

Halbjahresbericht
zum 31. August 2019.

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Lizenzvermerk

Das Finanzinstrument wird von der Solactive AG (dem „Lizenzgeber“) nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt und der Lizenzgeber bietet keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung, weder hinsichtlich der Ergebnisse aus einer Nutzung des Index und/oder der Index-Marke noch hinsichtlich des Index-Stands zu irgendeinem bestimmten Zeitpunkt noch in sonstiger Hinsicht. Der Index wird durch den Lizenzgeber berechnet und veröffentlicht, wobei sich der Lizenzgeber nach besten Kräften bemüht, für die Richtigkeit der Berechnung des Index Sorge zu tragen. Es besteht für den Lizenzgeber – unbeschadet seiner Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten – keine Verpflichtung gegenüber Dritten, einschließlich Investoren und/oder Finanzintermediären des Finanzinstruments, auf etwaige Fehler in dem Index hinzuweisen. Weder die Veröffentlichung des Index durch den Lizenzgeber noch die Lizenzierung des Index sowie der Index-Marke für die Nutzung im Zusammenhang mit dem Finanzinstrument stellt eine Empfehlung des Lizenzgebers zur Kapitalanlage dar oder beinhaltet in irgendeiner Weise eine Zusicherung oder Meinung des Lizenzgebers hinsichtlich einer etwaigen Investition in dieses Finanzinstrument. 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 Eurozone Rendite Plus 1-10 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 Standardwerteindex 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 beigefügt sind, erfolgen.

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (ExchangeTraded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den Solactive Eurozone Rendite Plus 1-10 Bond (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index enthält maximal 5 Anleihen pro Euroland aus den 6 Euroländern mit der höchsten 5-Jahresrendite und Restlaufzeit zwischen 1 und 10 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 Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	4,4%	6,2%	1,5%

ISIN DE000ETFL490

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

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	ES00000128H5	1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030
Löschung	ES00000126C0	1.400000 % Spanien EO-Bonos 2014(20) 20200130
Löschung	IT0004594930	4.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2010(20) 20200831
Löschung	SK4120007204	4.000000 % Slowakei EO-Anl. 2010(20) Ser. 214 20200426
Löschung	ES00000122D7	4.000000 % Spanien EO-Bonos 2010(20) 20200429
Löschung	IE0034074488	4.500000 % Irland EO-Treasury Bonds 2004(20) 20200417
Neuaufnahme	ES00000128H5	1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030
Neuaufnahme	SK4120009762	3.625000 % Slowakei EO-Anl. 2014(29) 20290115
Neuaufnahme	IE00B4S3JD47	3.900000 % Irland EO-Treasury Bonds 2013(23) 20230319
Neuaufnahme	ES00000122E5	4.650000 % Spanien EO-Obligaciones 2010(25) 20250729
Neuaufnahme	IT0004513641	5.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2009(25) 20250228
Neuaufnahme	ES0000011868	6.000000 % Spanien EO-Bonos 1999(29) 20290130

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
IE00B4TV0D44	5.400000 % Irland EO-Treasury Bonds 2009(25) 20250312	5,64
ES0000011868	6.000000 % Spanien EO-Bonos 1999(29) 20290130	5,25
IT0001174611	6.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 1997(27) 20271031	4,99
PTOTEQOE0015	5.650000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2013(24) 20240214	4,58
IE00BV8C9418	1.000000 % Irland EO-Treasury Bonds 2016(26) 20260514	4,57
PTOTEKOE0011	2.875000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25) 20251014	4,26
PTOTEAOE0021	4.950000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2008(23) 20231024	4,20
IT0004513641	5.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2009(25) 20250228	3,96
ES00000122E5	4.650000 % Spanien EO-Obligaciones 2010(25) 20250729	3,90
IT0004009673	3.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2006(21) 20210731	3,89
IT0004356843	4.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2008(23) 20230731	3,75
ES00000126B2	2.750000 % Spanien EO-Bonos 2014(24) 20241030	3,71
IT0004695075	4.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2011(21) 20210831	3,53
IE00B6X95T99	3.400000 % Irland EO-Treasury Bonds 2014(24) 20240317	3,51
ES00000123K0	5.850000 % Spanien EO-Bonos 2011(22) 20220130	3,49
ES00000123B9	5.500000 % Spanien EO-Bonos 2011(21) 20210429	3,48
PTOTEYOE0007	3.850000 % Portugal, Republik EO-Obl. 2005(21) 20210414	3,45
IE00BDHDPR44	0.900000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(28) 20280514	3,37
PTOTESOE0013	2.200000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(22) 20221016	3,30
SK4120007543	4.350000 % Slowakei EO-Anl. 2010(25) 20251013	3,03
IE00B4S3JD47	3.900000 % Irland EO-Treasury Bonds 2013(23) 20230319	3,01
SK4120009762	3.625000 % Slowakei EO-Anl. 2014(29) 20290115	2,96
SK4120008871	3.375000 % Slowakei EO-Anl. 2012(24) 20241114	2,77
SK4120009044	3.000000 % Slowakei EO-Anl. 2013(23) 20230227	2,58
SI0002103685	1.250000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27) 20270321	2,58
SK4120010430	1.375000 % Slowakei EO-Anl. 2015(27) 20270120	2,51
SI0002103776	1.000000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2018(28) 20280305	1,99
SI0002103545	2.125000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2015(25) 20250727	1,76

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2019.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		39.534.986,34	100,01
1. Anleihen		38.620.466,40	97,70
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	9.628.010,07		24,36
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	12.972.296,42		32,82
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	9.131.815,32		23,10
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	6.888.344,59		17,43
2. Forderungen		619.897,85	1,57
3. Bankguthaben		294.622,09	0,75
II. Verbindlichkeiten		-4.646,57	-0,01
III. Fondsvermögen		39.530.339,77	100,00

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

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 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										
Ausland										
IE00BDHDP44	0,9000 % Irland - Treasury Bonds 2018/2028		EUR	1.188	589	453	% 109,462	1.300.406,18	3,29	
IE00BV8C9418	1,0000 % Irland - Treasury Bonds 2016/2026		EUR	1.616	801	616	% 109,182	1.764.374,66	4,46	
IE00B6X95T99	3,4000 % Irland - Treasury Bonds 2014/2024		EUR	1.146	569	438	% 118,160	1.354.113,60	3,43	
IE00B453JD47	3,9000 % Irland - Treasury Bonds 2013/2023		EUR	1.000	1.250	250	% 116,283	1.162.828,00	2,94	
IE00B4TV0D44	5,4000 % Irland - Treasury Bonds 2009/2025		EUR	1.640	812	624	% 132,716	2.176.545,68	5,51	
IT0004009673	3,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2006/2021		EUR	1.400	634	591	% 107,350	1.502.900,00	3,80	
IT0004356843	4,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2008/2023		EUR	1.233	557	520	% 117,449	1.448.141,24	3,66	
IT0004695075	4,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2011/2021		EUR	1.243	562	524	% 109,676	1.363.278,77	3,45	
IT0004513641	5,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2009/2025		EUR	1.229	1.443	214	% 124,311	1.527.782,19	3,86	
IT0001174611	6,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 1997/2027		EUR	1.331	602	561	% 144,823	1.927.591,47	4,88	
PTOTESOE0013	2,2000 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2022 ²⁾		EUR	1.174	546	452	% 108,474	1.273.488,28	3,22	
PTOTEKOE0011	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025		EUR	1.384	647	536	% 118,845	1.644.817,57	4,16	
PTOTEYOE0007	3,8500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2005/2021 ²⁾		EUR	1.241	574	612	% 107,300	1.331.593,00	3,37	
PTOTEAOE0021	4,9500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2008/2023		EUR	1.326	618	512	% 122,264	1.621.214,28	4,10	
PTOTEQOE0015	5,6500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2013/2024		EUR	1.395	652	540	% 126,907	1.770.352,65	4,48	
SK4120010430	1,3750 % Slowakei - Anleihe 2015/2027		EUR	856	387	367	% 113,088	968.033,28	2,45	
SK4120009044	3,0000 % Slowakei - Anleihe 2013/2023		EUR	885	401	380	% 112,754	997.872,02	2,52	
SK4120008871	3,3750 % Slowakei - Anleihe 2012/2024		EUR	885	401	380	% 120,760	1.068.729,54	2,70	
SK4120009762	3,6250 % Slowakei - Anleihe 2014/2029 ²⁾		EUR	825	1.048	223	% 138,715	1.144.398,75	2,89	
SK4120007543	4,3500 % Slowakei - Anleihe 2010/2025		EUR	885	401	380	% 132,403	1.171.764,78	2,96	
SI0002103776	1,0000 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2018/2028		EUR	693	314	298	% 111,032	769.451,76	1,95	
SI0002103685	1,2500 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2017/2027		EUR	885	401	380	% 112,479	995.435,61	2,52	
SI0002103545	2,1250 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2015/2025		EUR	590	267	253	% 115,229	679.853,46	1,72	
ES00000126B2	2,7500 % Spanien - Bonos 2014/2024		EUR	1.232	576	660	% 116,192	1.431.482,98	3,62	
ES00000123B9	5,5000 % Spanien - Bonos 2011/2021		EUR	1.220	570	654	% 110,118	1.343.434,72	3,40	
ES00000123K0	5,8500 % Spanien - Bonos 2011/2022		EUR	1.166	545	625	% 115,535	1.347.138,10	3,41	
ES0000011868	6,0000 % Spanien - Bonos 1999/2029		EUR	1.297	1.505	208	% 156,210	2.026.498,27	5,13	
ES00000122E5	4,6500 % Spanien - Obligaciones 2010/2025		EUR	1.165	1.567	402	% 129,352	1.506.945,56	3,81	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	38.620.466,40	97,70
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	294.622,09	0,75
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle								EUR	294.622,09	0,75
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	619.897,85	1,57
Abgegrenzte Zinsforderung aus verliehenen Wertpapieren								EUR	100,70	0,00
Quellensteuererstattungsansprüche								EUR	7.445,46	0,02
Zinsansprüche								EUR	612.351,69	1,55
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-4.646,57	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung								EUR	-4.646,57	-0,01
Fondsvermögen								EUR	39.530.339,77	100,00 ¹⁾
Anteilwert								EUR	101,25	
Umlaufende Anteile								STK	390.434,00	

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 Eurozone Rendite Plus 1-10 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:						
PTOTESOE0013	2,2000 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2022	EUR	114		123.369,99	
PTOTEYOE0007	3,8500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2005/2021	EUR	1.000		1.073.000,00	
SK4120009762	3,6250 % Slowakei - Anleihe 2014/2029	EUR	612		848.935,80	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen					2.045.305,79	2.045.305,79

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					
Ausland					
IE0034074488	4,5000 % Irland - Treasury Bonds 2004/2020	EUR	182	1.524	
IT0004594930	4,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2010/2020	EUR	162	1.355	
SK4120007204	4,0000 % Slowakei - Anleihe 2010/2020	EUR	118	982	
ES00000126C0	1,4000 % Spanien - Bonos 2014/2020	EUR	170	1.425	
ES00000122D7	4,0000 % Spanien - Bonos 2010/2020	EUR	173	1.442	
ES00000128H5	1,3000 % Spanien - Obligaciones 2016/2026	EUR	1.176	1.176	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			9.624

(Basiswerte: 3,4000 % Irland - Treasury Bonds 2014/2024 (IE00B6X95T99); 4,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2010/2020 (IT0004594930); 5,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2009/2025 (IT0004513641); 4,9500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2008/2023 (PTOTEAOE0021); 5,6500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2013/2024 (PTOTEQOE0015); 3,6250 % Slowakei - Anleihe 2014/2029 (SK4120009762); 4,3500 % Slowakei - Anleihe 2010/2025 (SK4120007543); 1,2500 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2017/2027 (SI0002103685); 2,1250 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2015/2025 (SI0002103545); 1,4000 % Spanien - Bonos 2014/2020 (ES00000126C0); 2,7500 % Spanien - Bonos 2014/2024 (ES00000126B2); 5,8500 % Spanien - Bonos 2011/2022 (ES00000123K0); 6,0000 % Spanien - EO-Bonos 1999/2029 (ES0000011868))

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 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 ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		523.433,49	1,341
2. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		1.435,57	0,004
Summe der Erträge		524.869,06	1,344
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-24.908,06	-0,064
2. Sonstige Aufwendungen		-715,00	-0,002
davon: Verwahrtgelt	-715,00		-0,002
Summe der Aufwendungen		-25.623,06	-0,066
III. Ordentlicher Nettoertrag		499.246,00	1,279
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		198.715,76	0,509
2. Realisierte Verluste		-485.597,86	-1,244
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-286.882,10	-0,735
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		212.363,90	0,544
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		692.136,49	1,773
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		475.410,31	1,218
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.167.546,80	2,990
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.379.910,70	3,534

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2019 / 2020 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		36.285.671,08
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-220.053,46
2. Zwischenausschüttungen		-252.655,83
3. Mittelzufluss (netto)		2.331.417,30
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	17.520.916,58	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-15.189.499,28	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		6.049,98
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.379.910,70
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	692.136,49	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	475.410,31	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		39.530.339,77

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

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 2.045.305,79

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen
 DekaBank Deutsche Girozentrale

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:	EUR		
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		2.409.720,66
Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren	EUR		2.254,65

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 32.524,09. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandschädigung 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	101,25
Umlaufende Anteile	STK	390.434,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,70
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	0,19
---	------

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 Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

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

Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	2.045.305,79
in % des Fondsvermögens	5,17

10 größte Gegenparteien

Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	2.045.305,79
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	2.045.305,79

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. Marktturnbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindizes (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder dem GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter www.eurexrepo.com entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag i.H.v. 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

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	2.409.720,66

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	2.254,65
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

5,30

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 Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

	1. Name	Mercedes-Benz Japan Co., Ltd.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		2.003.024,66
	2. Name	Investitionsbank Berlin
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		406.696,00

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	2.003.024,66
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	406.696,00

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