

Halbjahresbericht
zum 31. August 2019.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign
Diversified 7-10 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 2019

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2019 bis zum 31. August 2019.

In den vergangenen sechs Monaten prägten wiederholt sowohl die geldpolitischen Entscheidungsträger als auch die Akteure im Handelskonflikt der USA mit China die Kapitalmärkte. Insgesamt zeigten die Aktienbörsen eine erstaunliche Widerstandskraft gegen exogene Erschütterungen; bei den Marktteilnehmern zeigte sich jedoch eine gestiegene Risikoaversion und eine höhere Nachfrage nach sicheren Anlagemöglichkeiten.

Das unverändert niedrige bzw. sinkende Zinsniveau äußerte sich bei einer positiven Marktentwicklung in merklich nachgebenden Renditen. Mittlerweile bewegen sich deutsche Bundesanleihen über alle Laufzeiten hinweg im negativen Bereich. Die US-amerikanische Notenbank Fed nahm im Juli zum ersten Mal seit der Finanzkrise eine Leitzinssenkung vor und reagierte damit auf Anzeichen einer sich abschwächenden Konjunktur. Zum Stichtag rentierten 10-jährige US-Treasuries mit lediglich 1,5 Prozent auf einem niedrigen Niveau.

Die weltpolitischen Störfeuer führten nur zu temporären Unsicherheiten an den Märkten und so bewegte sich das Gros der internationalen Börsen im Berichtshalbjahr unter Schwankungen leicht aufwärts. In den USA verzeichneten die Leitindizes Dow Jones Industrial und der marktweite S&P 500 im Juli ein neues Allzeithoch. Auch der deutsche Standardwertindex DAX sowie der EURO STOXX 50 landeten auf Halbjahressicht auf positivem Terrain. Im Zuge des erneut eskalierenden Handelsstreits mit den USA verlor hingegen vor allem der chinesische HangSeng deutlich. Ebenso musste der japanische Nikkei 225 Einbußen hinnehmen. An den Rohstoffmärkten machte Gold seinem Namen als Krisenwährung alle Ehre und verzeichnete im August ein neues Sechsjahreshoch.

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 Anteilinhaber 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



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Dr. Ulrich Neugebauer
(stv. Vorsitzender)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. August 2019	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2019	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	15

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 7-10 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 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 Markt iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 (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 7,5 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).

Zusatzerträge können durch Wertpapierdarlehensgeschäfte erzielt werden.

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 7-10 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	9,4%	12,2%	3,4%

ISIN DE000ETFL151

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	DE0001102408	0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026) 20260814
Löschung	FR0013200813	0.250000 % Frankreich EO-OAT 2016(26) 20261124
Löschung	DE0001102440	0.500000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2018 (2028) 20280214
Löschung	AT0000A1VGK0	0.500000 % Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2017(27) 20270419
Löschung	AT0000A1K9C8	0.750000 % Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2016(26) 20261019
Löschung	IE00BDHDP44	0.900000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(28) 20280514
Löschung	IT0005210650	1.250000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20261130
Löschung	ES00000128H5	1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030
Löschung	IT0005240830	2.200000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270531
Neuaufnahme	DE0001102465	0.250000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290214
Neuaufnahme	NL0013332430	0.250000 % Niederlande EO-Anl. 2019(29) 20290714
Neuaufnahme	DE0001102440	0.500000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2018 (2028) 20280214
Neuaufnahme	FR0013407236	0.500000 % Frankreich EO-OAT 2019(29) 20290524
Neuaufnahme	BE0000347568	0.900000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(29) 20290621
Neuaufnahme	IE00BDHDP44	0.900000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(28) 20280514
Neuaufnahme	ES0000012E51	1.450000 % Spanien EO-Bonos 2019(29) 20290429
Neuaufnahme	IT0005240830	2.200000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270531
Neuaufnahme	IT0005340929	2.800000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20281130

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
DE0001102416	0.250000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270214	5,48
DE0001102424	0.500000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270814	5,39
FR0013341682	0.750000	% Frankreich EO-OAT 2018(28) 20281124	5,36
FR0013286192	0.750000	% Frankreich EO-OAT 2017(28) 20280524	5,18
FR0013250560	1.000000	% Frankreich EO-OAT 2017(27) 20270524	4,95
ES0000012A89	1.450000	% Spanien EO-Obligaciones 2017(27) 20271030	4,93
IT0005323032	2.000000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20280131	4,86
ES0000012E51	1.450000	% Spanien EO-Bonos 2019(29) 20290429	4,75
DE0001102465	0.250000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) 20290214	4,69
ES0000012B88	1.400000	% Spanien EO-Bonos 2018(28) 20280729	4,68
ES0000012B39	1.400000	% Spanien EO-Bonos 2018(28) 20280429	4,65
FR0013407236	0.500000	% Frankreich EO-OAT 2019(29) 20290524	4,49
DE0001102457	0.250000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2018 (2028) 20280814	4,46
IT0005340929	2.800000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28) 20281130	4,40
IT0005274805	2.050000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270731	4,14
IT0005240830	2.200000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270531	3,77
NL0012171458	0.750000	% Niederlande EO-Anl. 2017(27) 20270714	3,37
BE0000345547	0.800000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(28) Ser. 85 20280621	3,21
BE0000341504	0.800000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81 20270621	2,98
NL0012818504	0.750000	% Niederlande EO-Anl. 2018(28) 20280714	2,74
BE0000347568	0.900000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(29) 20290621	2,61
PTOTEV0E0018	2.125000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2018(28) 20281016	2,55
PTOTEU0E0019	4.125000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2017(27) 20270413	2,34
AT0000A1ZGE4	0.750000	% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2018(28) 20280219	2,08
NL0013332430	0.250000	% Niederlande EO-Anl. 2019(29) 20290714	1,93

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2019.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		30.960.217,60	100,01
1. Anleihen		30.689.440,87	99,14
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	30.689.440,87		99,14
2. Forderungen		100.688,19	0,33
3. Bankguthaben		170.088,84	0,55
II. Verbindlichkeiten		-3.448,28	-0,01
III. Fondsvermögen		30.956.769,62	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE0001102465	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029 ²⁾		EUR	1.311	1.311	0	% 109,737	1.438.654,30	4,65
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027		EUR	1.549	1.507	1.525	% 108,561	1.681.615,78	5,43
DE0001102457	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihen 2018/2028		EUR	1.251	1.217	1.232	% 109,471	1.369.486,59	4,42
DE0001102424	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 ²⁾		EUR	1.490	1.450	1.467	% 110,990	1.653.744,00	5,34
							EUR	6.143.500,67	19,85
Ausland									
BE0000345547	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligaciones 2018/2028		EUR	889	864	940	% 110,993	986.723,33	3,19
BE0000341504	0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2027		EUR	829	806	877	% 110,329	914.630,15	2,95
BE0000347568	0,9000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2029		EUR	711	711	0	% 112,513	799.967,43	2,58
FR0013407236	0,5000 % Frankreich - OAT 2018/2029		EUR	1.262	1.262	0	% 109,069	1.376.450,78	4,45
FR0013286192	0,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2028		EUR	1.432	1.365	1.468	% 111,088	1.590.785,60	5,14
FR0013341682	0,7500 % Frankreich - Obligaciones 2017/2028		EUR	1.478	1.508	1.350	% 111,323	1.645.357,49	5,32
FR0013250560	1,0000 % Frankreich - OAT 2016/2027		EUR	1.353	1.289	1.387	% 112,353	1.520.139,61	4,91
IT0005323032	2,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2028		EUR	1.361	1.300	1.274	% 109,645	1.492.265,18	4,82
IT0005274805	2,0500 % Italien, Republik - Bonds 2017/2027		EUR	1.159	1.125	1.224	% 109,627	1.270.578,44	4,10
IT0005240830	2,2000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2027		EUR	1.046	1.046	1.135	% 110,700	1.157.926,92	3,74
IT0005340929	2,8000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2028		EUR	1.159	1.777	618	% 116,484	1.350.048,86	4,36
NL0013332430	0,2500 % Niederlande - Anleihe 2019/2029		EUR	546	547	1	% 108,229	590.928,54	1,91
NL0012171458	0,7500 % Niederlande - Anleihe 2017/2027		EUR	929	903	982	% 111,416	1.035.055,38	3,34
NL0012818504	0,7500 % Niederlande - Anleihe 2018/2028 ²⁾		EUR	747	726	790	% 112,493	840.320,84	2,71
AT0000A1ZGE4	0,7500 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2018/2028 ²⁾		EUR	575	558	607	% 111,136	639.030,16	2,06
PTOTEV0E0018	2,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2018/2028		EUR	659	652	631	% 118,919	783.674,04	2,53
PTOTEU0E0019	4,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2017/2027		EUR	544	529	575	% 131,906	717.570,44	2,32
ES0000012B39	1,4000 % Spanien - Bonos 2018/2028		EUR	1.270	1.234	1.343	% 112,381	1.427.238,45	4,61
ES0000012B88	1,4000 % Spanien - Bonos 2018/2028		EUR	1.277	1.241	1.351	% 112,402	1.435.372,90	4,64
ES0000012E51	1,4500 % Spanien - EO-Bonos 2019/2029		EUR	1.287	1.287	0	% 113,292	1.458.067,01	4,71
ES0000012A89	1,4500 % Spanien - Obligaciones 2017/2027		EUR	1.346	1.307	1.422	% 112,467	1.513.808,65	4,89
							EUR	24.545.940,20	79,29
							EUR	30.689.440,87	99,14
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
			EUR	170.088,84			% 100,000	170.088,84	0,55
Sonstige Vermögensgegenstände									
Abgegrenzte Zinsforderung aus verliehenen Wertpapieren									
			EUR	169,69			EUR	100.688,19	0,33
Zinsansprüche									
			EUR	100.518,50				100.518,50	0,32
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
			EUR	-3.448,28			EUR	-3.448,28	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
Umlaufende Anteile									
							EUR	30.956.769,62	100,00 ¹⁾
							EUR	136,98	
							STK	225.990,00	

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

²⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Wertpapierdarlehen Kurswert in EUR		gesamt
			befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:					
DE0001102465	0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029	EUR	372	408.611,84	
DE0001102424	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027	EUR	500	554.947,65	
NL0012818504	0,7500 % Niederlande - Anleihe 2018/2028	EUR	600	674.956,50	
AT0000A1ZGE4	0,7500 % Österreich, Republik - EO-Medium-Term Notes 2018/2028	EUR	440	488.996,99	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				2.127.512,98	2.127.512,98

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 30.08.2019

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					
DE0001102408	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026	EUR	0	1.507	
DE0001102440	0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2018/2028	EUR	1.593	1.593	
Ausland					
FR0013200813	0,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026	EUR	1.007	2.536	
IE00BDHDP44	0,9000 % Irland - Schatzanweisungen 2018/2028	EUR	659	659	
IT0005210650	1,2500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026	EUR	817	1.999	
AT0000A1VGK0	0,5000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2017/2027	EUR	404	988	
AT0000A1K9C8	0,7500 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2026	EUR	0	758	
ES00000128H5	1,3000 % Spanien - Obligaciones 2016/2026	EUR	1.023	2.504	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			21.393

(Basiswerte: 0,8000 % Belgien, Königreich - Obligaciones 2018/2028 (BE0000345547); 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026 (DE0001102408); 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2019/2029 (DE0001102465); 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 (DE0001102416); 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihen 2018/2028 (DE0001102457); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 (DE0001102424); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2018/2028 (DE0001102440); 0,7500 % Frankreich - Obligaciones 2017/2028 (FR0013341682); 0,7500 % Niederlande - Anleihe 2017/2027 (NL0012171458); 0,7500 % Niederlande - Anleihe 2018/2028 (NL0012818504); 0,5000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2017/2027 (AT0000A1VGK0); 0,7500 % Österreich, Republik - Medium-Term Notes 2018/2028 (AT0000A1ZGE4))

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2019 bis zum 31.08.2019

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		9.766,70	0,043
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		155.661,53	0,689
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		2,24	0,000
4. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		1.720,38	0,008
Summe der Erträge		167.150,85	0,740
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-24.266,66	-0,107
2. Sonstige Aufwendungen		-270,33	-0,001
davon: Verwahrtgelt	-270,33		-0,001
Summe der Aufwendungen		-24.536,99	-0,109
III. Ordentlicher Nettoertrag		142.613,86	0,631
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.745.229,41	7,723
2. Realisierte Verluste		0,00	0,000
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.745.229,41	7,723
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.887.843,27	8,354
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.013.199,13	4,483
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		34.337,11	0,152
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.047.536,24	4,635
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.935.379,51	12,989

Entwicklung des Sondervermögens

	2019 / 2020
	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	30.035.956,43
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-76.380,80
2. Zwischenausschüttungen	-84.380,80
3. Mittelzufluss (netto)	-1.352.371,14
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	28.387.803,50
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-29.740.174,64
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-501.433,58
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	2.935.379,51
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	1.013.199,13
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	34.337,11
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	30.956.769,62

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 2.127.512,98

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen
 DekaBank Deutsche Girozentrale

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:	EUR		3.505.901,22
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		3.505.901,22
Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren	EUR		2.117,12

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 2.117,12. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandsentschädigung in Höhe von EUR 0,00.

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	136,98
Umlaufende Anteile	STK	225.990,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	99,14
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 31.08.2019 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 31.08.2019 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	0,06
---	------

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.

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte Wertpapierleihe EUR

Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	2.127.512,98
in % des Fondsvermögens	6,87

10 größte Gegenparteien

Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	2.127.512,98
Sitzstaat	Deutschland

Arten von Abwicklung und Clearing

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem) und per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte).

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	0,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	2.127.512,98

Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen an einem geregelten Markt in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder an einer Börse in einem Mitgliedstaat der OECD notiert sein oder gehandelt werden und in einem wichtigen Index enthalten sein.

Von den Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten sowie ggf. nach Restlaufzeit variieren. Die Haircuts fallen für die aufgeführten Wertpapierkategorien wie folgt aus:

- Bankguthaben 0%
- Aktien 5% - 40%
- Renten 0,5% - 30%

Darüber hinaus kann für Sicherheiten in einer anderen Währung als der Fondswährung ein zusätzlicher Wertabschlag von bis zu 10%-Punkten angewandt werden. In besonderen Marktsituationen (z.B. Markturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	0,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	3.505.901,22

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 7-10 UCITS ETF

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	2.117,12
in % der Bruttoerträge	100,00

Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	absolut	0,00
	in % der Bruttoerträge	0,00

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (absoluter Betrag)

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

6,93

Die hier angegebene Prozentzahl bezieht sich auf das gesamte Wertpapiervermögen des Fonds einschließlich / ausschließlich Anteilen an Zielfonds/ Geldmarktfonds. Die Anlagebedingungen können jedoch Beschränkungen enthalten, so dass das Verleihen ggf. nur in geringerem Umfang zulässig ist.

Zehn größte Sicherheiten ausstellende, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

	1. Name	JPMorgan Chase & Co.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2. Name	2.161.304,11 UniCredit Bank AG
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3. Name	1.075.475,89 innogy Finance B.V.
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		269.121,22

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2,00
Name	J.P. Morgan AG Frankfurt
verwahrter Betrag absolut	2.430.425,33
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	1.075.475,89

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften

gesonderte Konten / Depots	0,00
Sammelkonten/Depots	0,00
Andere Konten/Depots	0,00
Verwahrart bestimmt Empfänger	0,00

Frankfurt am Main, den 2. September 2019
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 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 2018

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

Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Rüdiger
Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Mitglied des Aufsichtsrates der Deka Immobilien GmbH,
Frankfurt am Main

Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main
und der
Deka Immobilien GmbH, Frankfurt am Main
und der
Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main
und der
WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf
und der
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;
Stellvertretende Vorsitzende des Verwaltungsrates der
DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A., Luxemburg;
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,
Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der
Ostsächsischen Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Munning
Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Dr. Ulrich Neugebauer (stv. Vorsitzender)
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,
Köln
und der
Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln
und der
Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

Jörg Boysen

Thomas Ketter
Mitglied der Geschäftsführung der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

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

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squaire
Am Flughafen
60549 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 2019

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39
www.deka-etf.de