

Halbjahresbericht  
zum 31. August 2020.

**Deka iBoxx € Liquid Sovereign  
Diversified 5-7 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 2020

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2020 bis zum 31. August 2020.

Zu Beginn des Berichtszeitraums befand sich die globale Wirtschaft bereits tief in der Corona-Krise. Die Beschränkungen der Verkehrsfreiheit und weitgehende Lockdown-Maßnahmen trübten die weltweiten Konjunkturperspektiven in unvergleichbarem Ausmaß ein. Die Ende Juli veröffentlichten BIP-Daten der USA und Deutschlands für das zweite Quartal 2020 dokumentierten den dramatischen Einbruch der Wirtschaftsleistung, wobei sich seit Mai die Anzeichen für eine Erholung häufen. Die positiven Tendenzen setzten sich auch gegen Ende der Berichtsperiode mit ermutigenden Zahlen fort. So erholte sich beispielsweise das ifo Geschäftsklima und auch der Arbeitsmarkt in den USA zeigte sich stabiler.

Seitens der Geld- und Fiskalpolitik erfolgte als Reaktion auf die durch die Corona-Krise gestiegenen konjunkturellen Risiken die Implementierung umfangreicher Unterstützungspakete. Die EZB stockte im Verlauf der Pandemie ihr PEPP-Anleihekaufprogramm auf 1,35 Bio. Euro auf. Auch die US-Notenbank kauft mittlerweile direkt Unternehmensanleihen und senkte die Leitzinsen massiv. Zudem verkündete sie im August eine bemerkenswerte Umorientierung, die die bisherige Ausrichtung der Geldpolitik an der Inflationsmarke von 2 Prozent flexibler sieht und die Beschäftigung stärker in den Fokus nimmt. Ende August rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei knapp minus 0,4 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries mit plus 0,7 Prozent und damit auf signifikant niedrigerem Niveau als Anfang März.

Ein Großteil der Aktienmärkte befand sich aufgrund der pessimistischen Pandemie-Szenarien Anfang März bereits im freien Fall. Die staatlichen Hilfspakete, die Versorgung der Märkte mit Liquidität durch die Zentralbanken sowie die Hoffnung auf eine Eindämmung der Pandemie sorgten im Anschluss jedoch für eine spürbare Beruhigung der Märkte und eine kräftige Gegenbewegung. Das Gros der etablierten Aktienbörsen konnte auf Halbjahressicht dementsprechend teils deutliche Kurszuwächse verbuchen.

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Abschnitt Anlagepolitik. Gerne nehmen wir die Gelegenheit zum Anlass, um Ihnen für das uns entgegengebrachte Vertrauen zu danken.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilhaber im Internet unter [www.deka-etf.de](http://www.deka-etf.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

|   |    |
|---|----|
| Anlagepolitik                               | 5  |
| Vermögensübersicht zum 31. August 2020      | 8  |
| Vermögensaufstellung zum 31. August 2020    | 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 iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF).

Die Auswahl der für das Sondervermögen vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 (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 5,5 bis 7,5 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 5-7 UCITS ETF

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

**ISIN** DE000ETFL144

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 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        | DE0001102390 | 0.500000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026) 20260214      |
| Löschung        | FI4000197959 | 0.500000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(26) 20260414         |
| Löschung        | FR0013131877 | 0.500000 % Frankreich EO-OAT 2016(26) 20260524                   |
| Löschung        | NL0011819040 | 0.500000 % Niederlande EO-Anl. 2016(26) 20260714                 |
| Löschung        | AT0000A1K9C8 | 0.750000 % Österreich, Republik EO-Bundesanal. 2016(26) 20261019 |
| Löschung        | DE0001102382 | 1.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2015 (2025) 20250814      |
| Löschung        | ES00000128H5 | 1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030             |
| Löschung        | IT0005170839 | 1.600000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20260531         |
| Löschung        | IT0005370306 | 2.100000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(26) 20260714         |
| Löschung        | ES00000127G9 | 2.150000 % Spanien EO-Obligaciones 2015(25) 20251030             |
| Löschung        | FR0010916924 | 3.500000 % Frankreich EO-OAT 2010(26) 20260424                   |
| Löschung        | ES00000123C7 | 5.900000 % Spanien EO-Bonos 2011(26) 20260729                    |
| Neuaufnahme     | BE0000351602 | 0.000000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2020(27) 20271021  |
| Neuaufnahme     | DE0001102523 | 0.000000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2027) 20271114      |
| Neuaufnahme     | FR0013508470 | 0.000000 % Frankreich EO-OAT 2020(26) 20260224                   |
| Neuaufnahme     | NL0015031501 | 0.000000 % Niederlande EO-Anl. 2020(27) 20270114                 |
| Neuaufnahme     | IE00BKFVC568 | 0.200000 % Irland EO-Treasury Bonds 2020(27) 20270514            |
| Neuaufnahme     | DE0001102424 | 0.500000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270814      |
| Neuaufnahme     | FI4000278551 | 0.500000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2017(27) 20270914         |
| Neuaufnahme     | PTOTEMOE0035 | 0.700000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(27) 20271014          |
| Neuaufnahme     | ES0000012G26 | 0.800000 % Spanien EO-Obligaciones 2020(27) 20270729             |
| Neuaufnahme     | IT0005390874 | 0.850000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(27) 20270114         |
| Neuaufnahme     | ES0000012A89 | 1.450000 % Spanien EO-Obligaciones 2017(27) 20271030             |
| Neuaufnahme     | IT0005274805 | 2.050000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270731         |
| Neuaufnahme     | FR0011317783 | 2.750000 % Frankreich EO-OAT 2012(27) 20271024                   |

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

| Zusammensetzung des Index (%) |          |  |      |
|-------------------------------|----------|--|------|
| DE0001102416                  | 0.250000 | % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270214           | 8,19 |
| DE0001102424                  | 0.500000 | % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027) 20270814           | 8,08 |
| FR0011317783                  | 2.750000 | % Frankreich EO-OAT 2012(27) 20271024                        | 7,35 |
| ES0000012A89                  | 1.450000 | % Spanien EO-Obligaciones 2017(27) 20271030                  | 6,22 |
| ES00000128P8                  | 1.500000 | % Spanien EO-Obligaciones 2017(27) 20270429                  | 5,65 |
| IT0005274805                  | 2.050000 | % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270731              | 5,29 |
| FR0013200813                  | 0.250000 | % Frankreich EO-OAT 2016(26) 20261124                        | 5,09 |
| IT0005210650                  | 1.250000 | % Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(26) 20261130              | 4,97 |
| FR0013250560                  | 1.000000 | % Frankreich EO-OAT 2017(27) 20270524                        | 4,92 |
| IT0005390874                  | 0.850000 | % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(27) 20270114              | 4,91 |
| IT0005240830                  | 2.200000 | % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(27) 20270531              | 4,82 |
| NL0012171458                  | 0.750000 | % Niederlande EO-Anl. 2017(27) 20270714                      | 4,24 |
| ES0000012G26                  | 0.800000 | % Spanien EO-Obligaciones 2020(27) 20270729                  | 3,84 |
| BE0000341504                  | 0.800000 | % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81 20270621 | 3,77 |
| DE0001102523                  | 0.000000 | % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2027) 20271114           | 3,70 |
| PTOTEUOE0019                  | 4.125000 | % Portugal, Republik EO-Obr. 2017(27) 20270413               | 3,09 |
| AT0000A1VGK0                  | 0.500000 | % Österreich, Republik EO-Bundes anl. 2017(27) 20270419      | 2,58 |
| FR0013508470                  | 0.000000 | % Frankreich EO-OAT 2020(26) 20260224                        | 2,57 |
| NL0015031501                  | 0.000000 | % Niederlande EO-Anl. 2020(27) 20270114                      | 2,40 |
| BE0000351602                  | 0.000000 | % Belgien, Königreich EO-Bons dEtat 2020(27) 20271021        | 2,08 |
| FI4000278551                  | 0.500000 | % Finnland, Republik EO-Bonds 2017(27) 20270914              | 1,82 |
| IE00BKFVC568                  | 0.200000 | % Irland EO-Treasury Bonds 2020(27) 20270514                 | 1,71 |
| PTOTEMOE0035                  | 0.700000 | % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(27) 20271014               | 1,32 |
| SI0002103685                  | 1.250000 | % Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27) 20270321             | 0,84 |
| LU1556942974                  | 0.625000 | % Luxemburg, Großherzogtum EO-Bonds 2017(27) 20270131        | 0,54 |

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 31. August 2020.

|                                | Kurswert<br>in EUR | Kurswert<br>in EUR    | % des Fonds-<br>vermögens <sup>1)</sup> |
|--------------------------------|--------------------|-----------------------|---|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b> |                    | <b>283.207.216,61</b> | <b>100,01</b>                           |
| 1. Anleihen                    |                    | 278.900.491,28        | 98,49                                   |
| - Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre   | 216.156.192,74     |                       | 76,33                                   |
| - Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre  | 62.744.298,54      |                       | 22,16                                   |
| 2. Forderungen                 |                    | 1.113.818,24          | 0,39                                    |
| 3. Bankguthaben                |                    | 3.192.907,09          | 1,13                                    |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>   |                    | <b>-38.140,36</b>     | <b>-0,01</b>                            |
| <b>III. Fondsvermögen</b>      |                    | <b>283.169.076,25</b> | <b>100,00</b>                           |

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



# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 31. August 2020.

| ISIN  | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2020 | Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs      | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|--|-------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------|----------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| Verzinsliche Wertpapiere  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| Inland  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| DE0001102523  | 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2020/2027                         |       | EUR                                   | 9.930              | 9.930                              | 0                 | % 104,023 | 10.329.483,90   | 3,65                 |
| DE0001102416  | 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027                         |       | EUR                                   | 21.633             | 19.754                             | 2.027             | % 105,643 | 22.853.750,19   | 8,07                 |
| DE0001102424  | 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027                         |       | EUR                                   | 20.924             | 20.924                             | 0                 | % 107,689 | 22.532.846,36   | 7,96                 |
|   |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR       | 55.716.080,45   | 19,68                |
| Ausland   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| BE0000351602  | 0,0000 % Belgien, Königreich - Anleihe 2020/2027                           |       | EUR                                   | 5.675              | 6.201                              | 526               | % 102,367 | 5.809.314,20    | 2,05                 |
| BE0000341504  | 0,8000 % Belgien, Königreich - Obligations 2017/2027                       |       | EUR                                   | 9.738              | 9.142                              | 1.984             | % 108,048 | 10.521.689,90   | 3,72                 |
| FI4000278551  | 0,5000 % Finnland, Republik - Anleihe 2017/2027                            |       | EUR                                   | 4.767              | 4.767                              | 0                 | % 106,486 | 5.076.187,62    | 1,79                 |
| FR0013200813  | 0,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026                        |       | EUR                                   | 13.630             | 13.236                             | 2.945             | % 104,171 | 14.198.572,72   | 5,01                 |
| FR0013250560  | 1,0000 % Frankreich - OAT 2016/2027  |       | EUR                                   | 12.539             | 11.975                             | 2.856             | % 109,358 | 13.712.399,62   | 4,84                 |
| FR0011317783  | 2,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2011/2027                        |       | EUR                                   | 16.717             | 17.722                             | 1.005             | % 122,596 | 20.494.344,90   | 7,24                 |
| FR0013508470  | 0,0000 % Frankreich, Republik - Anleihe 2020/2026                          |       | EUR                                   | 7.006              | 7.006                              | 0                 | % 102,476 | 7.179.468,56    | 2,54                 |
| IE00BKFCV568  | 0,2000 % Irland, Republik - Anleihe 2020/2027                              |       | EUR                                   | 4.611              | 4.658                              | 47                | % 103,231 | 4.759.958,82    | 1,68                 |
| IT0005390874  | 0,8500 % Italien, Republik - Anleihe 2019/2027                             |       | EUR                                   | 13.578             | 13.578                             | 0                 | % 100,776 | 13.683.365,28   | 4,83                 |
| IT0005210650  | 1,2500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026 <sup>2)</sup> |       | EUR                                   | 13.401             | 11.925                             | 2.075             | % 103,466 | 13.865.478,66   | 4,90                 |
| IT0005274805  | 2,0500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2027               |       | EUR                                   | 13.617             | 14.213                             | 596               | % 108,406 | 14.761.645,02   | 5,21                 |
| IT0005240830  | 2,2000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2017/2027               |       | EUR                                   | 12.289             | 10.935                             | 1.902             | % 109,418 | 13.446.378,02   | 4,75                 |
| LU1556942974  | 0,6250 % Luxemburg, Großherzogtum - Bonds 2017/2027                        |       | EUR                                   | 1.419              | 1.331                              | 288               | % 106,601 | 1.512.672,02    | 0,53                 |
| NL0015031501  | 0,0000 % Niederlande, Königreich der - Anleihe 2020/2027                   |       | EUR                                   | 6.486              | 6.486                              | 0                 | % 103,098 | 6.686.947,31    | 2,36                 |
| NL0012171458  | 0,7500 % Niederlande - Anleihe 2017/2027                                   |       | EUR                                   | 10.910             | 10.240                             | 2.221             | % 108,451 | 11.832.004,10   | 4,18                 |
| AT0000A1VGK0  | 0,5000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2017/2027                    |       | EUR                                   | 6.781              | 5.942                              | 835               | % 106,277 | 7.206.662,36    | 2,55                 |
| PTOTEMOE0035  | 0,7000 % Portugal, Republik - Anleihe 2020/2027                            |       | EUR                                   | 3.547              | 3.876                              | 329               | % 104,076 | 3.691.575,72    | 1,30                 |
| PTOTEUOE0019  | 4,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2017/2027                       |       | EUR                                   | 6.786              | 6.370                              | 1.382             | % 126,951 | 8.614.894,86    | 3,04                 |
| SI0002103685  | 1,2500 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2017/2027                  |       | EUR                                   | 2.128              | 1.998                              | 434               | % 109,514 | 2.330.467,28    | 0,82                 |
| ES0000012A89  | 1,4500 % Spanien - Obligaciones 2017/2027                                  |       | EUR                                   | 15.812             | 15.812                             | 0                 | % 109,685 | 17.343.392,20   | 6,12                 |
| ES00000128P8  | 1,5000 % Spanien - Obligaciones 2017/2027                                  |       | EUR                                   | 14.332             | 13.989                             | 2.530             | % 109,953 | 15.758.463,96   | 5,57                 |
| ES0000012G26  | 0,8000 % Spanien, Königreich - Anleihe 2020/2027                           |       | EUR                                   | 10.185             | 10.185                             | 0                 | % 105,042 | 10.698.527,70   | 3,78                 |
|   |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR       | 223.184.410,83  | 78,82                |
|   |  |       |                                       |                    |                                    |                   | EUR       | 278.900.491,28  | 98,49                |
| Summe Wertpapiervermögen  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| EUR-Guthaben bei:   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| Verwahrstelle   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
|   |  |       | EUR                                   | 3.192.907,09       |                                    |                   | % 100,000 | 3.192.907,09    | 1,13                 |
| Sonstige Vermögensgegenstände   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| Forderungen aus Wertpapier-Darlehen                                   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
|   |  |       | EUR                                   | 304,20             |                                    |                   |           | 1.113.818,24    | 0,39                 |
| Platzhalter   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
|   |  |       | EUR                                   | 1.113.514,04       |                                    |                   |           | 304,20          | 0,00                 |
|   |  |       | EUR                                   |                    |                                    |                   |           | 1.113.514,04    | 0,39                 |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung                                |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
|   |  |       | EUR                                   | -38.140,36         |                                    |                   |           | -38.140,36      | -0,01                |
| Fondsvermögen   |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
| Anteilwert  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
|   |  |       | EUR                                   |                    |                                    |                   |           | 283.169.076,25  | 100,00 <sup>1)</sup> |
| Umlaufende Anteile  |  |       |                                       |                    |                                    |                   |           |                 |                      |
|   |  |       | EUR                                   |                    |                                    |                   |           | 118,19          |                      |
|   |  |       | STK                                   |                    |                                    |                   |           | 2.395.842,00    |                      |

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

<sup>2)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

| ISIN   | Gattungsbezeichnung  | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Wertpapierdarlehen<br>Kurswert in EUR |              | gesamt              |
|--|--|---------------------------------------|---------------------------------------|--------------|---------------------|
|  |  |                                       | befristet                             | unbefristet  |                     |
| Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen<br>Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: |  |                                       |                                       |              |                     |
| IT0005210650   | 1,2500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026 | EUR                                   | 3.000                                 | 3.103.980,00 |                     |
| Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen  |  |                                       |                                       | 3.103.980,00 | <b>3.103.980,00</b> |

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.08.2020

## 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/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|---|--|---------------------------------------|-------------------|----------------------|---------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>   |  |                                       |                   |                      |                     |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |  |                                       |                   |                      |                     |
| <b>Inland</b>   |  |                                       |                   |                      |                     |
| DE0001102408  | 0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026           | EUR                                   | 10.573            | 14.328               |                     |
| DE0001102390  | 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026           | EUR                                   | 10.971            | 14.877               |                     |
| DE0001102382  | 1,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025           | EUR                                   | 5.828             | 9.283                |                     |
| <b>Ausland</b>  |  |                                       |                   |                      |                     |
| FI4000197959  | 0,5000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2026     | EUR                                   | 1.744             | 2.778                |                     |
| FR0013131877  | 0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026          | EUR                                   | 6.044             | 9.627                |                     |
| FR0010916924  | 3,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2010/2026          | EUR                                   | 6.562             | 10.452               |                     |
| IT0005170839  | 1,6000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2016/2026 | EUR                                   | 5.636             | 8.977                |                     |
| IT0005370306  | 2,1000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien 2019/2026  | EUR                                   | 10.344            | 13.499               |                     |
| NL0011819040  | 0,5000 % Niederlande - Anleihe 2016/2026                     | EUR                                   | 4.792             | 7.633                |                     |
| AT0000A1K9C8  | 0,7500 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2026      | EUR                                   | 3.670             | 5.845                |                     |
| ES00000123C7  | 5,9000 % Spanien - Bonos 2011/2026                           | EUR                                   | 5.798             | 9.235                |                     |
| ES00000128H5  | 1,3000 % Spanien - Obligaciones 2016/2026                    | EUR                                   | 17.056            | 20.561               |                     |
| ES00000127G9  | 2,1500 % Spanien - Obligaciones 2015/2025                    | EUR                                   | 6.149             | 9.795                |                     |
| <b>Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):</b> |  |                                       |                   |                      |                     |
| unbefristet   |  | EUR                                   |                   |                      | 172.162             |

(Basiswerte: 0,2500 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 (DE0001102416); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2016/2026 (DE0001102390); 0,5000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2017/2027 (DE0001102424); 1,0000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2015/2025 (DE0001102382); 0,5000 % Finnland, Republik - Anleihe 2017/2027 (FI4000278551); 0,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026 (FR0013200813); 0,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2015/2026 (FR0013131877); 1,0000 % Frankreich - OAT 2016/2027 (FR0013250560); 0,6250 % Luxemburg, Großherzogtum - Bonds 2017/2027 (LU1556942974); 0,7500 % Niederlande - Anleihe 2017/2027 (NL0012171458); 0,5000 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2017/2027 (AT0000A1VVK0); 0,7500 % Österreich, Republik - Bundesanleihe 2016/2026 (AT0000A1K9C8); 4,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2017/2027 (PTOTEUOE0019); 1,2500 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2017/2027 (SI0002103685); 1,5000 % Spanien - Obligaciones 2017/2027 (ES00000128P8))

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich  
für den Zeitraum vom 01.03.2020 bis zum 31.08.2020

|  | insgesamt<br>EUR | insgesamt<br>EUR | je Anteil <sup>1)</sup><br>EUR |
|--|------------------|------------------|--------------------------------|
| <b>I. Erträge</b>  |                  |                  |                                |
| 1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren                          |                  | 89.672,11        | 0,037                          |
| 2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)     |                  | 1.468.760,70     | 0,613                          |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland                       |                  | 0,03             | 0,000                          |
| 4. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften      |                  | 6.702,30         | 0,003                          |
| Summe der Erträge  |                  | 1.565.135,14     | 0,653                          |
| <b>II. Aufwendungen</b>  |                  |                  |                                |
| 1. Verwaltungsvergütung  |                  | -206.916,04      | -0,086                         |
| 2. Sonstige Aufwendungen   |                  | -7.040,11        | -0,003                         |
| davon: Negative Einlagezinsen                                    | -7.040,11        |                  | -0,003                         |
| Summe der Aufwendungen   |                  | -213.956,15      | -0,089                         |
| <b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>                             |                  | 1.351.178,99     | 0,564                          |
| <b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>                                 |                  |                  |                                |
| 1. Realisierte Gewinne   |                  | 2.246.608,76     | 0,938                          |
| 2. Realisierte Verluste  |                  | -449.848,75      | -0,188                         |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften                              |                  | 1.796.760,01     | 0,750                          |
| <b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>              |                  | 3.147.939,00     | 1,314                          |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne               |                  | 1.559.982,17     | 0,651                          |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste              |                  | -382.303,08      | -0,160                         |
| <b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>       |                  | 1.177.679,09     | 0,492                          |
| <b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>                         |                  | 4.325.618,09     | 1,805                          |
| <b>Entwicklung des Sondervermögens</b>                           |                  | 2020 / 2021      |                                |
|  | EUR              | EUR              |                                |
| <b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b> |                  | 80.961.496,47    |                                |
| 1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr                   |                  | -439.042,24      |                                |
| 2. Zwischenausschüttungen  |                  | -810.894,70      |                                |
| 3. Mittelzufluss (netto)   |                  | 199.731.105,92   |                                |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen                     | 232.931.954,92   |                  |                                |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen                    | -33.200.849,00   |                  |                                |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich                            |                  | -599.207,29      |                                |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres                                  |                  | 4.325.618,09     |                                |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne            | 1.559.982,17     |                  |                                |
| davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste           | -382.303,08      |                  |                                |
| <b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>  |                  | 283.169.076,25   |                                |

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

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

## Anhang.

**Angaben nach der Derivateverordnung**  
**Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 3.103.980,00

**Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen**  
 DekaBank Deutsche Girozentrale

|   |            | Kurswert in EUR |                     |
|---|------------|-----------------|---------------------|
|   |            | befristet       | unbefristet         |
| <b>Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:</b>   | <b>EUR</b> |                 | <b>6.441.349,91</b> |
| davon:  |            |                 |                     |
| Aktien  | EUR        |                 | 520.884,69          |
| Schuldverschreibungen   | EUR        |                 | 5.920.465,23        |
| <b>Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)</b> | <b>EUR</b> |                 | <b>4.808,72</b>     |

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 4.808,72. 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 | 118,19       |
| Umlaufende Anteile | STK | 2.395.842,00 |

|  |              |
|--|--------------|
| <b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b> | <b>98,49</b> |
| <b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>    | <b>0,00</b>  |

**Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände**

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.08.2020 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 31.08.2020 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 | 0,07 |
|---|------|

**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.

**Angaben zu den wesentlichen sonstigen Aufwendungen (exklusive Ertragsausgleich)**

In den sonstigen Aufwendungen sind negative Einlagezinsen in Höhe von EUR -5.346,16 enthalten.

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

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

### Verwendete Vermögensgegenstände

|                         |              |
|-------------------------|--------------|
| absolut                 | 3.103.980,00 |
| in % des Fondsvermögens | 1,10         |

### 10 größte Gegenparteien

|                                |                                |
|--------------------------------|--------------------------------|
| Name                           | DekaBank Deutsche Girozentrale |
| Bruttovolumen offene Geschäfte | 3.103.980,00                   |
| 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                     | 3.103.980,00 |

### 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. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

### 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                     | 6.441.349,91 |

# Deka iBoxx € Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

## Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

|                        |          |
|------------------------|----------|
| absolut                | 4.808,72 |
| 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

1,11

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 aussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

|  |                                  |
|--|----------------------------------|
| 1. Name                                      | Landesbank Baden-Württemberg     |
| 1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 2.808.377,60                     |
| 2. Name                                      | SR-Boligkredit A.S.              |
| 2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 1.885.388,26                     |
| 3. Name                                      | Compagnie de Financement Foncier |
| 3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 915.663,07                       |
| 4. Name                                      | Zurich Insurance Group AG        |
| 4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 520.884,69                       |
| 5. Name                                      | Morgan Stanley                   |
| 5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 311.036,30                       |

## 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 | Name                     | 2,00                   |
|                                   | J.P. Morgan AG Frankfurt |                        |
| verwahrter Betrag                 | absolut                  | 3.632.972,31           |
|                                   | Name                     | Clearstream Banking AG |
| verwahrter Betrag                 | absolut                  | 2.808.377,60           |

## 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 1. September 2020  
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 2019

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

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)

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 2020

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](http://www.deka-etf.de)