

Halbjahresbericht
zum 31. August 2020.

**Deka iBoxx € Liquid
Corporates Diversified 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 Corporates Diversified 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	11
Vermögensaufstellung zum 31. August 2020	12
Anhang	18
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	21

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 Corporates Diversified UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Corporates 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 Corporates Diversified (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet das Segment der 75 größten und umsatzstärksten europäischen Unternehmensanleihen 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).

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 Corporates Diversified UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	-0,1%	-1,0%	1,5%

ISIN DE000ETFL375

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

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS2049616464	0.000000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2019(19/21) 20210904
Löschung	XS2020568734	0.050000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240630
Löschung	XS2080581189	0.125000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H339 v.19(24) 20241118
Löschung	XS2078734626	0.125000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2019(27) 20271107
Löschung	XS2049616621	0.125000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290904
Löschung	XS2013536029	0.125000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2019(24) 20240617
Löschung	FR0013358116	0.200000 % HSBC France S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(21) 20210903
Löschung	XS2014287937	0.250000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2019(24) 20240618
Löschung	XS2118276026	0.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(29) 20290219
Löschung	FR0013365491	0.250000 % Société Générale S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(22) 20220117
Löschung	CH0520042489	0.250000 % UBS Group AG EO-FLR Notes 2020(25/26) 20260128
Löschung	XS2079713322	0.375000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2019(26) 20261114
Löschung	XS2103014291	0.375000 % E.ON SE Medium Term Notes v.20(27/27) 20270928
Löschung	XS1914937021	0.375000 % ING Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(21) 20211125
Löschung	FR0013447604	0.375000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2019(27) 20270916
Löschung	XS2018637913	0.375000 % Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2019(24) 20240626
Löschung	XS2100690036	0.375000 % Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2020(25) 20250116
Löschung	DE000LB1DVL8	0.500000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 783 v.17(22) 20220606
Löschung	XS2078918781	0.500000 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2019(24/25) 20251111
Löschung	XS2102283061	0.600000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2020(27) 20270114
Löschung	FR0013429073	0.625000 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240925
Löschung	DE000A2RYD83	0.625000 % Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20230226
Löschung	XS2107315470	0.625000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(30) 20300122
Löschung	XS2078737215	0.625000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTNs 2019(29) 20291111
Löschung	FR0013412947	0.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(26) 20260607
Löschung	BE0002272418	0.750000 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2017(22) 20220228
Löschung	XS2001737324	0.750000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2019(19/26) 20260530
Löschung	FR0013324340	1.000000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/26) 20260320
Löschung	BE0002631126	1.125000 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240124
Löschung	XS2148372696	1.125000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(26/26) 20260331
Löschung	XS2154418144	1.125000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(24) 20240406
Löschung	XS2001737910	1.125000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) 20290530
Löschung	XS1586555861	1.125000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2017(23) 20231001
Löschung	XS2156506854	1.250000 % Naturgy Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260114
Löschung	XS2147133495	1.250000 % Unilever N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20250324
Löschung	XS1557268221	1.375000 % Banco Santander S.A. EO-2nd Ranking Notes 2017(22) 20220208
Löschung	XS1605365193	1.375000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2017(27) 20270502
Löschung	XS1557095616	1.375000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(27) 20270129
Löschung	FR0013504644	1.375000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20250326
Löschung	XS1637333748	1.500000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/27) 20270622
Löschung	XS2148390755	1.500000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(30/30) 20300331
Löschung	XS2154418730	1.500000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(28) 20280406
Löschung	XS2147133578	1.750000 % Unilever N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300324

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS1961772560	1.788000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) 20290311
Löschung	XS1586555945	1.875000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2017(27) 20270329
Löschung	FR0013507860	2.000000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/29) 20290414
Löschung	FR0013505625	2.125000 % Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/26) 20261001
Löschung	XS1967635977	2.375000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270926
Löschung	XS2135799679	2.519000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2020(28) 20280406
Löschung	FR0013505260	2.625000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20271214
Löschung	FR0013510179	2.875000 % Auchan Holding S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/26) 20260128
Löschung	XS2157526315	2.950000 % Gaz Finance PLC EO-M.-T.LPN 20(25) Gazprom 20250414
Neuaufnahme	XS1976945722	0.000000 % ING Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(22) 20220407
Neuaufnahme	XS2118276539	0.000000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230219
Neuaufnahme	DE000A289DB1	0.101000 % BASF SE MTN v.2020(2020/2023) 20230604
Neuaufnahme	XS2197342129	0.125000 % OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(24) 20240630
Neuaufnahme	XS2182049291	0.125000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(22) 20220604
Neuaufnahme	FR0013486701	0.125000 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26) 20260223
Neuaufnahme	DE000A289DC9	0.250000 % BASF SE MTN v.2020(2020/2027) 20270604
Neuaufnahme	XS2207657417	0.250000 % Nationwide Building Society EO-Preferred MTN 2020(25) 20250721
Neuaufnahme	XS2118276026	0.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(29) 20290219
Neuaufnahme	XS2176534282	0.250000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230518
Neuaufnahme	XS2177575177	0.375000 % E.ON SE Medium Term Notes v.20(23/23) 20230419
Neuaufnahme	XS2171210862	0.375000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25) 20250511
Neuaufnahme	XS2113889351	0.500000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(27) 20270203
Neuaufnahme	XS2171874519	0.500000 % Nordea Bank Abp EO-Preferred Med.-T.Nts 20(27) 20270513
Neuaufnahme	XS2014292937	0.500000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.19(22) 20220619
Neuaufnahme	FR0013509726	0.625000 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250427
Neuaufnahme	XS1972547183	0.625000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.19(22) 20220331
Neuaufnahme	XS2182404298	0.750000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2020(25) 20250603
Neuaufnahme	FR0013386539	0.750000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(23) 20230614
Neuaufnahme	FR0013506508	0.750000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) 20250406
Neuaufnahme	XS2149270477	0.750000 % UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2020(23/23) 20230420
Neuaufnahme	FR0013508512	1.000000 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(25/26) 20260421
Neuaufnahme	XS1789751531	1.000000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/26) 20260325
Neuaufnahme	XS2156510021	1.000000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250414
Neuaufnahme	XS2199266268	1.125000 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/30) 20300105
Neuaufnahme	XS2148372696	1.125000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(26/26) 20260331
Neuaufnahme	XS2154418144	1.125000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(24) 20240406
Neuaufnahme	XS2177441990	1.201000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270820
Neuaufnahme	XS2180510732	1.250000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2020(25) 20250527
Neuaufnahme	XS2156506854	1.250000 % Naturgy Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260114
Neuaufnahme	XS2147133495	1.250000 % Unilever N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20250324
Neuaufnahme	XS2185867830	1.375000 % Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260608
Neuaufnahme	XS2168647357	1.375000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26) 20260104
Neuaufnahme	FR0013504644	1.375000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/25) 20250326

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	FR0013324357	1.375000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/30) 20300320
Neuaufnahme	XS2153406868	1.491000 % Total Capital Intl S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270407
Neuaufnahme	XS1840618059	1.500000 % Bayer Capital Corp. B.V. EO-Notes 2018(18/26) 20260625
Neuaufnahme	XS1917601582	1.500000 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/24) 20241203
Neuaufnahme	XS2148390755	1.500000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(30/30) 20300331
Neuaufnahme	XS1789752182	1.500000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/30) 20300325
Neuaufnahme	XS2154418730	1.500000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(28) 20280406
Neuaufnahme	XS2185867913	1.625000 % Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300608
Neuaufnahme	XS2147133578	1.750000 % Unilever N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300324
Neuaufnahme	FR0013507860	2.000000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/29) 20290414
Neuaufnahme	FR0013505625	2.125000 % Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/26) 20261001
Neuaufnahme	XS2135799679	2.519000 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2020(28) 20280406
Neuaufnahme	FR0013505260	2.625000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20271214
Neuaufnahme	DE000A289RN6	2.625000 % Daimler AG Medium Term Notes v.20(25) 20250406
Neuaufnahme	FR0013505633	2.750000 % Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300401
Neuaufnahme	FR0013510179	2.875000 % Auchan Holding S.A. EO-Med.-T. Nts 2020(20/26) 20260128
Neuaufnahme	XS2157526315	2.950000 % Gaz Finance PLC EO-M.-T.LPN 20(25) Gazprom 20250414
Neuaufnahme	XS2148623106	3.500000 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2020(25/26) 20260331

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
FR0013398070	2.125000	% BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) 20270122	2,25
FR0013324357	1.375000	% Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/30) 20300320	2,05
BE6301510028	1.150000	% Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2018(18/27) 20270121	1,93
XS2149270477	0.750000	% UBS AG (London Branch) EO-Medium-Term Nts 2020(23/23) 20230420	1,88
XS2079723552	0.050000	% DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231113	1,85
XS1840618059	1.500000	% Bayer Capital Corp. B.V. EO-Notes 2018(18/26) 20260625	1,70
CH0409606354	1.250000	% UBS Group AG EO-FLR Notes 2018(24/25) 20250416	1,67
FR0013324332	0.500000	% Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/23) 20230320	1,64
XS1856833543	0.500000	% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2018(22) 20221115	1,63
DE000A2R9ZT1	0.250000	% Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231105	1,60
FR0013482833	0.125000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) 20280210	1,60
FR0013505633	2.750000	% Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300401	1,58
XS1882544973	2.000000	% ING Groep N.V. EO-Med.-T.Resolut.Nts 2018(28) 20280919	1,57
XS2148623106	3.500000	% Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2020(25/26) 20260331	1,56
XS1958307461	1.750000	% Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 20290304	1,51
DE000A289RN6	2.625000	% Daimler AG Medium Term Notes v.20(25) 20250406	1,51
XS1948611840	1.500000	% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(29) 20290205	1,50
XS2153406868	1.491000	% Total Capital Intl S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270407	1,49
FR0013386539	0.750000	% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(23) 20230614	1,46
XS1960678255	1.125000	% Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/27) 20270306	1,46
XS1789751531	1.000000	% Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/26) 20260325	1,46
FR0013506508	0.750000	% LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) 20250406	1,43
XS1935139995	0.875000	% ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24) 20240114	1,43
XS2168647357	1.375000	% Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26) 20260104	1,43
FR0013508512	1.000000	% Crédit Agricole S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(25/26) 20260421	1,42
FR0013509726	0.625000	% BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) 20250427	1,42
XS1948612905	0.625000	% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23) 20231005	1,41
XS2171210862	0.375000	% Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25) 20250511	1,41
XS2199266268	1.125000	% Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/30) 20300105	1,40
FR0013463668	0.375000	% EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20271126	1,40
XS1960678099	0.375000	% Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/23) 20230306	1,39
FR0013463650	0.125000	% EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/25) 20250526	1,39
XS1788515861	0.625000	% NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2018(22) 20220301	1,39
XS2182049291	0.125000	% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(22) 20220604	1,39
FR0013476199	0.250000	% BPCE S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(26) 20260114	1,39
FR0013422003	0.000000	% Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2019(22) 20220526	1,38
FR0013422011	1.375000	% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 20290527	1,32
FR0013396520	2.000000	% Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) 20290114	1,31
XS1789752182	1.500000	% Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2018(18/30) 20300325	1,28
XS1681521081	1.715000	% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2017(17/28) 20280111	1,26
XS1664644983	2.250000	% B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2017(29/30) 20300115	1,22
XS1750986744	1.125000	% ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 2018(18/26) 20260915	1,22
XS2177441990	1.201000	% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270820	1,21
BE6312821612	1.125000	% Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) 20270630	1,21
XS2156510021	1.000000	% Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250414	1,20
XS2180510732	1.250000	% ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2020(25) 20250527	1,20

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)			
XS1917601582	1.500000	% HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/24) 20241203	1,20
FR0013396512	1.125000	% Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24) 20240714	1,20
XS2185867830	1.375000	% Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260608	1,19
XS2185867913	1.625000	% Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300608	1,18
DE000CZ40NS9	1.000000	% Commerzbank AG MTN-IHS S.923 v.19(26) 20260303	1,18
XS2171874519	0.500000	% Nordea Bank Abp EO-Preferred Med.-T.Nts 20(27) 20270513	1,18
XS2002491517	1.000000	% NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2019(24) 20240527	1,17
XS1956955980	0.625000	% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24) 20240226	1,17
XS2024715794	0.500000	% Deutsche Telekom AG MTN v.2019(2027) 20270704	1,17
DE000CZ40M21	0.500000	% Commerzbank AG MTN-IHS S.903 v.18(23) 20230827	1,17
XS1749378342	0.625000	% Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/24) 20240114	1,16
XS1976945722	0.000000	% ING Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(22) 20220407	1,15
XS2118276539	0.000000	% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230219	1,15
FR0013486701	0.125000	% Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26) 20260223	1,15
XS2050404636	0.200000	% DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/26) 20260317	1,15
XS2050404800	0.450000	% DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/28) 20280317	1,14
FR0013444304	0.100000	% HSBC France S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(27) 20270902	1,13
XS2113889351	0.500000	% Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(27) 20270203	1,13
XS1720922175	1.000000	% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24) 20241120	1,04
XS1992931508	0.831000	% BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(27) 20271107	1,03
XS1972547183	0.625000	% VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.19(22) 20220331	1,02
XS2014292937	0.500000	% Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.19(22) 20220619	1,02
XS2182404298	0.750000	% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2020(25) 20250603	0,94
XS2177575177	0.375000	% E.ON SE Medium Term Notes v.20(23/23) 20230419	0,93
XS2176534282	0.250000	% Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2020(23) 20230518	0,93
DE000A289DC9	0.250000	% BASF SE MTN v.2020(2020/2027) 20270604	0,93
XS2197342129	0.125000	% OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(24) 20240630	0,93
DE000A289DB1	0.101000	% BASF SE MTN v.2020(2020/2023) 20230604	0,92
XS2207657417	0.250000	% Nationwide Building Society EO-Preferred MTN 2020(25) 20250721	0,92

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2020.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		457.151.078,41	100,02
1. Anleihen		451.296.636,15	98,74
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	92.568.775,01		20,25
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	122.929.842,31		26,90
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	129.960.908,15		28,43
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	105.837.110,68		23,16
2. Forderungen		1.890.255,88	0,41
3. Bankguthaben		3.964.186,38	0,87
II. Verbindlichkeiten		-80.314,00	-0,02
III. Fondsvermögen		457.070.764,41	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified 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									
DE000A289DB1	0,1010 % BASF SE - Anleihe 2020/2023 ²⁾	EUR		4.200	4.200.000	0	% 100,331	4.213.909,98	0,92
DE000A289DC9	0,2500 % BASF SE - Anleihe 2020/2027	EUR		4.200	4.200.000	0	% 100,690	4.228.959,00	0,93
XS2199266268	1,1250 % Bayer AG - Anleihe 2020/2030	EUR		6.200	6.200.000	0	% 101,538	6.295.374,60	1,38
DE000CZ40M21	0,5000 % Commerzbank AG - Medium Term Notes 2018/2023	EUR		5.206	1.359.000	996	% 101,148	5.265.739,89	1,15
DE000CZ40NS9	1,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2019/2026 ²⁾	EUR		5.206	1.359.000	996	% 102,700	5.346.552,63	1,17
DE000A289RN6	2,6250 % Daimler AG - Anleihe 2020/2025	EUR		6.247	7.045.000	798	% 108,954	6.806.353,88	1,49
XS2024715794	0,5000 % Deutsche Telekom AG - Medium Term Notes 2019/2027	EUR		5.206	1.359.000	996	% 101,819	5.300.673,19	1,16
XS2177575177	0,3750 % E.ON SE - Anleihe 2020/2023	EUR		4.165	4.165.000	0	% 101,048	4.208.638,37	0,92
XS2171210862	0,3750 % Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale - Anleihe 2020/2025	EUR		6.200	6.200.000	0	% 101,699	6.305.315,06	1,38
XS1972547183	0,6250 % VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG - Anleihe 2019/2022	EUR		4.581	5.166.000	585	% 100,411	4.599.813,25	1,01
							EUR	52.571.329,85	11,50
Ausland									
XS1935139995	0,8750 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR		6.247	1.722	1.272	% 103,081	6.439.446,33	1,41
XS2180510732	1,2500 % ABN AMRO Bank N.V. - Anleihe 2020/2025	EUR		5.200	5.200	0	% 103,955	5.405.683,40	1,18
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2030	EUR		6.200	7.000	800	% 114,095	7.073.907,98	1,55
XS2185867830	1,3750 % Airbus SE - Anleihe 2020/2026 ²⁾	EUR		5.206	5.206	0	% 103,659	5.396.490,14	1,18
XS2185867913	1,6250 % Airbus SE - Anleihe 2020/2030	EUR		5.206	5.206	0	% 102,736	5.348.456,98	1,17
BE6312821612	1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2019/2027 ²⁾	EUR		5.206	1.486	1.128	% 104,586	5.444.750,80	1,19
BE6301510028	1,1500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2018/2027	EUR		8.330	2.200	1.666	% 104,463	8.701.787,06	1,90
XS1664644983	2,2500 % B.A.T. International Finance PLC - Medium Term Notes 2017/2030	EUR		5.206	1.491	1.128	% 105,935	5.514.980,79	1,21
XS2182404298	0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria - Anleihe 2020/2025 ²⁾	EUR		4.200	4.200	0	% 102,044	4.285.854,30	0,94
XS2113889351	0,5000 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2027	EUR		5.200	5.900	700	% 97,953	5.093.553,40	1,11
XS2168647357	1,3750 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR		6.200	6.200	0	% 103,075	6.390.664,26	1,40
FR0013386539	0,7500 % Banque Fédérative du Crédit Mutuel - Anleihe 2019/2023	EUR		6.500	6.500	0	% 102,264	6.647.154,80	1,45
XS1840618059	1,5000 % Bayer Capital Corp. B.V. - Guaranteed Registered Notes 2018/2026	EUR		7.300	7.300	0	% 105,515	7.702.611,06	1,69
XS1948612905	0,6250 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2023	EUR		6.247	1.629	1.193	% 101,852	6.362.717,55	1,39
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029 ²⁾	EUR		6.247	1.629	1.193	% 108,300	6.765.522,86	1,48
FR0013422011	1,3750 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR		5.600	1.300	900	% 106,036	5.938.014,88	1,30
FR0013398070	2,1250 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2019/2027	EUR		9.400	2.500	1.800	% 108,414	10.190.939,50	2,23
XS1992931508	0,8310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2027	EUR		4.581	1.094	791	% 102,012	4.673.155,98	1,02
FR0013476199	0,2500 % BPCE S.A. - Medium-Term Notes 2020/2026 ²⁾	EUR		6.200	1.600	1.200	% 100,324	6.220.057,00	1,36
FR0013509726	0,6250 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2025	EUR		6.200	7.000	800	% 102,337	6.344.919,42	1,39
XS1856833543	0,5000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2018/2022 ²⁾	EUR		7.300	1.900	1.400	% 101,260	7.391.993,87	1,62
XS1720922175	1,0000 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2017/2024	EUR		4.581	1.094	791	% 102,765	4.707.679,77	1,03
XS1956955980	0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR		5.200	1.300	900	% 101,846	5.295.977,44	1,16
XS1958307461	1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2019/2029	EUR		6.200	1.600	1.200	% 109,446	6.785.652,00	1,48
FR0013508512	1,0000 % Crédit Agricole S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR		6.200	7.000	800	% 102,584	6.360.177,00	1,39
DE000A2R9ZT1	0,2500 % Daimler International Finance B.V. - Medium-Term Notes 2019/2023	EUR		7.289	1.901	1.392	% 99,396	7.244.961,32	1,59
XS2050404636	0,2000 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Guaranteed Registered Notes 2019/2026	EUR		5.206	1.486	1.128	% 99,498	5.179.889,31	1,13
XS2050404800	0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Guaranteed Registered Notes 2019/2028	EUR		5.206	1.486	1.128	% 99,351	5.172.214,62	1,13

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified 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
XS2079723552	0,0500 % DNB Bank ASA - Medium-Term Notes 2019/2023		EUR	8.330	2.200	1.618	% 100,391	8.362.596,12	1,83
XS1750986744	1,1250 % ENEL Finance Intl N.V. - Medium Term Notes 2018/2026 ²⁾		EUR	5.206	1.486	1.128	% 105,801	5.508.025,57	1,21
FR0013463650	0,1250 % EssilorLuxottica S.A. - Medium-Term Notes 2019/2025		EUR	6.200	1.600	1.200	% 100,656	6.240.659,60	1,37
FR0013463668	0,3750 % EssilorLuxottica S.A. - Medium-Term Notes 2019/2027		EUR	6.200	1.600	1.200	% 101,328	6.282.351,50	1,37
FR0013444304	0,1000 % HSBC France S.A. - Medium-Term Notes 2019/2027 ²⁾		EUR	5.200	1.300	900	% 98,451	5.119.438,48	1,12
XS1917601582	1,5000 % HSBC Holdings PLC - Floating Rate Medium Term 2018/2024		EUR	5.206	5.918	712	% 103,837	5.405.750,06	1,18
XS1976945722	0,0000 % ING Bank N.V. - Anleihe 2019/2022		EUR	5.200	5.200	0	% 100,189	5.209.836,84	1,14
XS1882544973	2,0000 % ING Groep N.V. - Medium Term Notes 2018/2028		EUR	6.200	1.600	1.200	% 113,308	7.025.124,52	1,54
XS1749378342	0,6250 % Lloyds Banking Group PLC - Floating Rate Medium Term 2018/2024		EUR	5.206	1.486	1.128	% 100,522	5.233.176,36	1,14
XS2148623106	3,2500 % Lloyds Banking Group PLC - Anleihe 2020/2026		EUR	6.247	7.081	834	% 112,776	7.045.139,83	1,54
FR0013482833	0,1250 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE - Anleihe 2020/2028		EUR	7.300	8.500	1.200	% 99,368	7.253.882,98	1,59
FR0013506508	0,7500 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE - Anleihe 2020/2025		EUR	6.200	7.000	800	% 103,247	6.401.312,14	1,40
XS1960678099	0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2023		EUR	6.247	1.722	1.272	% 100,852	6.300.238,18	1,38
XS1960678255	1,1250 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2027		EUR	6.247	1.722	1.272	% 105,626	6.598.450,60	1,44
XS2207657417	0,2500 % Nationwide Building Society - Anleihe 2020/2025 ²⁾		EUR	4.165	4.165	0	% 100,282	4.176.764,88	0,91
XS1788515861	0,6250 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2018/2022		EUR	6.247	1.722	1.272	% 100,577	6.283.029,57	1,37
XS2002491517	1,0000 % NatWest Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	5.206	1.491	1.128	% 101,897	5.304.761,46	1,16
XS2171874519	0,5000 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2020/2027		EUR	5.206	5.206	0	% 102,424	5.332.193,44	1,17
XS2197342129	0,1250 % OP Yrityspankki Oyj - Anleihe 2020/2024 ²⁾		EUR	4.165	4.165	0	% 100,377	4.180.721,63	0,91
FR0013396512	1,1250 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2024		EUR	5.200	1.300	900	% 103,807	5.397.974,92	1,18
FR0013396520	2,0000 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2029		EUR	5.200	1.300	900	% 113,631	5.908.799,00	1,29
XS1789751531	1,0000 % Richemont Intl Holding S.A. - EO-Notes 2018/2026		EUR	6.247	6.247	0	% 105,452	6.587.602,06	1,44
XS1789752182	1,5000 % Richemont International Holding S.A. - Anleihe 2018/2030 ²⁾		EUR	5.206	5.206	0	% 110,735	5.764.854,21	1,26
FR0013324332	0,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2023 ²⁾		EUR	7.300	1.900	1.400	% 101,644	7.420.012,00	1,62
FR0013324357	1,3750 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2030		EUR	8.300	9.200	900	% 111,312	9.238.930,86	2,02
XS2118276539	0,0000 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2023 ²⁾		EUR	5.200	5.900	700	% 100,140	5.207.267,00	1,14
XS2182049291	0,1250 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2022 ²⁾		EUR	6.200	6.200	0	% 100,415	6.225.748,60	1,36
XS2176534282	0,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken AB - Anleihe 2020/2023		EUR	4.261	4.261	0	% 100,994	4.303.370,11	0,94
FR0013422003	0,0000 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2019/2022		EUR	6.200	1.600	1.200	% 100,015	6.200.930,00	1,36
FR0013486701	0,1250 % Société Générale S.A. - Anleihe 2020/2026		EUR	5.200	5.200	0	% 99,604	5.179.382,00	1,13
XS2156510021	1,0000 % Svenska Handelsbanken AB - Anleihe 2020/2025		EUR	5.206	5.918	712	% 104,544	5.442.560,64	1,19
XS2177441990	1,2010 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2020/2027		EUR	5.200	5.200	0	% 105,001	5.460.039,00	1,19
XS1681521081	1,7150 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium Term Notes 2017/2028		EUR	5.200	1.300	900	% 109,162	5.676.448,44	1,24
XS2153406868	1,4910 % Total Capital International S.A. - Anleihe 1900/1900		EUR	6.200	7.000	800	% 107,951	6.692.971,30	1,46
XS2149270477	0,7500 % UBS AG [London Branch] - Anleihe 2020/2023		EUR	8.330	9.269	939	% 102,065	8.502.006,17	1,86
CH0409606354	1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG - GFL 2018/2025 ²⁾		EUR	7.308	1.719	1.258	% 103,786	7.584.656,03	1,66
XS2014292937	0,5000 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2019/2022		EUR	4.581	5.166	585	% 100,177	4.589.086,38	1,00
							EUR	398.725.306,30	87,23

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified 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
	Summe Wertpapiervermögen						EUR	451.296.636,15	98,74
	Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	3.964.186,38	0,87
	EUR-Guthaben bei:								
	Verwahrstelle		EUR	3.964.186,38			% 100,000	3.964.186,38	0,87
	Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	1.890.255,88	0,41
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	4.729,40				4.729,40	0,00
	Zinsansprüche		EUR	1.885.526,48				1.885.526,48	0,41
	Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-80.314,00	-0,02
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-80.314,00				-80.314,00	-0,02
	Fondsvermögen						EUR	457.070.764,41	100,00 ¹⁾
	Anteilwert						EUR	113,58	
	Umlaufende Anteile						STK	4.024.301,00	

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:				
XS2185867830	1,3750 % Airbus SE - Anleihe 2020/2026	EUR 4.603		4.771.426,07	
BE6312821612	1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2019/2027	EUR 222		232.181,08	
XS2182404298	0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria - Anleihe 2020/2025	EUR 1.200		1.224.529,80	
DE000A289DB1	0,1010 % BASF SE - Anleihe 2020/2023	EUR 2.600		2.608.610,94	
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029	EUR 5.643		6.111.388,75	
FR0013476199	0,2500 % BPCE S.A. - Medium-Term Notes 2020/2026	EUR 1.500		1.504.852,50	
XS1856833543	0,5000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2018/2022	EUR 100		101.260,19	
DE000CZ40NS9	1,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2019/2026	EUR 1.000		1.026.998,20	
XS1750986744	1,1250 % ENEL Finance Intl N.V. - Medium Term Notes 2018/2026	EUR 2.485		2.629.167,03	
FR0013444304	0,1000 % HSBC France S.A. - Medium-Term Notes 2019/2027	EUR 5.200		5.119.438,48	
XS2207657417	0,2500 % Nationwide Building Society - Anleihe 2020/2025	EUR 1.084		1.087.061,97	
XS2197342129	0,1250 % OP Yrityspankki Oyj - Anleihe 2020/2024	EUR 163		163.615,28	
XS1789752182	1,5000 % Richemont International Holding S.A. - Anleihe 2018/2030	EUR 3.800		4.207.922,78	
FR0013324332	0,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2023	EUR 600		609.864,00	
XS2118276539	0,0000 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2023	EUR 1.900		1.902.655,25	
XS2182049291	0,1250 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2022	EUR 2.900		2.912.043,70	
CH0409606354	1,2500 % UBS Group Fdg (Switzerland) AG - GFL 2018/2025	EUR 29		30.097,84	
	Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen			36.243.113,86	36.243.113,86

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				
	Inland				
XS2103014291	0,3750 % E.ON SE - Medium-Term Notes 2020/2027	EUR	438	4.312	
DE000LB1DVL8	0,5000 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Notes 2017/2022	EUR	800	5.400	
XS2080581189	0,1250 % Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale - Medium-Term IHS 2019/2024	EUR	500	4.400	
	Ausland				
XS1967635977	2,3750 % Abertis Infraestructuras S.A. - Medium Term Notes 2019/2027	EUR	500	4.400	
XS2102283061	0,6000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium-Term Notes 2020/2027	EUR	900	5.700	
FR0013505625	2,1250 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	4.300	4.300	
FR0013510179	2,8750 % Auchan Holding S.A. - Anleihe 2020/2026	EUR	4.300	4.300	

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000	
XS2079713322	0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. (BBVA) - Medium-Term Notes 2019/2026	EUR	500	4.400		
XS2014287937	0,2500 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	900	5.700		
XS1557268221	1,3750 % Banco Santander S.A. - Registered Notes 2017/2022	EUR	700	6.500		
XS2135799679	2,5190 % BP Capital Markets PLC - Anleihe 2020/2028	EUR	4.348	4.348		
FR0013429073	0,6250 % BPCE S.A. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	500	5.300		
FR0013412947	0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2019/2026	EUR	1.200	7.000		
XS1637333748	1,5000 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2017/2027	EUR	910	5.378		
FR0013507860	2,0000 % Caggemini SE - Anleihe 2020/2029	EUR	4.300	4.300		
FR0013505260	2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027	EUR	4.300	4.300		
XS1605365193	1,3750 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2017/2027	EUR	700	6.500		
DE000A2RYD83	0,6250 % Daimler Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2019/2023	EUR	657	6.468		
XS1557095616	1,3750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. - Medium Term Notes 2017/2027	EUR	548	5.391		
FR0013504644	1,3750 % Engie S.A. - Anleihe 2020/2025	EUR	4.300	4.300		
XS2107315470	0,6250 % ENI S.p.A. - Medium-Term Notes 2020/2030	EUR	394	4.268		
XS2157526315	2,9500 % Gaz Finance PLC - Anleihe 2020/2025	EUR	4.348	4.348		
FR0013358116	0,2000 % HSBC France S.A. - Medium Term Notes 2018/2021	EUR	700	7.500		
XS1914937021	0,3750 % ING Bank N.V. - Medium Term Notes 2018/2021	EUR	1.200	7.000		
BE0002272418	0,7500 % KBC Groep N.V. - Medium Term Notes 2017/2022	EUR	500	5.300		
BE0002631126	1,1250 % KBC Groep N.V. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	500	4.400		
FR0013447604	0,3750 % La Poste - Medium-Term Notes 2019/2027	EUR	500	4.400		
XS2078918781	0,5000 % Lloyds Banking Group PLC - Medium-Term Notes 2019/2025	EUR	394	4.268		
XS2156506854	1,2500 % Naturgy Finance B.V. - Anleihe 2020/2026	EUR	4.300	4.300		
XS2148372696	1,1250 % Nestlé Finance International Ltd. - Anleihe 1900/1900	EUR	4.366	4.366		
XS2148390755	1,5000 % Nestlé Finance International Ltd. - Anleihe 2020/2030	EUR	4.366	4.366		
FR0013428414	1,2500 % Renault S.A. - Medium Term Notes 2019/2025	EUR	0	3.900		
FR0013324340	1,0000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2026	EUR	700	6.500		
XS2018637913	0,3750 % Santander Consumer Finance S.A. - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	500	4.400		
XS2100690036	0,3750 % Santander Consumer Finance S.A. - Medium-Term Notes 2020/2025	EUR	500	4.400		
XS2078734626	0,1250 % Shell International Finance B.V. - Medium-Term Notes 2019/2027	EUR	394	4.268		
XS2154418144	1,1250 % Shell International Finance B.V. - Anleihe 2020/2024	EUR	4.348	4.348		
XS2154418730	1,5000 % Shell International Finance B.V. - Anleihe 1900/1900	EUR	4.348	4.348		
XS2049616464	0,0000 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Medium-Term Notes 2019/2021	EUR	438	4.312		
XS2049616621	0,1250 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Medium-Term Notes 2019/2029	EUR	438	4.312		
XS2118276026	0,2500 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2029	EUR	4.300	4.300		
XS2020568734	0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	443	4.341		
XS2078737215	0,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium-Term Notes 2019/2029	EUR	535	4.409		
FR0013365491	0,2500 % Société Générale S.A. - Medium Term Notes 2018/2022	EUR	1.400	9.100		
XS2013536029	0,1250 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2019/2024	EUR	443	4.341		
XS1961772560	1,7880 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium-Term Notes 2019/2029	EUR	500	4.400		
XS2001737324	0,7500 % Telenor ASA - Medium-Term Notes 2019/2026	EUR	443	4.341		
XS2001737910	1,1250 % Telenor ASA - Medium Term Notes 2019/2029	EUR	443	4.341		
CH0520042489	0,2500 % UBS Group AG - Floating Rate Notes 2020/2026	EUR	603	6.414		
XS2147133495	1,2500 % Unilever N.V. - Anleihe 2020/2025	EUR	4.348	4.348		
XS2147133578	1,7500 % Unilever N.V. - Anleihe 2020/2030	EUR	4.348	4.348		
XS1586555861	1,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Senior Notes 2017/2023	EUR	600	6.000		
XS1586555945	1,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Senior Notes 2017/2027	EUR	1.100	10.800		
Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäfts vereinbarten Wertes):						
unbefristet					EUR	685.703

(Basiswerte: 2,3750 % Abertis Infraestructuras S.A. - Medium Term Notes 2019/2027 (XS1967635977); 0,6000 % ABN AMRO Bank N.V. - Medium-Term Notes 2020/2027 (XS2102283061); 1,2500 % ABN AMRO Bank N.V. - Anleihe 2020/2025 (XS2180510732); 2,1250 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2026 (FR0013505625); 2,7500 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2030 (FR0013505633); 1,6250 % Airbus SE - Anleihe 2020/2030 (XS2185867913); 1,1250 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2019/2027 (BE6312821612); 1,1500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2018/2027 (BE6301510028); 2,8750 % Auchan Holding S.A. - Anleihe 2020/2026 (FR0013510179); 2,2500 % B.A.T. International Finance PLC - Medium Term Notes 2017/2030 (XS1664644983); 0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria - Anleihe 2020/2025 (XS2182404298); 0,2500 % Banco Santander S.A. - Medium Term Notes 2019/2024 (XS2014287937); 0,5000 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2027 (XS2113889351); 1,3750 % Banco Santander S.A. - Anleihe 2020/2026 (XS2168647357); 0,2500 % BASF SE - Anleihe 2020/2027 (DE000A289DC9); 0,6250 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2023 (XS1948612905); 1,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2019/2029 (XS1948611840); 1,3750 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2019/2029 (FR0013422011); 0,8310 % BP Capital Markets PLC - Medium Term Notes 2019/2027 (XS1992931508); 0,2500 % BPCE S.A. - Medium-Term Notes 2020/2026 (FR0013476199); 0,6250 % BPCE S.A. - Anleihe 2020/2025 (FR0013509726); 0,5000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2018/2022 (XS1856833543); 0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2019/2026 (FR0013412947); 1,5000 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2017/2027 (XS1637333748); 2,0000 % Caggemini SE - Anleihe 2020/2029 (FR0013507860); 2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027 (FR0013505260); 1,0000 % Commerzbank AG - Medium Term IHS 2019/2026 (DE000CZ40NS9); 0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. - Medium Term Notes 2019/2024 (XS195695980); 1,3750 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2017/2027 (XS1605365193); 1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) - Medium Term Notes 2019/2029 (XS1958307461); 1,0000 % Crédit Agricole S.A. - Anleihe 2020/2026 (FR0013508512); 2,6250 % Daimler AG - Anleihe 2020/2025 (DE000A289RN6); 0,2500 % Daimler International Finance B.V. - Medium-Term Notes 2019/2027 (DE000A2R9ZT1); 0,6250 % Daimler Intl Finance B.V. - Medium Term Notes 2019/2023 (DE000A2RYD83); 0,5000 % Deutsche Telekom AG - Medium Term Notes 2019/2027 (XS2024715794); 0,2000 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Guaranteed Registered Notes 2019/2026 (XS2050404636); 0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.L. - Guaranteed Registered Notes 2019/2028 (XS2050404800); 0,0500 % DNB Bank ASA - Medium-Term Notes 2019/2023 (XS2079723552); 0,3750 % E.ON SE - Anleihe 2020/2023 (XS2177575177); 0,3750 % E.ON SE - Medium-Term Notes 2020/2027 (XS2103014291); 1,1250 % ENEL Finance Intl N.V. - Medium Term Notes 2018/2026 (XS1750986744); 1,3750 % Engie S.A. - Anleihe 2020/2025 (FR0013504644); 0,6250 % ENI S.p.A. - Medium-Term Notes 2020/2030 (XS2107315470); 0,1250 % EssilorLuxottica S.A. - Medium-Term Notes 2019/2025 (FR0013463650); 0,3750 % EssilorLuxottica S.A. - Medium-Term Notes 2019/2027 (FR0013463668); 0,1000 % HSBC France S.A. - Medium-Term Notes 2019/2027 (FR0013444304); 1,5000 % HSBC Holdings PLC - Floating Rate Medium Term 2018/2024 (XS1917601582); 2,0000 % ING Groep N.V. - Medium Term Notes 2018/2028 (XS1882544973); 1,1250 % KBC Groep N.V. - Medium Term Notes 2019/2024 (BE0002631126); 0,1250 % Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale - Medium-Term IHS 2019/2024 (XS2080581189); 0,6250 % Lloyds Banking Group PLC - Floating Rate Medium Term 2018/2024 (XS1749378342); 0,1250 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE - Anleihe 2020/2028 (FR0013482833); 0,7500 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE - Anleihe 2020/2025 (FR0013506508); 0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA - Guaranteed Registered Notes 2019/2023 (XS1960678099); 1,1250 % Medtronic Global Holdings SCA -

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Guaranteed Registered Notes 2019/2027 (XS1960678255); 0,2500 % Nationwide Building Society - Anleihe 2020/2025 (XS2207657417); 1,2500 % Naturgy Finance B.V. - Anleihe 2020/2026 (XS2156506854); 1,5000 % Nestlé Finance International Ltd. - Anleihe 2020/2030 (XS2148390755); 0,5000 % Nordea Bank Abp - Anleihe 2020/2027 (XS2171874519); 0,1250 % OP Yrityspankki Oyj - Anleihe 2020/2024 (XS2197342129); 2,0000 % Orange S.A. - Medium Term Notes 2019/2029 (FR0013396520); 1,5000 % Richemont International Holding S.A. - Anleihe 2018/2030 (XS1789752182); 0,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2023 (FR0013324332); 1,0000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2026 (FR0013324340); 1,3750 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2018/2030 (FR0013324357); 0,3750 % Santander Consumer Finance S.A. - Medium-Term Notes 2020/2025 (XS2100690036); 0,1250 % Shell International Finance B.V. - Medium-Term Notes 2019/2027 (XS2078734626); 1,1250 % Shell International Finance B.V. - Anleihe 2020/2024 (XS2154418144); 0,0000 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2023 (XS2118276539); 0,1250 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2022 (XS2182049291); 0,1250 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Medium-Term Notes 2019/2029 (XS2049616621); 0,2500 % Siemens Financieringsmaatschappij N.V. - Anleihe 2020/2029 (XS2118276026); 0,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken - Medium-Term Notes 2019/2029 (XS2078737215); 0,1250 % Svenska Handelsbanken AB - Medium Term Notes 2019/2024 (XS2013536029); 1,7150 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium Term Notes 2017/2028 (XS1681521081); 1,7880 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Medium-Term Notes 2019/2029 (XS1961772560); 0,7500 % Telenor ASA - Medium-Term Notes 2019/2026 (XS2001737324); 1,1250 % Telenor ASA - Medium Term Notes 2019/2029 (XS2001737910); 1,4910 % Total Capital International S.A. - Anleihe 1900/1900 (XS2153406868); 0,7500 % UBS AG [London Branch] - Anleihe 2020/2023 (XS2149270477); 1,2500 % Unilever N.V. - Anleihe 2020/2025 (XS2147133495); 1,7500 % Unilever N.V. - Anleihe 2020/2030 (XS2147133578); 0,5000 % Volkswagen Leasing GmbH - Medium Term Notes 2019/2022 (XS2014292937); 1,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Senior Notes 2017/2027 (XS1586555945))

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		144.900,23	0,036
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		1.838.996,82	0,457
3. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		36.096,62	0,009
Summe der Erträge		2.019.993,67	0,502
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-427.560,30	-0,106
2. Sonstige Aufwendungen		-8.169,23	-0,002
davon: Negative Einlagezinsen	-8.169,23		-0,002
Summe der Aufwendungen		-435.729,53	-0,108
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.584.264,14	0,394
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		3.468.001,62	0,862
2. Realisierte Verluste		-4.123.740,97	-1,025
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-655.739,35	-0,163
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		928.524,79	0,231
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		2.155,38	0,001
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		948.131,75	0,236
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		950.287,13	0,236
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.878.811,92	0,467

Entwicklung des Sondervermögens

	2020 / 2021
	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	403.818.877,07
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-573.525,75
2. Zwischenausschüttungen	-889.032,24
3. Mittelzufluss (netto)	52.858.758,02
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	113.007.261,22
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-60.148.503,20
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-23.124,61
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	1.878.811,92
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	2.155,38
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	948.131,75
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	457.070.764,41

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

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Anhang.

Angaben nach der Derivateverordnung
Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **36.243.113,86**

Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen
 Clearstream Banking AG (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem)
 DekaBank Deutsche Girozentrale

		Kurswert in EUR	
		befristet	unbefristet
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:	EUR		40.464.471,59
davon:			
Schuldverschreibungen	EUR		40.464.471,59
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme von Dritten gewährten Sicherheiten	EUR		6.314.286,47
Erträge aus Wertpapier-Darlehen einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren (exklusive Ertragsausgleich)	EUR		36.116,86

Die Bruttoerträge aus Wertpapier Darlehen-Geschäften betragen im Geschäftszeitraum EUR 36.116,86. 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	113,58
Umlaufende Anteile	STK	4.024.301,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,74
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	0,15
---	------

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 -8.065,38 enthalten.

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

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

Verwendete Vermögensgegenstände

absolut	36.243.113,86
in % des Fondsvermögens	7,93

10 größte Gegenparteien

Name	DekaBank Deutsche Girozentrale
Bruttovolumen offene Geschäfte	30.603.652,14
Sitzstaat	Deutschland
Name	Clearstream Banking AG
Bruttovolumen offene Geschäfte	5.639.461,72
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	36.243.113,86

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.

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

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

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

Währungen der erhaltenen Sicherheiten

Euro

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)	6.314.286,47
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	40.464.471,59

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

Deka iBoxx € Liquid Corporates Diversified UCITS ETF

Ertrags- und Kostenanteile

Ertragsanteil des Fonds

absolut 36.116,86
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

8,03

Die hier angegebene Prozentzahl bezieht sich auf das gesamte Wertpapiervermögen des Fonds einschließlich / ausschließlich Anteilen an Zielfonds/ Geldmarktfonds. Die Anlagebedingungen können jedoch Beschränkungen enthalten, so dass das Verleihen ggf. nur in geringerem Umfang zulässig ist.

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

1. Name	Imperial Brands Finance PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5.656.884,66
2. Name	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5.226.809,21
3. Name	Bayerische Landesbank
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4.741.777,43
4. Name	Landeskreditbank Baden-Württemberg - Förderbank
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4.590.101,10
5. Name	National Bank of Canada
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4.526.257,27
6. Name	Berlin Hyp AG
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.399.703,61
7. Name	Bank of America Corp.
7. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.362.143,85
8. Name	Land Niedersachsen
8. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.032.452,33
9. Name	BPCE S.A.
9. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.544.650,08
10. Name	Bankia S.A.
10. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.210.866,69

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

Es erfolgt keine Wiederanlage der Sicherheiten.

Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2,00
Name	J.P. Morgan AG Frankfurt
verwahrter Betrag absolut	19.523.448,89
Name	Clearstream Banking AG
verwahrter Betrag absolut	27.255.309,17

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