

Halbjahresbericht
zum 31. August 2023.

**Deka iBoxx € Liquid Germany
Covered Diversified UCITS ETF**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

.iDeka
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 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF für den Zeitraum vom 1. März 2023 bis zum 31. August 2023.

Im Berichtszeitraum entfernten sich die Teuerungsraten sukzessive von ihren Höchstständen und sorgten damit für eine gewisse Entlastung an den Finanzmärkten. Demgegenüber hat sich in Deutschland und im Euroraum die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten veranlasste. Während die Fed bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt ist, hob die EZB die Leitzinsen bis auf 4,25 Prozent an. An den Rentenmärkten hielten sich die Ausschläge nach dem deutlichen Renditeanstieg in 2022 in Erwartung eines zukünftig weniger restriktiven Vorgehens der Notenbanken in Grenzen. Zum Ende der Berichtsperiode rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen bei 4,1 Prozent.

Das Gros der globalen Aktienbörsen wies trotz zwischenzeitlicher Belastungsfaktoren im Bankensektor sowie der Auswirkungen steigender Leitzinsen eine Aufwärtsbewegung aus. Insbesondere in den USA und Japan konnten die Indizes starke Zuwächse verbuchen. Der Euro bewegte sich im Verhältnis zum US-Dollar in einer überschaubaren Bandbreite und lag Ende August bei 1,09 US-Dollar. Der Ölpreis tendierte unter Schwankungen seitwärts und beendete die Berichtsperiode bei 86,9 US-Dollar je Barrel (Brent).

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 2023	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2023	9
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	13

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified 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 Germany Covered Diversified (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der 30 größten und umsatzstärksten deutschen Jumbo Pfandbriefe ab. 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).

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 Germany Covered Diversified UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	2,3%	-2,1%	-5,1%
ISIN	DE000ETFL359		

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

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS2106576494	0.010000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H342 v.20(25) 20250121
Löschung	DE000HV2AYS3	0.375000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2116 v.22(33) 20330116
Löschung	DE000HV2AYU9	0.500000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-OPF S.2118 v.22(27) 20270222
Löschung	DE000CZ45W99	2.250000 % Commerzbank AG MTH S.P55 v.22(32) 20320831
Löschung	DE000CZ43ZJ6	2.750000 % Commerzbank AG MTH S.P58 v.22(25) 20251207
Löschung	DE000LB381U7	2.750000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 22(24)R.832 20241017
Neuaufnahme	DE000HV2AY79	2.750000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2131 v.22(26) 20260226
Neuaufnahme	DE000CZ43ZS7	2.875000 % Commerzbank AG MTH S.P59 v.23(26) 20260427
Neuaufnahme	DE000MHB32J7	3.000000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2014 v.22(27) 20270803
Neuaufnahme	DE000AAR0389	3.125000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.256 v.2023(2026) 20260212
Neuaufnahme	DE000CZ43ZX7	3.125000 % Commerzbank AG MTH S.P61 v.23(29) 20290419
Neuaufnahme	DE000HV2AZG5	3.125000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-OPF S.2140 v.23(25) 20250819

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS2536375368	2.375000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H357 v.22(26) 20260920	4,80
DE000CZ45W16	0.500000 % Commerzbank AG MTH S.P49 v.22(27) 20270314	4,47
DE000A2YNWA1	0.625000 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(29) 20290224	4,30
DE000CZ43ZX7	3.125000 % Commerzbank AG MTH S.P61 v.23(29) 20290419	4,09
DE000HV2AZG5	3.125000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-OPF S.2140 v.23(25) 20250819	4,08
DE000MHB33J5	2.750000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2017 v.23(25) 20250923	3,97
DE000HV2AS10	0.250000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2071 v.20(32) 20320114	3,87
XS2433126807	0.010000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H346 v.22(27) 20270718	3,63
DE000MHB31J9	1.875000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2000 v.22(32) 20320824	3,55
DE000A1KRJV6	0.010000 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.2021(2028) 20281006	3,50
DE000CZ45VS1	0.010000 % Commerzbank AG MTH S.P36 v.20(30) 20300310	3,35
DE000MHB32J7	3.000000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2014 v.22(27) 20270803	3,26
DE000A30V2V0	3.000000 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.22(28) 20280327	3,25
DE000HV2AZC4	3.000000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2136 v.23(26) 20260712	3,25
DE000LB384E5	2.875000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.834 v.23(26) 20260322	3,25
DE000HV2AY79	2.750000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2131 v.22(26) 20260226	3,23
DE000LB38077	2.375000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 22(27)R.831 20270225	3,19
DE000A30VPC2	2.250000 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.22(27) 20270919	3,16
DE000BHYOGK6	1.250000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(25) 20250824	3,15
DE000CZ43ZS7	2.875000 % Commerzbank AG MTH S.P59 v.23(26) 20260427	3,14
DE000A2YNWB9	2.375000 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(30) 20300912	3,13
DE000LB2ZV93	1.750000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.829 v.22(28) 20280227	3,09
DE000A3E5UY4	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1239 21(26) 20261025	2,96
DE000MHB30J1	1.250000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1989 v.22(30) 20300213	2,93
DE000A3MP619	0.750000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1242 22(29) 20291120	2,84
DE000A3H2TQ6	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1235 21(29) 20290419	2,76
XS2056484889	0.010000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H337 v.2019(29) 20290925	2,72
DE000A3H2TK9	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1234 21(30) 20300328	2,68
DE000AAR0389	3.125000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.256 v.2023(2026) 20260212	2,44
DE000BHYOH34	0.125000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.21(30) 20300117	1,96

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		73.561.828,26	100,01
1. Anleihen		72.799.494,90	98,97
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	19.271.956,31		26,20
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	23.181.557,83		31,52
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	22.664.493,97		30,81
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	7.681.486,79		10,44
2. Forderungen		556.082,74	0,76
3. Bankguthaben		206.250,62	0,28
II. Verbindlichkeiten		-6.481,19	-0,01
III. Fondsvermögen		73.555.347,07	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
Inland										
DE000AAR0389	3,1250 % Aareal Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2026		EUR	1.793	1.864	71	% 98,995	1.774.980,35	2,41	
DE000BHY0H34	0,1250 % Berlin Hyp AG - Hyp. Pfandbriefe 2021/2030		EUR	1.719	97	3.495	% 82,738	1.422.272,58	1,93	
DE000BHY0GK6	1,2500 % Berlin Hyp AG - Hyp. Pfandbriefe 2022/2025		EUR	2.391	108	2.834	% 95,746	2.289.292,84	3,11	
DE000CZ45V51	0,0100 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2020/2030		EUR	2.989	136	3.544	% 81,525	2.436.770,59	3,31	
DE000CZ45W16	0,5000 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2022/2027		EUR	3.586	161	4.251	% 90,646	3.250.547,63	4,42	
DE000CZ43Z57	2,8750 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2026		EUR	2.317	2.440	123	% 98,678	2.286.369,26	3,11	
DE000CZ43ZX7	3,1250 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2029		EUR	2.989	3.107	118	% 99,490	2.973.769,85	4,04	
DE000A30VPC2	2,2500 % Deutsche Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.400	100	2.800	% 96,101	2.306.429,28	3,14	
DE000A30V2V0	3,0000 % Deutsche Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2028		EUR	2.400	100	2.800	% 98,883	2.373.200,88	3,23	
DE000A3E5UY4	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2026		EUR	2.391	108	2.834	% 90,072	2.153.618,17	2,93	
DE000A3H2TQ6	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2029		EUR	2.391	108	2.834	% 83,882	2.005.618,62	2,73	
DE000A3H2TK9	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2030		EUR	2.391	108	2.834	% 81,459	1.947.687,80	2,65	
DE000A3MP619	0,7500 % DZ HYP AG - Pfandbriefe 2022/2029		EUR	2.391	108	2.834	% 86,465	2.067.368,35	2,81	
DE000A1KRJV6	0,0100 % ING-DiBa AG - Hyp. Pfandbriefe 2021/2028		EUR	3.000	100	3.500	% 85,153	2.554.595,70	3,47	
DE000A2YNWB9	2,3750 % ING-DiBa AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2030		EUR	2.400	100	2.800	% 95,070	2.281.672,80	3,10	
DE000LB2ZV93	1,7500 % Landesbank Baden-Württemberg - Pfandbriefe 2022/2028		EUR	2.391	108	2.834	% 94,069	2.249.196,25	3,06	
DE000LB38077	2,3750 % Landesbank Baden-Württemberg - Öff. MT Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.400	100	2.800	% 97,000	2.327.995,68	3,16	
DE000LB384E5	2,8750 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2026		EUR	2.391	108	2.834	% 98,761	2.361.366,90	3,21	
XS2433126807	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027		EUR	3.000	100	3.500	% 88,289	2.648.681,70	3,60	
XS2056484889	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Öff. MT Pfandbriefe 2019/2029		EUR	2.400	300	2.500	% 82,823	1.987.742,16	2,70	
XS2536375368	2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2026		EUR	3.600	100	4.200	% 97,284	3.502.217,16	4,76	
DE000MHB30J1	1,2500 % Münchener Hypothekenbank eG - Pfandbriefe 2022/2030		EUR	2.391	108	2.834	% 89,052	2.129.222,08	2,89	
DE000MHB31J9	1,8750 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2032		EUR	2.869	605	2.853	% 90,075	2.584.258,92	3,51	
DE000MHB33J5	2,7500 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2025		EUR	2.929	667	2.855	% 98,515	2.885.512,84	3,92	
DE000MHB32J7	3,0000 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.391	2.485	94	% 99,108	2.369.671,08	3,22	
DE000A2YNWA1	0,6250 % NG-DiBa AG - Pfandbriefe 2022/2029		EUR	3.600	100	4.200	% 87,207	3.139.446,24	4,27	
DE000HV2AS10	0,2500 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2032		EUR	3.586	161	4.251	% 78,515	2.815.555,07	3,83	
DE000HV2AY79	2,7500 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2026		EUR	2.391	2.485	94	% 98,192	2.347.764,03	3,19	
DE000HV2AZC4	3,0000 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2026		EUR	2.391	108	2.834	% 98,802	2.362.364,91	3,21	
DE000HV2AZG5	3,1250 % UniCredit Bank AG - Öff. MT Pfandbriefe 2023/2025		EUR	2.989	3.107	118	% 99,174	2.964.305,18	4,03	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	72.799.494,90	98,97
Bankguthaben, nicht verbrieft								EUR	206.250,62	0,28
Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	206.250,62	0,28
EUR-Guthaben bei Verwahrstelle								EUR	100,000	0,28
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	556.082,74	0,76
Zinsansprüche								EUR	556.082,74	0,76
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-6.481,19	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung								EUR	-6.481,19	-0,01

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Fondsvermögen						EUR	73.555.347,07	100,00 ¹⁾
	Anteilwert						EUR	96,46	
	Umlaufende Anteile						STK	762.510,00	

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

Kurse per 31.08.2023

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					
Inland					
DE000CZ45W99	2,2500 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2032	EUR	97	5.214	
DE000CZ43ZJ6	2,7500 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2025	EUR	97	5.214	
DE000LB381U7	2,7500 % Landesbank Baden-Württemberg - Öff. MT Pfandbriefe 2022/2024	EUR	100	5.200	
XS2106576494	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2020/2025	EUR	100	6.500	
DE000HV2AYS3	0,3750 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2033	EUR	100	5.200	
DE000HV2AYU9	0,5000 % UniCredit Bank AG - Pfandbriefe 2022/2027	EUR	100	5.200	

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2023 bis zum 31.08.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		572.287,95	0,751
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		1.884,97	0,002
Summe der Erträge		574.172,92	0,753
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-72,30	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-34.376,08	-0,045
3. Sonstige Aufwendungen		-0,01	0,000
Summe der Aufwendungen		-34.448,39	-0,045
III. Ordentlicher Nettoertrag		539.724,53	0,708
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		151,14	0,000
2. Realisierte Verluste		-4.069.615,74	-5,337
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-4.069.464,60	-5,337
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-3.529.740,07	-4,629
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		685,82	0,001
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		6.506.238,54	8,533
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		6.506.924,36	8,534
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.977.184,29	3,904

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2022 / 2023 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		150.996.261,07
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-478.443,60
2. Zwischenausschüttungen		-301.153,80
3. Mittelzufluss (netto)		-79.153.220,10
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	3.217.868,90	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-82.371.089,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-485.280,79
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.977.184,29
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	685,82	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	6.506.238,54	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		73.555.347,07

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

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung

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

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	96,46
Umlaufende Anteile	STK	762.510,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,97

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 31.08.2023 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 31.08.2023 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 (annualisiert)

0,09

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

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

Frankfurt am Main, den 1. September 2023

Deka Investment GmbH

Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Lyoner Straße 13
60528 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 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,1 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 Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH, Köln
und der Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

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

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Europa-Allee 91
60486 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 2023

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



Deka Investment GmbH

Lyoner Straße 13
60528 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

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

