

Halbjahresbericht
zum 31. August 2024.

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

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

.Deka
Investments

Lizenzvermerk

Der iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified (Preis-)Index ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC oder seinen Tochtergesellschaften („SPDJI“) und wurde zur Verwendung durch die Deka Investment GmbH lizenziert. S&P®, S&P 500®, US 500, The 500, iBoxx®, iTraxx® und CDX® sind Marken von S&P Global, Inc. oder seinen Tochtergesellschaften („S&P“). Dow Jones® ist eine eingetragene Marke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“). Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF wird von SPDJI, Dow Jones, S&P, ihren jeweiligen Tochtergesellschaften weder gesponsert, unterstützt, verkauft noch gefördert und keine dieser Parteien macht eine Zusicherung hinsichtlich der Ratsamkeit der Investition in dieses Produkt oder übernimmt Haftung für Fehler, Auslassungen oder Störungen des iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified (Preis-)Index.

Bericht der Geschäftsführung.

31. August 2024

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 2024 bis zum 31. August 2024.

Sinkende Inflationszahlen stabilisierten in den vergangenen sechs Monaten die Finanzmärkte. In Deutschland und vielen anderen Ländern der Europäischen Währungsunion fielen die Inflationszahlen zuletzt im August sehr erfreulich aus und bewegten sich letztlich im Zielkorridor der Europäischen Zentralbank (EZB). Auf konjunktureller Seite bot sich ein uneinheitliches Bild. Das deutsche Bruttoinlandsprodukt schrumpfte im zweiten Quartal und bleibt damit schwunglos. Für die USA bot sich ein freundlicheres Bild, denn das US-BIP überraschte weiter positiv und zeugt von einer robusten Konjunktur. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken ist weiterhin auf die Inflationsbekämpfung ausgerichtet. Im ersten Quartal 2024 sorgten die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und zwischenzeitlich wieder steigende Renditen. Die Fed behielt daher über die Berichtsperiode das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei, signalisierte aber zuletzt eine baldige erste Zinssenkung. Die EZB verringerte den Hauptrefinanzierungssatz bereits im Juni von 4,50 Prozent auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger Euroland-Staatsanleihen lag Ende August bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 3,9 Prozent. Damit gingen die Renditen auf Halbjahressicht leicht zurück.

Die globalen Zinssenkungserwartungen waren ein Antriebsfaktor für die Kurse der weltweiten Aktienmärkte, die sich in der Breite in einer freundlichen Verfassung zeigten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten zwischenzeitlich jeweils auf ein Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Nach der überraschenden Leitzinserhöhung der japanischen Notenbank Anfang August sackten die weltweiten Aktienkurse kurzzeitig ab. Die Märkte konnten sich jedoch dank überzeugender Wachstumsdaten für die USA und die Eurozone sowie solider Unternehmensgewinne rasch in Richtung ihrer historischen Höchststände erholen.

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 2024	8
Vermögensaufstellung zum 31. August 2024	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

Performance*	6 Monate
	2,96%
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	DE000CZ45VS1	0.010000 % Commerzbank AG MTH S.P36 v.20(30) 20300310
Löschung	DE000BHY0GK6	1.250000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(25) 20250824
Löschung	DE000MHB33J5	2.750000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2017 v.23(25) 20250923
Löschung	DE000NLB40F8	2.875000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- OPF-MTN 2024(2027) 20270513
Löschung	DE000HV2AZG5	3.125000 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-OPF S.2140 v.23(25) 20250819
Neuaufnahme	DE000HV2AYS3	0.375000 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2116 v.22(33) 20330116
Neuaufnahme	XS2760109053	2.875000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H371 v.2024(34) 20340205
Neuaufnahme	DE000NLB40F8	2.875000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- OPF-MTN 2024(2027) 20270513
Neuaufnahme	DE000CZ45YB1	3.000000 % Commerzbank AG MTH S.P68 v.24(34) 20340312
Neuaufnahme	DE000LB39EQ6	3.125000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 24(29)S.855 20291112

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	4,85
DE000CZ45W16	0.500000 % Commerzbank AG MTH S.P49 v.22(27) 20270314	4,63
DE000A2YNWA1	0.625000 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(29) 20290224	4,46
DE000CZ43Z72	3.375000 % Commerzbank AG MTH S.P65 v.23(28) 20280827	4,18
DE000CZ43ZX7	3.125000 % Commerzbank AG MTH S.P61 v.23(29) 20290419	4,14
XS2760109053	2.875000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H371 v.2024(34) 20340205	4,09
XS2433126807	0.010000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H346 v.22(27) 20270718	3,77
DE000MHB31J9	1.875000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2000 v.22(32) 20320824	3,66
DE000A1KRJV6	0.010000 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.2021(2028) 20281006	3,65
DE000A2YNWC7	3.250000 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.23(28) 20280214	3,32
DE000MHB32J7	3.000000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2014 v.22(27) 20270803	3,29
DE000A30V2V0	3.000000 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.22(28) 20280327	3,29
DE000HV2AZC4	3.000000 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2136 v.23(26) 20260712	3,27
DE000LB384E5	2.875000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.834 v.23(26) 20260322	3,26
DE000HV2AY79	2.750000 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2131 v.22(26) 20260226	3,25
DE000LB38077	2.375000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 22(27)R.831 20270225	3,23
DE000A30VPC2	2.250000 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.22(27) 20270919	3,21
DE000A2YNWB9	2.375000 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(30) 20300912	3,19
DE000LB2ZV93	1.750000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.829 v.22(28) 20280227	3,16
DE000HV2AYU9	0.500000 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-OPF S.2118 v.22(27) 20270222	3,08
DE000A3E5UY4	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1239 21(26) 20261025	3,07
DE000MHB30J1	1.250000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1989 v.22(30) 20300213	3,03
DE000A3MP619	0.750000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1242 22(29) 20291120	2,95
DE000A3H2TQ6	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1235 21(29) 20290419	2,88
DE000BHY0H34	0.125000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.21(30) 20300117	2,84
DE000A3H2TK9	0.010000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1234 21(30) 20300328	2,80
DE000HV2AYS3	0.375000 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2116 v.22(33) 20330116	2,67
DE000LB39EQ6	3.125000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 24(29)S.855 20291112	2,54
XS2673929944	3.375000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H367 v.2023(28) 20280119	2,23
DE000CZ45YB1	3.000000 % Commerzbank AG MTH S.P68 v.24(34) 20340312	1,99

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2024.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		60.746.383,04	100,01
1. Anleihen		60.125.378,63	98,99
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	21.450.275,51		35,31
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	20.766.295,85		34,19
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	10.463.685,89		17,23
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	7.445.121,38		12,26
2. Forderungen		503.638,37	0,83
3. Bankguthaben		117.366,04	0,19
II. Verbindlichkeiten		-5.115,50	-0,01
III. Fondsvermögen		60.741.267,54	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. August 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE000BHY0H34	0,1250 % Berlin Hyp AG - Hyp. Pfandbriefe 2021/2030		EUR	1.957	824	677	% 87,124	1.705.010,03	2,81
DE000CZ45W16	0,5000 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.936	1.007	1.078	% 94,656	2.779.102,22	4,58
DE000CZ45YB1	3,0000 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2024/2034		EUR	1.180	1.370	190	% 101,339	1.195.795,36	1,97
DE000CZ43Z7	3,1250 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2029		EUR	2.446	839	899	% 101,726	2.488.221,38	4,10
DE000CZ43Z72	3,3750 % Commerzbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2028		EUR	2.446	839	899	% 102,552	2.508.423,39	4,13
DE000A30VPC2	2,2500 % Deutsche Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.000	600	600	% 98,512	1.970.241,60	3,24
DE000A30V2V0	3,0000 % Deutsche Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2028		EUR	2.000	600	600	% 100,828	2.016.566,00	3,32
DE000A3E5UY4	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2026		EUR	1.957	673	721	% 94,244	1.844.355,08	3,04
DE000A3H2TQ6	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2029		EUR	1.957	673	721	% 88,278	1.727.604,77	2,84
DE000A3H2TK9	0,0100 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2021/2030		EUR	1.957	673	721	% 86,061	1.684.212,40	2,77
DE000A3MP619	0,7500 % DZ HYP AG - Pfandbriefe 2022/2029		EUR	1.957	673	721	% 90,515	1.771.368,96	2,92
DE000A1KRJV6	0,0100 % ING-DiBa AG - Hyp. Pfandbriefe 2021/2028		EUR	2.400	900	1.000	% 89,581	2.149.952,16	3,54
DE000A2YNWB9	2,3750 % ING-DiBa AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2030		EUR	2.000	600	600	% 97,911	1.958.217,60	3,22
DE000A2YNWC7	3,2500 % ING-DiBa AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2028		EUR	2.000	600	600	% 101,750	2.034.992,20	3,35
DE000LB2ZV93	1,7500 % Landesbank Baden-Württemberg - Pfandbriefe 2022/2028		EUR	1.957	673	721	% 96,954	1.897.386,65	3,12
DE000LB38077	2,3750 % Landesbank Baden-Württemberg - Öff. MT Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.000	600	600	% 99,177	1.983.545,60	3,27
DE000LB384E5	2,8750 % Landesbank Baden-Württemberg - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2026		EUR	1.957	673	721	% 100,092	1.958.797,31	3,22
DE000LB39EQ6	3,1250 % Landesbank Baden-Württemberg - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2029		EUR	1.494	1.587	93	% 102,162	1.526.299,23	2,51
XS2433126807	0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.400	900	1.000	% 92,644	2.223.457,44	3,66
XS2536375368	2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2026		EUR	2.900	900	1.000	% 99,266	2.878.719,22	4,74
XS2760109053	2,8750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2034		EUR	2.400	2.800	400	% 100,427	2.410.236,00	3,97
XS2673929944	3,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ - Öff. MT Pfandbriefe 2023/2028		EUR	1.300	600	1.300	% 102,134	1.327.739,40	2,19
DE000MHB30J1	1,2500 % Münchener Hypothekenbank eG - Pfandbriefe 2022/2030		EUR	1.957	673	721	% 92,927	1.818.577,67	2,99
DE000MHB31J9	1,8750 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2032		EUR	2.348	807	865	% 93,682	2.199.641,62	3,62
DE000MHB32J7	3,0000 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2027		EUR	1.957	673	721	% 100,908	1.974.764,08	3,25
DE000A2YNWA1	0,6250 % NG-DiBa AG - Pfandbriefe 2022/2029		EUR	2.900	900	1.000	% 91,213	2.645.168,30	4,35
DE000HV2AYS3	0,3750 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2033		EUR	2.000	2.200	200	% 81,972	1.639.448,40	2,70
DE000HV2AYU9	0,5000 % UniCredit Bank AG - Pfandbriefe 2022/2027		EUR	2.000	600	600	% 94,562	1.891.239,20	3,11
DE000HV2AY79	2,7500 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2022/2026		EUR	1.957	673	721	% 99,773	1.952.555,65	3,21
DE000HV2AZC4	3,0000 % UniCredit Bank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2026		EUR	1.957	673	721	% 100,344	1.963.739,71	3,23
Summe Wertpapiervermögen							EUR	60.125.378,63	98,99
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	117.366,04	0,19
EUR-Guthaben bei:									
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	117.366,04			% 100,000	117.366,04	0,19
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	503.638,37	0,83
Zinsansprüche							EUR	503.638,37	0,83
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-5.115,50	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung							EUR	-5.115,50	-0,01

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Fondsvermögen						EUR	60.741.267,54	100,00 ¹⁾
	Anteilwert						EUR	99,64	
	Umlaufende Anteile						STK	609.610,00	

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 30.08.2024

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					
DE000BHY0GK6	1,2500 % Berlin Hyp AG - Hyp. Pfandbriefe 2022/2025	EUR	301	2.306	
DE000CZ45VS1	0,0100 % Commerzbank AG - Pfandbriefe 2020/2030	EUR	271	2.083	
DE000MHB33J5	2,7500 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2023/2025	EUR	368	2.824	
DE000NLB40F8	2,8750 % Norddeutsche Landesbank -GZ- - Öff. MT Pfandbriefe 2024/2027	EUR	1.688	1.688	
DE000HV2AZG5	3,1250 % UniCredit Bank AG - Öff. MT Pfandbriefe 2023/2025	EUR	374	2.880	

Deka iBoxx € Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.03.2024 bis zum 31.08.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		560.767,22	0,920
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		4.310,85	0,007
Summe der Erträge		565.078,07	0,927
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-27.883,51	-0,046
Summe der Aufwendungen		-27.883,51	-0,046
III. Ordentlicher Nettoertrag		537.194,56	0,881
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		106.302,88	0,174
2. Realisierte Verluste		-405.154,91	-0,665
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-298.852,03	-0,490
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		238.342,53	0,391
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		537.057,70	0,881
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		1.053.814,43	1,729
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.590.872,13	2,610
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.829.214,66	3,001

Entwicklung des Sondervermögens

	2024 /	2025
	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		63.117.391,42
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-272.882,30
2. Zwischenausschüttungen		-318.308,90
3. Mittelzufluss (netto)		-3.607.913,35
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	18.797.008,05	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-22.404.921,40	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-6.233,99
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.829.214,66
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	537.057,70	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	1.053.814,43	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		60.741.267,54

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	99,64
Umlaufende Anteile	STK	609.610,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,99

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 31.08.2024 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 31.08.2024 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)

0,11

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

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

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 2. September 2024

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 2023

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 112,7 Mio.

Alleingeschafterin

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

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Peter Scherkamp, München

Dr. Bernd Türk, Frankfurt am Main

Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)
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 2024

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

