

Halbjahresbericht
zum 31. August 2023.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign
Diversified 5-7 UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Lizenzvermerk

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

Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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	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 5-7 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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 5-7 (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 5,5 bis 7,5 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 5-7 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	2,9%	-2,7%	-4,9%
ISIN	DE000ETFL144		

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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	DE0001102556	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2028) 20281114
Löschung	NL0015000LS8	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2021(29) 20290114
Löschung	AT0000A2VB47	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(28) 20281019
Löschung	NL0013332430	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2019(29) 20290714
Löschung	IT0005467482	0.450000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(29) 20290214
Löschung	FI4000369467	0.500000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(29) 20290914
Löschung	FR0013407236	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20290524
Löschung	AT0000A269M8	0.500000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290219
Löschung	ES0000012F43	0.600000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20291030
Löschung	FR0013341682	0.750000 % Frankreich EO-OAT 2018(28) 20281124
Löschung	SK4120015173	0.750000 % Slowakei EO-Anl. 2019(30) 20300408
Löschung	DE0001102622	2.100000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2029) 20291114
Löschung	IT0005495731	2.800000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(29) 20290614
Löschung	IT0005365165	3.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(29) 20290731
Löschung	ES0000011868	6.000000 % Spanien EO-Bonos 1999(29) 20290130
Neuaufnahme	DE0001030708	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814
Neuaufnahme	DE0001102507	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814
Neuaufnahme	FI4000441878	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2020(30) 20300914
Neuaufnahme	FR0013516549	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(30) 20301124
Neuaufnahme	IE00BKFVC899	0.200000 % Irland EO-Treasury Bonds 2020(30) 20301017
Neuaufnahme	PTOTEL0E0028	0.475000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30) 20301017
Neuaufnahme	IT0005403396	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20300731
Neuaufnahme	SK4000017059	1.000000 % Slowakei EO-Anl. 2020(30) 20301008
Neuaufnahme	ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030
Neuaufnahme	IT0005413171	1.650000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20301130
Neuaufnahme	DE0001102622	2.100000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2029) 20291114
Neuaufnahme	NL0015001DQ7	2.500000 % Niederlande EO-Bonds 2023(30) 20300114
Neuaufnahme	FR001400HI98	2.750000 % Frankreich EO-OAT 2022(29) 20290224
Neuaufnahme	AT0000A33SH3	2.900000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(29) 20290522
Neuaufnahme	IT0005519787	3.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(29) 20291214
Neuaufnahme	ES0000011868	6.000000 % Spanien EO-Bonos 1999(29) 20290130

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0011883966	2.500000 % Frankreich EO-OAT 2014(30) 20300524	7,29
DE0001102507	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814	6,62
ES0000011868	6.000000 % Spanien EO-Bonos 1999(29) 20290130	6,33
DE0001102622	2.100000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2029) 20291114	5,94
FR0013516549	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(30) 20301124	5,76
DE0001102499	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300214	5,60
IT0005413171	1.650000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20301130	5,48
IT0005383309	1.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(30) 20300331	5,38
IT0005519787	3.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(29) 20291214	4,97
FR0013451507	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20291124	4,93
ES0000012G34	1.250000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20301030	4,57
ES0000012K53	0.800000 % Spanien EO-Bonos 2022(29) 20290729	4,50
ES0000012F76	0.500000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30) 20300429	4,47
IT0005403396	0.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30) 20300731	4,12
NL0014555419	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(30) 20300714	3,49
AT0000A2CQD2	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(30) 20300219	3,36
BE0000349580	0.100000 % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2020(30) 20300621	3,15
PTOTELOE0028	0.475000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30) 20301017	2,81
NL0015001DQ7	2.500000 % Niederlande EO-Bonds 2023(30) 20300114	2,29
FR001400HI98	2.750000 % Frankreich EO-OAT 2022(29) 20290224	2,08
IE00BKFVC899	0.200000 % Irland EO-Treasury Bonds 2020(30) 20301017	2,01
DE0001030708	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) 20300814	1,88
FI4000441878	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2020(30) 20300914	1,32
AT0000A33SH3	2.900000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(29) 20290522	0,89
SK4000017059	1.000000 % Slowakei EO-Anl. 2020(30) 20301008	0,75

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		83.374.412,11	100,01
1. Anleihen		82.818.659,77	99,35
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	64.014.876,90		76,79
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	18.803.782,87		22,56
2. Forderungen		520.736,91	0,62
3. Bankguthaben		35.015,43	0,04
II. Verbindlichkeiten		-11.899,83	-0,01
III. Fondsvermögen		83.362.512,28	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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									
DE0001102499	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2030		EUR	5.396	3.249	2.183	% 85,887	4.634.462,52	5,56
DE0001030708	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2030		EUR	1.831	1.831	0	% 85,050	1.557.269,89	1,87
DE0001102507	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2031		EUR	6.456	7.355	899	% 84,942	5.483.855,52	6,58
DE0001102622	2,1000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2022/2029		EUR	5.011	5.338	1.564	% 98,102	4.915.891,22	5,90
							EUR	16.591.479,15	19,90
Ausland									
BE0000349580	0,1000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2030		EUR	3.145	1.753	729	% 83,063	2.612.315,63	3,13
FI4000441878	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2020/2030		EUR	1.345	1.571	226	% 81,535	1.096.648,04	1,32
FR0013451507	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2018/2029		EUR	4.849	3.230	1.268	% 84,134	4.079.657,66	4,89
FR0013516549	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2030		EUR	5.844	5.844	0	% 81,684	4.773.612,96	5,73
FR0011883966	2,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2013/2030		EUR	6.151	4.093	1.608	% 98,097	6.033.946,47	7,24
FR001400H198	2,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2023/2029		EUR	1.731	1.815	84	% 99,503	1.722.397,10	2,07
IE00BKFCV899	0,2000 % Irland - Treasury Bonds 2020/2030		EUR	1.997	2.332	335	% 83,196	1.661.424,12	1,99
IT0005403396	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2030		EUR	4.117	5.166	1.049	% 82,935	3.414.422,01	4,10
IT0005383309	1,3500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2031		EUR	5.177	2.908	1.688	% 86,122	4.458.535,94	5,35
IT0005413171	1,6500 % Italien, Republik - Anleihe 2020/2030		EUR	5.253	5.253	0	% 86,393	4.538.239,52	5,44
IT0005519787	3,8500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2022/2029		EUR	4.097	5.141	1.044	% 100,550	4.119.533,50	4,94
NL0014555419	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2030		EUR	3.466	1.930	802	% 83,369	2.889.569,54	3,47
NL0015001DQ7	2,5000 % Niederlande - Registered Bonds 2023/2030		EUR	1.926	2.139	213	% 98,645	1.899.902,70	2,28
AT0000A2CQD2	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2020/2030		EUR	3.366	2.030	718	% 82,706	2.783.880,93	3,34
AT0000A33SH3	2,9000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	741	866	125	% 99,923	740.431,28	0,89
PTOTELOE0028	0,4750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2020/2030		EUR	2.771	3.237	466	% 83,934	2.325.811,14	2,79
SK4000017059	1,0000 % Slowakei - Anleihe 2020/2030		EUR	741	866	125	% 83,804	620.990,09	0,74
ES0000012K53	0,8000 % Spanien - Anleihe 2022/2029		EUR	4.268	4.088	1.844	% 87,264	3.724.417,28	4,47
ES0000012G34	1,2500 % Spanien - Anleihe 2020/2030		EUR	4.334	4.334	0	% 87,380	3.787.057,00	4,54
ES0000011868	6,0000 % Spanien - Bonos 1999/2029		EUR	4.601	5.656	5.044	% 113,886	5.239.894,86	6,29
ES0000012F76	0,5000 % Spanien - Obligaciones 2020/2030		EUR	4.413	3.907	3.320	% 83,945	3.704.492,85	4,44
							EUR	66.227.180,62	79,44
							EUR	82.818.659,77	99,35
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
			EUR	35.015,43			% 100,000	35.015,43	0,04
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche									
			EUR	520.736,91			EUR	520.736,91	0,62
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
			EUR	-11.899,83			EUR	-11.899,83	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
Umlaufende Anteile									
							EUR	83.362.512,28	100,00 ¹⁾
							EUR	98,08	
							STK	849.905,00	

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Inland					
DE0001102473	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029	EUR	2.546	7.108	
DE0001102556	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Anleihe 2021/2028	EUR	2.332	6.507	
Ausland					
FI4000369467	0,5000 % Finnland, Republik - Anleihe 2019/2029	EUR	276	1.321	
FR0013407236	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2018/2029	EUR	947	4.530	
FR0013341682	0,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2028	EUR	3.727	7.342	
IT0005495731	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2022/2029	EUR	2.056	4.854	
IT0005467482	0,4500 % Italien, Republik - Anleihe 2021/2029	EUR	711	3.401	
IT0005365165	3,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2019/2029	EUR	1.011	4.836	
NL0015000LS8	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2021/2029	EUR	1.731	3.826	
NL0013332430	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2019/2029	EUR	537	2.571	
AT0000A2VB47	0,0000 % Österreich, Republik - Anleihe 2022/2028	EUR	297	1.418	
AT0000A269M8	0,5000 % Österreich, Republik - Anleihe 2019/2029	EUR	567	2.712	
SK4120015173	0,7500 % Slowakei - Anleihe 2019/2030	EUR	132	632	
ES0000012F43	0,6000 % Spanien - Anleihe 2019/2029	EUR	3.475	6.877	

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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		15.349,37	0,018
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		455.485,66	0,536
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		3.036,84	0,004
Summe der Erträge		473.871,87	0,558
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-63.320,65	-0,075
2. Sonstige Aufwendungen		-0,02	0,000
Summe der Aufwendungen		-63.320,67	-0,075
III. Ordentlicher Nettoertrag		410.551,20	0,483
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		74.520,32	0,088
2. Realisierte Verluste		-2.062.333,79	-2,427
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.987.813,47	-2,339
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.577.262,27	-1,856
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		249.609,54	0,294
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.998.256,03	3,528
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		3.247.865,57	3,821
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.670.603,30	1,966
Entwicklung des Sondervermögens		2022 / 2023	
	EUR	EUR	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		61.570.034,04	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-158.110,05	
2. Zwischenausschüttungen		-229.474,35	
3. Mittelzufluss (netto)		20.285.194,00	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	39.688.433,00		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-19.403.239,00		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		224.265,34	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.670.603,30	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	249.609,54		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	2.998.256,03		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		83.362.512,28	

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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	98,08
Umlaufende Anteile	STK	849.905,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,35

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)

0,07

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

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

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

