

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2023.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 1-3 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 Deko 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 1-3 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 1-3 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 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 1-3 (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 3,5 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 1-3 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
<b>Performance *</b>	1,7%	-1,1%	-2,0%
<b>ISIN</b>	DE000ETFL128		

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	DE0001141802	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24) 20241017
Löschung	FI4000391529	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2019(24) 20240914
Löschung	FR0013415627	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2019(25) 20250324
Löschung	IT0005454241	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(26) 20260731
Löschung	BE0000337460	1.000000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(26) Ser. 77 20260621
Löschung	IT0005370306	2.100000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(26) 20260714
Neuaufnahme	DE0001141844	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.184 v.2021(26) 20261008
Neuaufnahme	FI4000511449	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2021(26) 20260914
Neuaufnahme	IT0005454241	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(26) 20260731
Neuaufnahme	NL0015031501	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(27) 20270114
Neuaufnahme	IT0005390874	0.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(27) 20270114
Neuaufnahme	FR001400FYQ4	2.500000 % Frankreich EO-OAT 2023(26) 20260923

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
FR0013131877	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2016(26) 20260524	6,39
FR0013508470	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(26) 20260224	5,66
DE0001141836	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.183 v.2021(26) 20260409	5,44
DE0001141828	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.182 v.2020(25) 20251009	5,40
BE0000334434	0.800000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(25) Ser. 74 20250621	5,07
ES0000012F92	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(25) 20250130	4,77
DE0001141844	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.184 v.2021(26) 20261008	4,62
ES0000012G91	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2020(26) 20260130	4,61
DE0001141810	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.181 v.2020(25) 20250410	4,57
ES0000012L29	2.800000 % Spanien EO-Bonos 2023(26) 20260530	4,56
ES0000012K38	0.000000 % Spanien EO-Bonos 2022(25) 20250530	4,51
IT0005437147	0.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(26) 20260331	4,44
NL0011220108	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2015(25) 20250714	4,43
IT0005386245	0.350000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(25) 20250131	4,29
IT0005419848	0.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(26) 20260131	4,26
IT0005390874	0.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(27) 20270114	4,25
NL0011819040	0.500000 % Niederlande EO-Anl. 2016(26) 20260714	4,15
FR0014007TY9	0.000000 % Frankreich EO-OAT 2021(25) 20250224	4,07
FR001400FYQ4	2.500000 % Frankreich EO-OAT 2023(26) 20260923	3,83
NL0015031501	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(27) 20270114	3,36
NL0015000QL2	0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2022(26) 20260114	2,69
AT0000A2QRWO	0.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(25) 20250419	2,01
AT0000A308C5	2.000000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(26) 20260714	1,11
FI4000511449	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2021(26) 20260914	0,85
SK4000017158	0.250000 % Slowakei EO-Anl. 2020(25) 20250513	0,66

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>66.523.779,41</b>	<b>100,01</b>
1. Anleihen		65.564.443,27	98,57
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	54.479.493,78		81,91
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	11.084.949,49		16,67
2. Forderungen		105.598,79	0,16
3. Bankguthaben		853.737,35	1,28
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-9.538,32</b>	<b>-0,01</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>66.514.241,09</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 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										
DE000141828	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2025	EUR		3.764	1.019	4.111	% 94,124	3.542.827,36	5,33	
DE000141836	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2021/2026	EUR		3.832	968	4.380	% 93,129	3.568.703,28	5,37	
DE000141810	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2020/2025	EUR		3.148	795	3.598	% 95,261	2.998.816,28	4,51	
DE000141844	0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik - Bundesobligationen 2021/2026	EUR		3.285	4.400	1.115	% 92,119	3.026.109,15	4,55	
							EUR	13.136.456,07	19,75	
Ausland										
BE0000334434	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2015/2025	EUR		3.462	908	4.422	% 95,998	3.323.459,42	5,00	
FI4000511449	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2021/2026	EUR		612	848	236	% 91,519	560.093,22	0,84	
FR0013508470	0,0000 % Frankreich - Anleihe 2020/2026	EUR		3.989	2.035	4.759	% 92,983	3.709.091,87	5,58	
FR0014007TY9	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2021/2025	EUR		2.796	1.427	3.337	% 95,412	2.667.719,52	4,01	
FR0013131877	0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026	EUR		4.472	2.282	5.336	% 93,635	4.187.357,20	6,30	
FR001400FYQ4	2,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2022/2026	EUR		2.543	2.971	428	% 98,651	2.508.694,93	3,77	
IT0005437147	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2026	EUR		3.188	835	4.070	% 91,417	2.914.361,53	4,38	
IT0005386245	0,3500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2025	EUR		2.946	772	3.761	% 95,570	2.815.484,84	4,23	
IT0005419848	0,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2020/2026	EUR		2.997	785	3.826	% 93,091	2.789.944,76	4,19	
IT0005390874	0,8500 % Italien, Republik - Buoni Ordin. d. Tesoro 2019/2027	EUR		3.042	3.042	0	% 91,661	2.788.315,15	4,19	
NL0015031501	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2020/2027	EUR		2.416	2.416	0	% 91,132	2.201.737,04	3,31	
NL0015000QL2	0,0000 % Niederlande - Anleihe 2022/2026	EUR		1.887	495	2.411	% 93,336	1.761.252,40	2,65	
NL0011220108	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2015/2025	EUR		3.054	800	3.900	% 95,054	2.902.949,16	4,36	
NL0011819040	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2016/2026	EUR		2.907	761	3.711	% 93,635	2.721.969,45	4,09	
AT0000A2QRW0	0,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2021/2025	EUR		1.388	362	1.709	% 94,862	1.316.682,20	1,98	
AT0000A308C5	2,0000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2022/2026	EUR		749	330	804	% 97,335	729.041,02	1,10	
SK4000017158	0,2500 % Slowakei - Anleihe 2020/2025	EUR		460	154	528	% 94,556	434.957,60	0,65	
ES0000012F92	0,0000 % Spanien - Anleihe 2020/2025	EUR		3.278	860	4.186	% 95,371	3.126.261,38	4,70	
ES0000012G91	0,0000 % Spanien - Anleihe 2020/2026	EUR		3.265	856	4.169	% 92,571	3.022.426,83	4,54	
ES0000012K38	0,0000 % Spanien - Anleihe 2022/2025	EUR		3.132	914	3.508	% 94,412	2.956.983,84	4,45	
ES0000012L29	2,8000 % Spanien - Bonos 2023/2026	EUR		3.026	3.083	942	% 98,784	2.989.203,84	4,49	
							EUR	52.427.987,20	78,82	
							EUR	65.564.443,27	98,57	
Summe Wertpapiervermögen										
Bankguthaben, nicht verbrieftete Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	853.737,35	1,28
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle			EUR	853.737,35			% 100,000	853.737,35	1,28	
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	105.598,79	0,16
Zinsansprüche			EUR	105.598,79				105.598,79	0,16	
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-9.538,32	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-9.538,32				-9.538,32	-0,01	
Fondsvermögen								EUR	66.514.241,09	100,00 <sup>1)</sup>
Anteilwert								EUR	89,86	
Umlaufende Anteile								STK	740.160,00	

<sup>1)</sup> 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 1-3 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>					
DE0001141802	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Bundesobligationen 2019/2024	EUR	127	5.948	
<b>Ausland</b>					
BE0000337460	1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2026	EUR	674	5.848	
FI4000391529	0,0000 % Finnland, Republik - Anleihe 2019/2024	EUR	27	1.267	
FR0013415627	0,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2019/2025	EUR	153	7.194	
IT0005454241	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2026	EUR	3.936	3.936	
IT0005370306	2,1000 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2026	EUR	119	5.612	

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 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 ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		131.988,18	0,178
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		13.051,56	0,018
Summe der Erträge		145.039,74	0,196
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-55.885,48	-0,076
Summe der Aufwendungen		-55.885,48	-0,076
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		89.154,26	0,120
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		81.085,05	0,110
2. Realisierte Verluste		-1.952.300,52	-2,638
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.871.215,47	-2,528
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		-1.782.061,21	-2,408
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		183.780,29	0,248
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		3.689.728,03	4,985
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		3.873.508,32	5,233
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		2.091.447,11	2,826

Entwicklung des Sondervermögens

	2022 / 2023
	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	122.096.237,36
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-68.229,60
2. Zwischenausschüttungen	-44.858,00
3. Mittelzufluss (netto)	-57.180.011,40
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	16.480.263,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-73.660.274,40
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-380.344,38
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	2.091.447,11
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	183.780,29
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	3.689.728,03
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	66.514.241,09

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 1-3 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	89,86
Umlaufende Anteile	STK	740.160,00

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

**98,57**

**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)

