,81
FR0013451507	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2018/2029	EUR		1.766	1.766	0	% 84,134	1.485.806,44	4,61
FR0014002WK3	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2031	EUR		2.012	287	189	% 79,192	1.593.343,04	4,95
FR0013516549	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2030	EUR		2.129	302	200	% 81,684	1.739.052,36	5,40
FR001400BKZ3	2,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2021/2032	EUR		1.728	1.728	0	% 92,524	1.598.814,72	4,96
IT0005422891	0,9000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2031	EUR		1.691	52	231	% 80,900	1.368.021,37	4,25
IT0005416570	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2027	EUR		1.489	1.521	32	% 90,401	1.346.070,89	4,18
IT0005383309	1,3500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2031	EUR		1.643	50	224	% 86,122	1.414.984,46	4,39
IT0005413171	1,6500 % Italien, Republik - Anleihe 2020/2030	EUR		1.668	52	227	% 86,393	1.441.040,08	4,47
NL0015031501	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2027	EUR		1.090	33	148	% 91,132	993.333,35	3,08
NL0014555419	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2030	EUR		971	30	132	% 83,369	809.512,99	2,51
NL00150006U0	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2031	EUR		1.042	32	142	% 81,131	845.385,02	2,62
NL0015000RP1	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2022/2032	EUR		942	29	128	% 82,606	778.148,52	2,42
AT0000A2CQD2	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2020/2030	EUR		943	943	0	% 82,706	779.916,73	2,42
AT0000A2NW83	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2021/2031	EUR		1.018	72	103	% 80,164	816.071,45	2,53
ES0000012K53	0,8000 % Spanien - Anleihe 2022/2029	EUR		1.711	1.711	0	% 87,264	1.493.082,93	4,64
ES0000012G34	1,2500 % Spanien - Anleihe 2020/2030	EUR		1.737	54	237	% 87,380	1.517.793,73	4,71
ES0000012I08	0,0000 % Spanien - Obligaciones 2021/2028	EUR		1.828	1.828	0	% 87,213	1.594.253,64	4,95
ES0000012F76	0,5000 % Spanien - Obligaciones 2020/2030	EUR		1.769	54	240	% 83,945	1.484.987,05	4,61
							EUR	25.679.527,28	79,74
							EUR	32.086.166,81	99,63
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
		EUR		5.226,69			% 100,000	5.226,69	0,02
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche									
		EUR		119.054,94			EUR	119.054,94	0,37
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
		EUR		-4.592,99			EUR	-4.592,99	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
Umlaufende Anteile									
							EUR	32.205.855,45	100,00 <sup>1)</sup>
							EUR	97,66	
							STK	329.786,00	

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.08.2023

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
<b>Inland</b>					
DE0001102473	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029	EUR	54	1.977	
<b>Ausland</b>					
BE0000349580	0,1000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2030	EUR	27	1.001	
FR0013415627	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2025	EUR	0	1.878	
FR0013407236	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2029	EUR	0	2.217	
IT0005365165	3,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2019/2029	EUR	0	1.756	
AT0000A269M8	0,5000 % Österreich, Republik - Anleihe 2019/2029	EUR	0	985	
ES0000012H41	0,1000 % Spanien - Bonos 2021/2031	EUR	52	1.921	
ES0000012K20	0,7000 % Spanien - Bonos 2022/2032	EUR	0	1.781	
ES0000012L52	3,1500 % Spanien - Bonos 2023/2033	EUR	1.713	1.713	

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 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 <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		4.624,70	0,014
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		101.724,93	0,308
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		594,22	0,002
Summe der Erträge		106.943,85	0,324
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-24.432,26	-0,074
Summe der Aufwendungen		-24.432,26	-0,074
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		82.511,59	0,250
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		4.309,49	0,013
2. Realisierte Verluste		-1.458.330,92	-4,422
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.454.021,43	-4,409
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-1.371.509,84	-4,159
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		32.719,31	0,099
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.238.774,74	6,789
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		2.271.494,05	6,888
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		899.984,21	2,729

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023
	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	33.703.541,24
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-25.582,88
2. Zwischenausschüttungen	-46.170,04
3. Mittelzufluss (netto)	-2.350.536,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	974.352,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-3.324.888,00
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	24.618,92
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	899.984,21
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	32.719,31
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	2.238.774,74
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	32.205.855,45

<sup>1)</sup> Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-10 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	97,66
Umlaufende Anteile	STK	329.786,00

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**

**99,63**

**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)

0,04

### 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](http://www.deka-etf.de)

