

Halbjahresbericht
zum 31. August 2023.

**Deka iBoxx MSCI ESG EUR
Corporates Green Bond 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 Fonds Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF, auf den an dieser Stelle Bezug genommen wird, wird von MSCI ESG Research LLC oder mit ihr verbundenen Unternehmen ("MSCI") weder gefördert, unterstützt noch beworben. MSCI übernimmt keine Haftung für diesen Fonds. Die Verwendung der Marken MSCI und MSCI ESG Research unterliegt der Lizenz von MSCI. Eine andere Verwendung der Marken ist ohne Lizenz von MSCI nicht gestattet. 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 MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF für den Zeitraum vom 2. August 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	9
Vermögensaufstellung zum 31. August 2023	10
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

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 MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für den Fonds vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond Select Index (Preisindex) nachzubilden.

Bei der Zusammensetzung des Indexuniversums werden Nachhaltigkeitskriterien berücksichtigt.

Der Index besteht aus Green Bonds, die von der Climate Bonds Initiative (CBI) als solche klassifiziert wurden.

Wichtige Kennzahlen

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF

	02.08.2023- 31.08.2023
Performance *	-0,1%
ISIN	DE000ETFL615

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

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF

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

Im Berichtszeitraum hat der Emittent keine Veränderungen der Indexzusammensetzung mitgeteilt.

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS2483607474	2.125000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(25/26) 20260524	2,25
XS2459544339	1.875000 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290920	1,75
XS2536941656	4.250000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(30) 20300220	1,63
XS2592650373	5.000000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 23(27/28) 20280307	1,56
DE000DL19WL7	1.875000 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.22(27/28) 20280222	1,55
XS2528858033	4.067000 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28) 20280905	1,53
XS2534985523	3.125000 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(26/27) 20270920	1,51
XS2637421848	4.750000 % Danske Bank AS EO-FLR Med.-Term Nts 23(29/30) 20300620	1,50
XS2573569576	4.125000 % Danske Bank AS EO-FLR Preferred MTN 23(30/31) 20310109	1,48
XS2237434803	3.250000 % Unipol Gruppo S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(30/30) 20300922	1,48
XS2576550672	4.375000 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/31) 20310117	1,46
XS2443893255	1.125000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2022(27) 20270215	1,42
XS2555187801	5.375000 % Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(29/30) 20301113	1,42
XS2643041721	4.125000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 2023(27) 20270628	1,40
XS2343563214	0.300000 % Swedbank AB EO-Non-Pref. FLR MTN 21(26/27) 20270519	1,39
XS2553798443	4.000000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26) 20261108	1,39
XS2530034649	3.750000 % Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(29) 20290906	1,36
FR0014006NI7	0.500000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(27/28) 20280529	1,35
FR0013536661	0.875000 % Société Générale S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(27/28) 20280921	1,35
XS2531569965	3.250000 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310912	1,33
XS2455983861	1.375000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320310	1,33
XS2357417257	0.625000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) 20290623	1,32
XS2648498371	3.625000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330712	1,31
XS2625196352	4.875000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30) 20300518	1,30
XS2575971994	4.000000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280115	1,29
XS2652069480	4.500000 % DNB Bank ASA EO-FLR Med.-Term Nts 23(27/28) 20280718	1,25
XS2597696124	4.000000 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 23(28/29) 20290313	1,24
XS2442768227	0.750000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) 20270808	1,22
XS2555925218	5.750000 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(28/29) 20290215	1,22
XS2643234011	5.000000 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2023(30/31) 20310703	1,19
XS2576362839	4.875000 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2023(27/28) 20280715	1,19
FR0014001EQ0	4.875000 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(28/28) 20280613	1,18
PTEDPUOM0008	3.875000 % EDP - Energias de Portugal SA EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280625	1,17
XS2572496623	4.250000 % Swedbank AB EO-Non-Preferred MTN 2023(28) 20280710	1,17
XS2575973776	3.875000 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2023(23/29) 20290115	1,16
XS2297549391	0.500000 % Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) 20290208	1,15
AT0000A32562	4.000000 % Erste Group Bank AG EO-FLR Pref. MTN 2023(30/31) 20310115	1,15
XS2491963638	3.625000 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(25/26) 20260703	1,15
XS2558966953	3.375000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20321121	1,15
XS2601458602	4.000000 % Siemens Energy Finance B.V. EO-Notes 2023(23/26) 20260404	1,14
DE000A30VQB2	5.000000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/30) 20301122	1,14
XS2527319979	3.279000 % Eurogrid GmbH MTN v.2022(2022/2031) 20310904	1,13
XS2601459162	4.250000 % Siemens Energy Finance B.V. EO-Notes 2023(23/29) 20290404	1,13
XS2280835260	0.625000 % Digital Intrepid Holding B.V. EO-Bonds 2021(21/31) Reg.S 20310714	1,12
XS2317069685	0.750000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(28) 20280315	1,11
XS2381853279	0.250000 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2021(21/28) 20280831	1,11

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS2591026856	3.625000 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26) 20260228	1,09
XS2579284469	3.875000 % ACEA S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310123	1,07
BE0002832138	0.250000 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27) 20270228	1,06
XS2490472102	2.875000 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/33) 20330613	1,06
XS2389343380	0.500000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-T. Nts 2021(29) 20290922	1,05
XS2311407352	0.375000 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27) 20270509	1,05
FR00140005J1	0.375000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(26/27) 20271013	1,04
XS2343340852	0.500000 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2021(26/27) 20271116	1,03
XS2443438051	1.375000 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27) 20270216	1,03
FR0014007LL3	0.500000 % BPCE S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(27/28) 20280113	1,02
XS2463518998	1.625000 % E.ON SE Medium Term Notes v.22(30/31) 20310328	1,02
XS2384734542	0.250000 % NIBC Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26) 20260908	1,01
FR00140003P3	0.100000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2020(27) 20271007	1,00
XS2655852726	3.875000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330723	1,00
DE000A3MQS72	2.375000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/32) 20320324	0,99
FR0014004750	0.250000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2021(28) 20280628	0,99
XS2576550326	4.000000 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/27) 20270417	0,97
XS2257961818	0.125000 % UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) 20281118	0,96
XS2510903862	2.875000 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290731	0,96
XS2455401328	1.250000 % SEGRO Capital S.a r.l. EO-Notes 2022(22/26) 20260322	0,94
XS2327420977	0.600000 % E.ON SE Medium Term Notes v.21(32/32) 20320930	0,89
XS2232115423	1.000000 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/32) 20320114	0,84
XS2229434852	0.500000 % ERG S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/27) 20270910	0,82
DE000NLB4RS5	4.875000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-Inh.Schv.v.23(28) 20280710	0,80
XS2554997937	4.750000 % Covestro AG EO-MTN v.2022(2022/2028) 20281114	0,80
XS2555918270	5.500000 % Jyske Bank A/S EO-Non-Prefer. MTN 2022(26/27) 20271115	0,80
XS2592240712	4.875000 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2023(29/30) 20300306	0,79
XS2599779597	4.250000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330315	0,79
XS2598649254	3.875000 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290315	0,78
XS2626691906	4.625000 % De Volksbank N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(27/27) 20271122	0,78
XS2629062568	4.000000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/26) 20260531	0,77
XS2596537972	3.500000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2023(23/28) 20280403	0,77
XS2560411543	3.625000 % Achmea B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20251128	0,77
XS2357205587	0.375000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) 20290622	0,77
XS2635647154	3.250000 % Alliander N.V. EO-Med.-T. Nts 2023(23/28) 20280612	0,77
XS2629064267	4.250000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290831	0,77
BE6340849569	3.625000 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33) 20330117	0,77
XS2610209129	3.750000 % Acciona Energia Fin. Fil. SA EO-Med.-Term Notes 2023(23/30) 20300424	0,76
XS2438026440	0.875000 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2022(22/28) 20280130	0,75
XS2292487076	0.250000 % ACEA S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/30) 20300727	0,73
XS2343540519	0.500000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33) 20330523	0,72
FR0014001IM0	0.625000 % Icade S.A. EO-Obl. 2021(21/31) 20310117	0,69
BE6327721237	1.500000 % VGP N.V. EO-Bonds 2021(21/29) 20290407	0,69
DE000A3E5FR9	0.625000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/31) 20310323	0,68

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		24.992.121,80	100,02
1. Anleihen		24.535.810,57	98,20
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	2.027.867,30		8,12
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	9.094.574,91		36,40
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	6.796.854,08		27,20
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	6.616.514,28		26,48
2. Forderungen		357.352,49	1,43
3. Bankguthaben		98.958,74	0,40
II. Verbindlichkeiten		-5.628,41	-0,02
III. Fondsvermögen		24.986.493,39	100,00

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

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond 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									
XS2554997937	4,7500 % Covestro AG - Medium Term Notes 2022/2028	EUR	200	200	200	0	% 102,957	205.913,26	0,82
DE000DL19WL7	1,8750 % Deutsche Bank AG - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	400	400	400	0	% 89,679	358.714,36	1,44
XS2327420977	0,6000 % E.ON SE - Medium Term Notes 2021/2032	EUR	286	286	286	0	% 76,392	218.482,15	0,87
XS2463518998	1,6250 % E.ON SE - Medium Term Notes 2022/2031	EUR	286	286	286	0	% 86,961	248.707,20	1,00
XS2527319979	3,2790 % Eurogrid GmbH - Medium Term Notes 2022/2031	EUR	300	300	300	0	% 96,493	289.478,70	1,16
DE000NLB4RS5	4,8750 % Norddeutsche Landesbank -GZ- - Medium Term IHS 2023/2028	EUR	191	191	191	0	% 103,203	197.116,93	0,79
DE000A3E5FR9	0,6250 % Vonovia SE - Medium Term Notes 2021/2031	EUR	200	200	200	0	% 72,241	144.481,44	0,58
DE000A3MQS72	2,3750 % Vonovia SE - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	300	300	300	0	% 81,096	243.286,53	0,97
DE000A30VQB2	5,0000 % Vonovia SE - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	300	300	300	0	% 97,795	293.386,41	1,17
							EUR	2.199.566,98	8,80
Ausland									
XS2389343380	0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2021/2029	EUR	300	300	300	0	% 80,372	241.116,60	0,96
XS2575971994	4,0000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	300	300	300	0	% 98,644	295.932,36	1,18
XS2536941656	4,2500 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	400	400	400	0	% 99,143	396.570,08	1,59
XS2610209129	3,7500 % Acciona Energia Fin. Fil. SA - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	200	200	200	0	% 97,880	195.759,32	0,78
XS2292487076	0,2500 % ACEA S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2030	EUR	229	229	229	0	% 78,123	178.902,56	0,72
XS2579284469	3,8750 % ACEA S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2031	EUR	267	267	267	0	% 98,176	262.130,99	1,05
XS2560411543	3,6250 % Achmea B.V. - Medium Term Notes 2022/2025	EUR	191	191	191	0	% 99,148	189.373,39	0,76
XS2596537972	3,5000 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. - Senior Notes 2023/2028	EUR	191	191	191	0	% 99,341	189.740,60	0,76
XS2343340852	0,5000 % AIB Group PLC - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	286	286	286	0	% 88,447	252.957,96	1,01
XS2491963638	3,6250 % AIB Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2026	EUR	286	286	286	0	% 98,360	281.309,63	1,13
XS2555925218	5,7500 % AIB Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2029	EUR	286	286	286	0	% 104,082	297.673,63	1,19
XS2635647154	3,2500 % Alliander N.V. - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	191	191	191	0	% 98,997	189.085,00	0,76
XS2357417257	0,6250 % Banco Santander S.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2029	EUR	400	400	400	0	% 84,447	337.786,32	1,35
XS2311407352	0,3750 % Bank of Ireland Group PLC - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	286	286	286	0	% 89,765	256.727,50	1,03
XS2576362839	4,8750 % Bank of Ireland Group PLC - Floating Rate Medium Term 2023/2028	EUR	286	286	286	0	% 101,485	290.247,21	1,16
XS2643234011	5,0000 % Bank of Ireland Group PLC - Floating Rate Medium Term 2023/2031	EUR	286	286	286	0	% 101,591	290.549,83	1,16
FR00140005J1	0,3750 % BNP Paribas S.A. - Floating Rate Medium Term 2020/2027	EUR	300	300	300	0	% 88,898	266.695,38	1,07
FR0014006NI7	0,5000 % BNP Paribas S.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2028	EUR	400	400	400	0	% 86,963	347.853,60	1,39
FR0014007LL3	0,5000 % BPCE S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	300	300	300	0	% 87,531	262.591,77	1,05
FR0014004750	0,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Anleihe 1900/1900	EUR	300	300	300	0	% 84,598	253.795,32	1,02
FR00140003P3	0,1000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	300	300	300	0	% 85,979	257.938,14	1,03
XS2297549391	0,5000 % Caixabank S.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2029	EUR	300	300	300	0	% 83,811	251.433,24	1,01
XS2530034649	3,7500 % Caixabank S.A. - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	300	300	300	0	% 98,864	296.591,34	1,19
XS2555187801	5,3750 % Caixabank S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2030	EUR	300	300	300	0	% 103,016	309.049,23	1,24
XS2443438051	1,3750 % Danske Bank AS - Floating Rate Medium Term 2022/2027	EUR	272	272	272	0	% 92,752	252.284,60	1,01
XS2573569576	4,1250 % Danske Bank AS - Floating Rate Medium Term 2023/2031	EUR	363	363	363	0	% 99,974	362.906,96	1,45
XS2637421848	4,7500 % Danske Bank AS - Floating Rate Medium Term 2023/2030	EUR	363	363	363	0	% 100,913	366.314,23	1,47
XS2626691906	4,6250 % De Volksbank N.V. - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	200	200	200	0	% 99,875	199.749,16	0,80

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond 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
XS2592240712	4,8750 % De Volksbank N.V. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	200	200	200	0	% 100,966	201.931,70	0,81
XS2232115423	1,0000 % Digital Dutch Finco B.V. - Guaranteed Registered Notes 2020/2032	EUR	286	286	286	0	% 72,276	206.710,13	0,83
XS2280835260	0,6250 % Digital Intrepid Holding B.V. - Guaranteed Registered Notes 2021/2031	EUR	381	381	381	0	% 72,146	274.876,98	1,10
XS2534985523	3,1250 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2022/2027	EUR	378	378	378	0	% 97,524	368.641,21	1,48
XS2597696124	4,0000 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2023/2029	EUR	303	303	303	0	% 100,458	304.386,35	1,22
XS2652069480	4,5000 % DNB Bank ASA - Floating Rate Medium Term 2023/2028	EUR	303	303	303	0	% 101,027	306.112,11	1,23
PTEDPUOM0008	3,8750 % EDP - Energias de Portugal SA - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	300	300	300	0	% 100,249	300.745,74	1,20
XS2459544339	1,8750 % EDP Finance B.V. - Anleihe 2022/2029	EUR	500	500	500	0	% 89,846	449.232,35	1,80
BE6340849569	3,6250 % Elia Transm. Belgium N.V. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	200	200	200	0	% 98,405	196.809,76	0,79
XS2229434852	0,5000 % ERG S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	229	229	229	0	% 87,391	200.124,25	0,80
AT0000A32562	4,0000 % Erste Group Bank AG - Floating Rate Medium Term 2023/2031	EUR	300	300	300	0	% 98,711	296.134,17	1,19
XS2455983861	1,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	400	400	400	0	% 85,458	341.831,44	1,37
XS2558966953	3,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	300	300	300	0	% 98,072	294.217,11	1,18
XS2648498371	3,6250 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	300	300	300	0	% 99,191	297.572,07	1,19
FR0014001M0	0,6250 % Icade S.A. - Anleihe 2021/2031	EUR	200	200	200	0	% 73,811	147.622,08	0,59
XS2483607474	2,1250 % ING Groep N.V. - Anleihe 2022/2026	EUR	600	600	600	0	% 96,309	577.851,24	2,31
XS2317069685	0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	317	317	317	0	% 86,074	272.855,75	1,09
XS2625196352	4,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	317	317	317	0	% 100,782	319.479,83	1,28
XS2592650373	5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Floating Rate Medium Term 2023/2028	EUR	380	380	380	0	% 100,342	381.298,42	1,53
XS2555918270	5,5000 % Jyske Bank A/S - Medium Term Notes 2022/1900	EUR	191	191	191	0	% 102,236	195.270,40	0,78
BE0002832138	0,2500 % KBC Groep N.V. - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	300	300	300	0	% 90,957	272.869,77	1,09
XS2381853279	0,2500 % National Grid PLC - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	324	324	324	0	% 83,596	270.850,62	1,08
XS2575973776	3,8750 % National Grid PLC - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	286	286	286	0	% 99,317	284.046,53	1,14
XS2528858033	4,0670 % NatWest Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	381	381	381	0	% 98,222	374.226,39	1,50
XS2598649254	3,8750 % Neste Oyj - Medium Term Notes 2023/2029	EUR	191	191	191	0	% 99,993	190.986,48	0,76
XS2599779597	4,2500 % Neste Oyj - Medium Term Notes 2023/2033	EUR	191	191	191	0	% 100,947	192.809,13	0,77
XS2384734542	0,2500 % NIBC Bank N.V. - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	300	300	300	0	% 86,622	259.864,65	1,04
XS2443893255	1,1250 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2022/2027	EUR	381	381	381	0	% 91,409	348.267,87	1,39
XS2490472102	2,8750 % Orsted A/S - Medium Term Notes 2022/2033	EUR	286	286	286	0	% 90,704	259.412,75	1,04
XS2531569965	3,2500 % Orsted A/S - Medium Term Notes 2022/2031	EUR	343	343	343	0	% 94,955	325.695,34	1,30
XS2591026856	3,6250 % Orsted A/S - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	267	267	267	0	% 99,567	265.843,81	1,06
FR001400IEQ0	4,8750 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	286	286	286	0	% 100,900	288.574,72	1,15
XS2343540519	0,5000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. - Medium Term Notes 2021/2033	EUR	200	200	200	0	% 77,523	155.046,26	0,62
XS2455401328	1,2500 % SEGRO Capital Sa r.l. - Guaranteed Registered Notes 2022/2026	EUR	248	248	248	0	% 92,626	229.712,06	0,92
XS2601458602	4,0000 % Siemens Energy Finance B.V. - Guaranteed Notes 2023/2026	EUR	300	300	300	0	% 97,944	293.833,29	1,18
XS2601459162	4,2500 % Siemens Energy Finance B.V. - Guaranteed Notes 2023/2029	EUR	300	300	300	0	% 96,487	289.461,36	1,16
XS2442768227	0,7500 % Skandinaviska Enskilda Banken AB - Anleihe 2022/2027	EUR	340	340	340	0	% 88,045	299.351,71	1,20
XS2553798443	4,0000 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2022/2026	EUR	340	340	340	0	% 99,657	338.835,16	1,36
XS2643041721	4,1250 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	340	340	340	0	% 100,943	343.205,96	1,37
FR0013536661	0,8750 % Société Générale S.A. - Floating Rate Medium Term 2020/2028	EUR	400	400	400	0	% 86,781	347.122,20	1,39

Deka iBoxx MSCI ESG EUR Corporates Green Bond 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
XS2510903862	2,8750 % SSE PLC - Medium Term Notes 2022/2029		EUR	248	248	0	% 95,070	235.772,73	0,94
XS2629062568	4,0000 % Stora Enso Oyj - Medium Term Notes 2023/2026		EUR	191	191	0	% 99,447	189.943,88	0,76
XS2629064267	4,2500 % Stora Enso Oyj - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	191	191	0	% 98,882	188.864,94	0,76
XS2343563214	0,3000 % Swedbank AB - Floating Rate Medium Term 2021/2021		EUR	381	381	0	% 89,544	341.163,86	1,37
XS2572496623	4,2500 % Swedbank AB - Medium-Term Notes 2023/2028		EUR	286	286	0	% 100,074	286.210,72	1,15
XS2357205587	0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	229	229	0	% 82,572	189.089,67	0,76
XS2655852726	3,8750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	248	248	0	% 99,163	245.923,25	0,98
XS2438026440	0,8750 % Thames Water Utilities Fin.PLC - Anleihe 2022/2028		EUR	219	219	0	% 83,656	183.207,49	0,73
XS2576550326	4,0000 % Thames Water Utilities Fin.PLC - Medium Term Notes 2023/2027		EUR	248	248	0	% 95,381	236.545,23	0,95
XS2576550672	4,3750 % Thames Water Utilities Fin.PLC - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	381	381	0	% 93,764	357.240,46	1,43
XS2237434803	3,2500 % Unipol Gruppo S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2030		EUR	381	381	0	% 95,054	362.153,91	1,45
XS2257961818	0,1250 % UPM Kymmene Corp. - Medium Term Notes 2020/2028		EUR	286	286	0	% 82,457	235.827,59	0,94
BE6327721237	1,5000 % VGP N.V. - Bonds 2021/2029		EUR	200	200	0	% 73,757	147.514,76	0,59
	Summe Wertpapiervermögen						EUR	22.336.243,59	89,39
	Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	98.958,74	0,40
	EUR-Guthaben bei:								
	Verwahrstelle		EUR	98.958,74			% 100,000	98.958,74	0,40
	Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	357.352,49	1,43
	Zinsansprüche		EUR	357.352,49				357.352,49	1,43
	Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-5.628,41	-0,02
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-5.628,41				-5.628,41	-0,02
	Fondsvermögen						EUR	24.986.493,39	100,00 ¹⁾
	Anteilwert						EUR	99,95	
	Umlaufende Anteile						STK	250.000,00	

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 MSCI ESG EUR Corporates Green Bond 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	99,95
Umlaufende Anteile	STK	250.000,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,20

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)

0,44

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

