

Halbjahresbericht
zum 31. August 2019.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign
Diversified 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 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	14

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 iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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 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 mindestens 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 iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	27,5%	31,5%	6,7%

ISIN DE000ETFL169

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	FI4000148630	0.750000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2015(31) 20310414
Löschung	BE0000335449	1.000000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(31) Ser. 75 20310621
Löschung	IE00BFZRQ242	1.350000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31) 20310317
Löschung	FI4000242870	1.375000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2017(47) 20470414
Löschung	BE0000344532	1.450000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(37) Ser. 84 20370621
Löschung	IT0005094088	1.650000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(32) 20320229
Löschung	FR0013234333	1.750000 % Frankreich EO-OAT 2017(39) 20390624
Löschung	ES00000127A2	1.950000 % Spanien EO-Obligaciones 2015(30) 20300729
Löschung	IE00BV8C9186	2.000000 % Irland EO-Treasury Bonds 2015(45) 20450217
Neuaufnahme	NL0013552060	0.500000 % Niederlande EO-Anl. 2019(40) 20400114
Neuaufnahme	BE0000346552	1.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86 20330421
Neuaufnahme	FR0013313582	1.250000 % Frankreich EO-OAT 2018(34) 20340524
Neuaufnahme	IE00BFZRQ242	1.350000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31) 20310317
Neuaufnahme	FI4000242870	1.375000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2017(47) 20470414
Neuaufnahme	IE00BH3SQB22	1.500000 % Irland EO-Treasury Bonds 2019(50) 20500514
Neuaufnahme	BE0000348574	1.700000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(50) 20500621
Neuaufnahme	ES0000012B47	2.700000 % Spanien EO-Bonos 2018(48) 20481030
Neuaufnahme	IT0005321325	2.950000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(38) 20380831

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
DE0001102432	1.250000	% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2048) 20480814	8,05
FR0012993103	1.500000	% Frankreich EO-OAT 2015(31) 20310524	6,86
ES00000128C6	2.900000	% Spanien EO-Obligaciones 2016(46) 20461030	6,13
IT0005273013	3.450000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(48) 20480229	5,72
ES00000128Q6	2.350000	% Spanien EO-Obligaciones 2017(33) 20330729	5,41
IT0005162828	2.700000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(47) 20470228	5,15
BE0000338476	1.600000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(47) Ser. 78 20470621	4,91
IT0005240350	2.450000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(33) 20330831	4,77
IT0005321325	2.950000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(38) 20380831	4,76
FR0013257524	2.000000	% Frankreich EO-OAT 2017(48) 20480524	4,70
FR0013154044	1.250000	% Frankreich EO-OAT 2016(36) 20360524	4,66
ES00000128E2	3.450000	% Spanien EO-Bonos 2016(66) 20660729	4,15
ES0000012B47	2.700000	% Spanien EO-Bonos 2018(48) 20481030	3,99
AT0000A1XML2	2.100000	% Österreich, Republik EO-Med.-Term Notes 2017(2117) 21170919	3,97
FR0013313582	1.250000	% Frankreich EO-OAT 2018(34) 20340524	3,41
BE0000336454	1.900000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(38) Ser. 76 20380621	3,28
AT0000A1K9F1	1.500000	% Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2016(47) 20470219	2,95
BE0000348574	1.700000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(50) 20500621	2,75
BE0000346552	1.250000	% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86 20330421	2,72
IE00BV8C9B83	1.700000	% Irland EO-Treasury Bonds 2017(37) 20370514	2,37
NL0013552060	0.500000	% Niederlande EO-Anl. 2019(40) 20400114	2,33
PTOTEW0E0017	2.250000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2018(34) 20340417	2,00
IE00BFZRPZ02	1.300000	% Irland EO-Treasury Bonds 2018(33) 20330514	1,71
IE00BH3SQB22	1.500000	% Irland EO-Treasury Bonds 2019(50) 20500514	1,64
FI4000306758	1.125000	% Finnland, Republik EO-Bonds 2018(34) 20340414	1,63

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2019.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		10.035.940,17	100,01
1. Anleihen		9.923.656,25	98,89
- Restlaufzeit über 10 Jahre	9.923.656,25		98,89
2. Forderungen		63.265,30	0,63
3. Bankguthaben		49.018,62	0,49
II. Verbindlichkeiten		-1.363,01	-0,01
III. Fondsvermögen		10.034.577,16	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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									
DE0001102432	1,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2048		EUR	554	1.050	1.170	% 144,025	797.895,84	7,95
							EUR	797.895,84	7,95
Ausland									
BE0000346552	1,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2018/2033		EUR	228	693	465	% 118,727	270.698,02	2,70
BE0000338476	1,6000 % Belgien, Königreich - Obligations 2016/2047		EUR	372	763	943	% 130,996	487.303,97	4,86
BE0000348574	1,7000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2050		EUR	204	607	403	% 133,731	272.810,28	2,72
BE0000336454	1,9000 % Belgien, Königreich - Obligations 2015/2038		EUR	245	457	543	% 132,505	324.636,03	3,24
FI4000306758	1,1250 % Finnland, Republik - Government Bonds 2018/2034		EUR	134	275	340	% 120,696	161.733,08	1,61
FR0013154044	1,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2036		EUR	382	613	773	% 120,936	461.976,36	4,60
FR0013313582	1,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2034		EUR	282	740	458	% 120,047	338.531,55	3,37
FR0012993103	1,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2031		EUR	561	933	1.224	% 121,276	680.359,76	6,78
FR0013257524	2,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2048		EUR	323	537	703	% 144,724	467.458,10	4,66
IE00BFZRP202	1,3000 % Irland - Treasury Bonds 2018/2033		EUR	148	275	327	% 114,644	169.672,38	1,69
IE00BH3SQB22	1,5000 % Irland - Treasury Bonds 2019/2050		EUR	134	135	1	% 120,921	162.033,47	1,61
IE00BV8C9B83	1,7000 % Irland - Treasury Bonds 2017/2037		EUR	192	413	487	% 122,243	234.707,19	2,34
IT0005240350	2,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2033		EUR	417	756	900	% 113,555	473.526,27	4,72
IT0005162828	2,7000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2047		EUR	437	793	944	% 116,997	511.278,99	5,10
IT0005321325	2,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2038		EUR	392	1.240	848	% 120,270	471.457,42	4,70
IT0005273013	3,4500 % Italien, Republik - B.T.P. 2017/2048		EUR	430	780	928	% 132,098	568.022,48	5,66
NL0013552060	0,5000 % Niederlande - Anleihe 2019/2040		EUR	201	201	0	% 115,122	231.394,72	2,31
AT0000A1K9F1	1,5000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2047		EUR	215	461	545	% 136,199	292.826,78	2,92
AT0000A1XML2	2,1000 % Österreich, Republik - Medium Term Notes 2017/2117		EUR	195	335	367	% 202,199	394.287,97	3,93
PTOTEW0E0017	2,2500 % Portugal, Republik - Obligations 2018/2034		EUR	159	283	289	% 124,599	198.112,41	1,97
ES0000012B47	2,7000 % Spanien - Bonos 2018/2048		EUR	277	781	504	% 142,974	396.036,76	3,95
ES00000128E2	3,4500 % Spanien - MTN 2016/2066		EUR	237	469	555	% 173,578	411.378,68	4,10
ES00000128Q6	2,3500 % Spanien - Obligaciones 2017/2033		EUR	424	894	993	% 126,660	537.038,06	5,35
ES00000128C6	2,9000 % Spanien - Obligaciones 2016/2046		EUR	415	821	970	% 146,622	608.479,68	6,06
							EUR	9.125.760,41	90,94
							EUR	9.923.656,25	98,89
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
			EUR	49.018,62			% 100,000	49.018,62	0,49
Sonstige Vermögensgegenstände									
Abgegrenzte Zinsforderung aus verliehenen Wertpapieren									
			EUR	20,59				63.265,30	0,63
Zinsansprüche									
			EUR	63.244,71				63.244,71	0,63
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung									
			EUR	-1.363,01				-1.363,01	-0,01
Fondsvermögen									
Anteilwert									
							EUR	10.034.577,16	100,00 ¹⁾
Umlaufende Anteile									
							EUR	164,39	
							STK	61.042,00	

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

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 (Marktzugang 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					
BE0000335449	1,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2015/2031	EUR	0	560	
BE0000344532	1,4500 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2037	EUR	0	245	
FI4000148630	0,7500 % Finnland, Republik - Government Bonds 2015/2031	EUR	0	225	
FI4000242870	1,3750 % Finnland, Republik - Government Bonds 2017/2047	EUR	357	357	
FR0013234333	1,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2016/2039	EUR	0	274	
IE00BFZRQ242	1,3500 % Irland - Treasury Bonds 2018/2031	EUR	357	357	
IE00BV8C9186	2,0000 % Irland - Treasury Bonds 2015/2045	EUR	0	429	
IT0005094088	1,6500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2015/2032	EUR	0	773	
ES00000127A2	1,9500 % Spanien - Obligaciones 2015/2030	EUR	0	695	
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):					
unbefristet		EUR			8.447

(Basiswerte: 1,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2048 (DE0001102432); 1,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2016/2039 (FR0013234333); 2,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2017/2048 (FR0013257524); 1,3000 % Irland - Treasury Bonds 2018/2033 (IE00BFZRQ242); 2,2500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2018/2034 (PTOTEW0E0017); 2,7000 % Spanien - Bonos 2018/2048 (ES0000012B47))

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 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		6.397,87	0,105
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		144.586,21	2,369
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		754,75	0,012
Summe der Erträge		151.738,83	2,486
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-12.833,18	-0,210
2. Sonstige Aufwendungen		-153,51	-0,003
davon: Verwahrtgelt	-153,51		-0,003
Summe der Aufwendungen		-12.986,69	-0,213
III. Ordentlicher Nettoertrag		138.752,14	2,273
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.930.524,16	31,626
2. Realisierte Verluste		-15.179,43	-0,249
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.915.344,73	31,377
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.054.096,87	33,651
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.470.239,41	24,086
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		105.709,63	1,732
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.575.949,04	25,817
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		3.630.045,91	59,468

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		11.630.059,14
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-27.727,02
2. Zwischenausschüttungen		-146.353,38
3. Mittelzufluss (netto)		-5.214.696,10
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	13.959.385,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-19.174.081,10	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		163.248,61
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		3.630.045,91
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	1.470.239,41	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	105.709,63	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		10.034.577,16

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

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen

DekaBank Deutsche Girozentrale

	EUR	Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:			803.896,00
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		803.896,00
Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren	EUR		940,32

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 940,32. Davon erhielt die DekaBank eine Aufwandentschädigung 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	164,39
Umlaufende Anteile	STK	61.042,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,89

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

0,11

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

Wertpapierleihe EUR

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. Marktturbulenzen) 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	803.896,00

Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 10+ UCITS ETF

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	940,32
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.

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Evonik Finance B.V.
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	803.896,00

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	803.896,00

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 Square
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