

Halbjahresbericht
zum 31. August 2020.

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 2020

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 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 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 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 *	0,7%	0,0%	1,7%

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	FI4000219787	0.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(23) 20230914
Löschung	FI4000197959	0.500000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(26) 20260414
Löschung	BE0000347568	0.900000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2019(29) 20290621
Löschung	ES00000128H5	1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030
Löschung	PTOTEXOEO024	1.950000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2019(29) 20290614
Löschung	FI4000079041	2.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2014(2024) 20240414
Löschung	ES00000127G9	2.150000 % Spanien EO-Obligaciones 2015(25) 20251030
Löschung	PTOTESOE0013	2.200000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(22) 20221016
Löschung	FI4000037635	2.750000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2012(2028) 20280703
Löschung	ES00000126B2	2.750000 % Spanien EO-Bonos 2014(24) 20241030
Löschung	IE00B6X95T99	3.400000 % Irland EO-Treasury Bonds 2014(24) 20240317
Löschung	IT0004009673	3.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2006(21) 20210731
Löschung	BE0000308172	4.000000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2006(22) Ser. 48 20220327
Löschung	FI4000006176	4.000000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2009(25) 20250703
Löschung	BE0000321308	4.250000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2011(21) Ser. 61 20210927
Löschung	ES00000122E5	4.650000 % Spanien EO-Obligaciones 2010(25) 20250729
Löschung	IT0004695075	4.750000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2011(21) 20210831
Löschung	BE0000291972	5.500000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 1998(28) Ser. 31 20280327
Löschung	ES00000123K0	5.850000 % Spanien EO-Bonos 2011(22) 20220130
Löschung	ES0000011868	6.000000 % Spanien EO-Bonos 1999(29) 20290130
Neuaufnahme	SI0002103974	0.200000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2020(23) 20230330
Neuaufnahme	IE00BDHDPR44	0.900000 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(28) 20280514
Neuaufnahme	IE00BV8C9418	1.000000 % Irland EO-Treasury Bonds 2016(26) 20260514
Neuaufnahme	SI0002103776	1.000000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2018(28) 20280305
Neuaufnahme	IE00BH3SQ895	1.100000 % Irland EO-Treasury Bonds 2019(29) 20290514
Neuaufnahme	SI0002103842	1.187500 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2019(29) 20290313
Neuaufnahme	SI0002103685	1.250000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27) 20270321
Neuaufnahme	ES00000128H5	1.300000 % Spanien EO-Obligaciones 2016(26) 20261030
Neuaufnahme	PTOTEXOEO024	1.950000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2019(29) 20290614
Neuaufnahme	SI0002103545	2.125000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2015(25) 20250727
Neuaufnahme	IE00BJ38CR43	2.400000 % Irland EO-Treasury Bonds 2014(30) 20300514
Neuaufnahme	FR0011883966	2.500000 % Frankreich EO-OAT 2014(30) 20300524
Neuaufnahme	FR0011317783	2.750000 % Frankreich EO-OAT 2012(27) 20271024
Neuaufnahme	PTOTETOE0012	2.875000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2016(26) 20260720
Neuaufnahme	FR0011196856	3.000000 % Frankreich EO-OAT 2012(22) 20220424
Neuaufnahme	IE00B6X95T99	3.400000 % Irland EO-Treasury Bonds 2014(24) 20240317
Neuaufnahme	FR0010916924	3.500000 % Frankreich EO-OAT 2010(26) 20260424
Neuaufnahme	IT0005024234	3.500000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2014(30) 20300228
Neuaufnahme	FR0010466938	4.250000 % Frankreich EO-OAT 2007(23) 20231024
Neuaufnahme	IT0004513641	5.000000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2009(25) 20250228
Neuaufnahme	IE00B4TV0D44	5.400000 % Irland EO-Treasury Bonds 2009(25) 20250312

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
IE00B4TV0D44	5.400000	% Irland EO-Treasury Bonds 2009(25) 20250312	5,07
IT0001278511	5.250000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 1998(29) 20291031	4,77
IT0001174611	6.500000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 1997(27) 20271031	4,49
PTOTEKOE0011	2.875000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25) 20251014	4,48
FR0011883966	2.500000	% Frankreich EO-OAT 2014(30) 20300524	4,26
IE00BV8C9418	1.000000	% Irland EO-Treasury Bonds 2016(26) 20260514	4,21
PTOTEQOE0015	5.650000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2013(24) 20240214	4,19
FR0011317783	2.750000	% Frankreich EO-OAT 2012(27) 20271024	4,13
IE00BJ38CR43	2.400000	% Irland EO-Treasury Bonds 2014(30) 20300514	4,07
FR0010916924	3.500000	% Frankreich EO-OAT 2010(26) 20260424	4,04
PTOTEAOE0021	4.950000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2008(23) 20231024	3,97
FR0010466938	4.250000	% Frankreich EO-OAT 2007(23) 20231024	3,86
PTOTETOE0012	2.875000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2016(26) 20260720	3,72
IT0005024234	3.500000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2014(30) 20300228	3,71
IE00BH3SQ895	1.100000	% Irland EO-Treasury Bonds 2019(29) 20290514	3,69
FR0011196856	3.000000	% Frankreich EO-OAT 2012(22) 20220424	3,66
IT0004513641	5.000000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2009(25) 20250228	3,59
PTOTEVOE0018	2.125000	% Portugal, Republik EO-Obr. 2018(28) 20281016	3,55
IT0004356843	4.750000	% Italien, Republik EO-B.T.P. 2008(23) 20230731	3,40
IE00BDHDPR44	0.900000	% Irland EO-Treasury Bonds 2018(28) 20280514	3,07
SK4120009762	3.625000	% Slowakei EO-Anl. 2014(29) 20290115	2,53
SK4120007543	4.350000	% Slowakei EO-Anl. 2010(25) 20251013	2,49
SK4120008871	3.375000	% Slowakei EO-Anl. 2012(24) 20241114	2,33
SI0002103685	1.250000	% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27) 20270321	2,19
SK4120009044	3.000000	% Slowakei EO-Anl. 2013(23) 20230227	2,18
SK4120010430	1.375000	% Slowakei EO-Anl. 2015(27) 20270120	2,15
SI0002103776	1.000000	% Slowenien, Republik EO-Bonds 2018(28) 20280305	1,70
SI0002103842	1.187500	% Slowenien, Republik EO-Bonds 2019(29) 20290313	1,54
SI0002103545	2.125000	% Slowenien, Republik EO-Bonds 2015(25) 20250727	1,50
SI0002103974	0.200000	% Slowenien, Republik EO-Bonds 2020(23) 20230330	1,48

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2020.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		22.605.556,74	100,01
1. Anleihen		22.161.842,32	98,05
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	2.374.118,12		10,50
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	5.430.539,57		24,03
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	5.158.964,58		22,82
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	9.198.220,05		40,70
2. Forderungen		323.058,30	1,43
3. Bankguthaben		120.656,12	0,53
II. Verbindlichkeiten		-3.066,65	-0,01
III. Fondsvermögen		22.602.490,09	100,00

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

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 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									
Ausland									
FR0011883966	2,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2013/2030	EUR		749	749	0	% 126,025	943.928,75	4,18
FR0011317783	2,7500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2011/2027	EUR		747	747	0	% 122,552	915.466,43	4,05
FR0011196856	3,0000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2011/2022	EUR		767	767	0	% 105,939	812.555,20	3,59
FR0010916924	3,5000 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2010/2026	EUR		730	730	0	% 122,722	895.873,52	3,96
FR0010466938	4,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2006/2023	EUR		742	742	0	% 115,365	856.011,27	3,79
IE00BDHDP44	0,9000 % Irland - Treasury Bonds 2018/2028	EUR		625	1.153	528	% 108,785	679.906,25	3,01
IE00BV8C9418	1,0000 % Irland - Treasury Bonds 2016/2026	EUR		864	1.594	730	% 107,978	932.929,92	4,13
IE00BH3SQ895	1,1000 % Irland - Treasury Bonds 2019/2029	EUR		736	1.269	533	% 110,920	816.371,20	3,61
IE00BJ38CR43	2,4000 % Irland - Treasury Bonds 2014/2030 ²⁾	EUR		726	726	0	% 124,274	902.229,24	3,99
IE00B4TV0D44	5,4000 % Irland - Treasury Bonds 2009/2025	EUR		887	1.637	750	% 126,751	1.124.277,82	4,97
IT0005024234	3,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2014/2030	EUR		673	1.196	523	% 122,079	821.590,32	3,63
IT0004356843	4,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2008/2023	EUR		663	882	1.714	% 113,504	752.531,52	3,33
IT0004513641	5,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2009/2025	EUR		661	1.174	513	% 120,304	795.209,44	3,52
IT0001278511	5,2500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 1998/2029	EUR		772	1.024	1.992	% 136,965	1.057.368,26	4,68
IT0001174611	6,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 1997/2027	EUR		716	958	1.870	% 138,920	994.667,20	4,40
PTOTEV0E0018	2,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2018/2028	EUR		683	938	1.851	% 115,255	787.190,28	3,48
PTOTEK0E0011	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025	EUR		859	1.123	2.049	% 115,494	992.093,46	4,39
PTOTET0E0012	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2016/2026	EUR		704	704	0	% 117,249	825.434,37	3,65
PTOTEAOE0021	4,9500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2008/2023	EUR		753	1.035	2.042	% 116,690	878.675,70	3,89
PTOTEQ0E0015	5,6500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2013/2024	EUR		770	1.058	2.087	% 120,609	928.687,76	4,11
SK4120010430	1,3750 % Slowakei - Anleihe 2015/2027	EUR		429	641	812	% 110,990	476.147,10	2,11
SK4120009044	3,0000 % Slowakei - Anleihe 2013/2023	EUR		443	663	840	% 108,820	482.072,60	2,13
SK4120008871	3,3750 % Slowakei - Anleihe 2012/2024	EUR		443	663	840	% 116,414	515.713,58	2,28
SK4120009762	3,6250 % Slowakei - Anleihe 2014/2029	EUR		425	639	792	% 132,151	561.640,05	2,48
SK4120007543	4,3500 % Slowakei - Anleihe 2010/2025	EUR		443	663	840	% 124,441	551.272,74	2,44
SI0002103974	0,2000 % Slowenien, Republik - Anleihe 2020/2023	EUR		322	549	227	% 101,540	326.958,80	1,45
SI0002103776	1,0000 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2018/2028	EUR		347	619	272	% 108,533	376.610,97	1,67
SI0002103842	1,1875 % Slowenien, Republik - Anleihe 2019/2029	EUR		310	553	243	% 110,081	341.251,10	1,51
SI0002103685	1,2500 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2017/2027	EUR		443	789	346	% 109,529	485.213,47	2,15
SI0002103545	2,1250 % Slowenien, Republik - Registered Bonds 2015/2025	EUR		296	526	230	% 112,150	331.964,00	1,47
Summe Wertpapiervermögen							EUR	22.161.842,32	98,05
Bankguthaben, nicht verbrieft							EUR	120.656,12	0,53
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	120.656,12	0,53
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle							EUR	120.656,12	0,53
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	323.058,30	1,43
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung							EUR	7.445,46	0,03
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen							EUR	4.987,89	0,02
Zinsansprüche							EUR	310.624,95	1,37
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-3.066,65	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung							EUR	-3.066,65	-0,01
Fondsvermögen							EUR	22.602.490,09	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	97,95	

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

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
	Umlaufende Anteile						STK	230.747,00	

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.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Wertpapierdarlehen Kurswert in EUR	befristet	unbefristet	gesamt
	Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen					
	Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:					
IE00BJ38CR43	2,4000 % Irland - Treasury Bonds 2014/2030	EUR	600		745.644,00	
	Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen				745.644,00	745.644,00

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/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
	Börsengehandelte Wertpapiere				
	Verzinsliche Wertpapiere				
	Ausland				
BE0000347568	0,9000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2029	EUR	950	2.706	
BE0000308172	4,0000 % Belgien, Königreich - Obligations 2006/2022	EUR	969	2.760	
BE0000321308	4,2500 % Belgien, Königreich - Obligations 2011/2021	EUR	1.166	3.321	
BE0000291972	5,5000 % Belgien, Königreich - Obligations 1997/2028	EUR	1.329	3.790	
FI4000219787	0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2023	EUR	612	1.744	
FI4000197959	0,5000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2026	EUR	616	1.753	
FI4000079041	2,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2014/2024	EUR	559	1.593	
FI4000037635	2,7500 % Finnland, Republik - Government Bonds 2012/2028	EUR	559	1.593	
FI4000006176	4,0000 % Finnland, Republik - Bonds 2009/2025	EUR	671	1.912	
IE00B6X95T99	3,4000 % Irland - Treasury Bonds 2014/2024	EUR	1.145	1.145	
IT0004009673	3,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2006/2021	EUR	918	2.615	
IT0004695075	4,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2011/2021	EUR	815	2.322	
PTOTEXOEO024	1,9500 % Portugal, Republik - Obligations 2019/2029	EUR	1.217	1.217	
PTOTESOE0013	2,2000 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2022	EUR	818	2.332	
ES00000126B2	2,7500 % Spanien - Bonos 2014/2024	EUR	982	2.599	
ES00000123K0	5,8500 % Spanien - Bonos 2011/2022	EUR	928	2.459	
ES0000011868	6,0000 % Spanien - Bonos 1999/2029	EUR	1.032	2.735	
ES00000128H5	1,3000 % Spanien - Obligaciones 2016/2026	EUR	1.359	1.359	
ES00000127G9	2,1500 % Spanien - Obligaciones 2015/2025	EUR	957	2.507	
ES00000122E5	4,6500 % Spanien - Obligaciones 2010/2025	EUR	827	2.356	
	Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):				
	unbefristet	EUR			41.873

(Basiswerte: 0,9000 % Belgien, Königreich - Obligations 2019/2029 (BE0000347568); 0,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2023 (FI4000219787); 0,5000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2016/2026 (FI4000197959); 2,0000 % Finnland, Republik - Government Bonds 2014/2024 (FI4000079041); 2,7500 % Finnland, Republik - Government Bonds 2012/2028 (FI4000037635); 4,0000 % Finnland, Republik - Bonds 2009/2025 (FI4000006176); 4,2500 % Frankreich - Obl. ass. du Trésor 2006/2023 (FR0010466938); 0,9000 % Irland - Treasury Bonds 2018/2028 (IE00BDHDP44); 1,0000 % Irland - Treasury Bonds 2016/2026 (IE00BV8C9418); 3,4000 % Irland - Treasury Bonds 2014/2024 (IE00B6X95T99); 5,4000 % Irland - Treasury Bonds 2009/2025 (IE00B4TV0D44); 3,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2006/2021 (IT0004009673); 2,1250 % Portugal, Republik - Obligaciones 2018/2028 (PTOTEV0E0018); 2,2000 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2022 (PTOTESOE0013); 2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025 (PTOTEKOE0011); 4,9500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2008/2023 (PTOTEAOE0021); 3,6250 % Slowakei - Anleihe 2014/2029 (SK4120009762); 1,1875 % Slowenien, Republik - Anleihe 2019/2029 (SI0002103842))

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.04.2020 bis zum 31.08.2020

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		326.439,06	1,415
2. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		5.474,23	0,024
Summe der Erträge		331.913,29	1,438
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-16.801,89	-0,073
2. Sonstige Aufwendungen		-687,03	-0,003
davon: Negative Einlagezinsen	-687,03		-0,003
Summe der Aufwendungen		-17.488,92	-0,076
III. Ordentlicher Nettoertrag		314.424,37	1,363
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		53.334,92	0,231
2. Realisierte Verluste		-817.867,97	-3,544
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-764.533,05	-3,313
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-450.108,68	-1,951
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		13.113,95	0,057
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		350.033,69	1,517
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		363.147,64	1,574
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-86.961,04	-0,377

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2020 / 2021 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		50.514.080,85
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-482.565,60
2. Zwischenausschüttungen		-184.597,60
3. Mittelzufluss (netto)		-26.614.127,30
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	29.379.712,74	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-55.993.840,04	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-543.339,22
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-86.961,04
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	13.113,95	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	350.033,69	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		22.602.490,09

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 **745.644,00**

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen
 DekaBank Deutsche Girozentrale

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:	EUR		2.005.838,01
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		2.005.838,01
Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	EUR		5.810,70

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 5.810,70. 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	97,95
Umlaufende Anteile	STK	230.747,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,05
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 31.08.2020 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	0,21
---	------

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 -1.116,94 enthalten.

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

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

Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	745.644,00
in % des Fondsvermögens	3,30

10 größte Gegenparteien

Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	745.644,00
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	745.644,00

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	2.005.838,01

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut	5.810,70
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

3,36

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.

Deka Eurozone Rendite Plus 1-10 UCITS ETF

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Bayerische Landesbank
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.998.272,78
2. Name	Deutsche Bahn Finance GmbH
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5.508,90
3. Name	Commerzbank AG
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.039,75
4. Name	Daimler International Finance B.V
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.016,58

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

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer Name	2,00 Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	2.004.821,43
Name	J.P. Morgan AG Frankfurt
verwahrter Betrag absolut	1.016,58

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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