

Halbjahresbericht
zum 31. August 2023.

**Deka iBoxx € Liquid
Non-Financials 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 Deko 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 Non-Financials 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	9
Vermögensaufstellung zum 31. August 2023	10
Anhang	13
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

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 Non-Financials Diversified UCITS ETF Anlagepolitik.

Der Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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 Markt iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified (Preis-)Index nachzubilden. Dieser Index bildet die Wertentwicklung der 40 größten und umsatzstärksten europäischen Unternehmensanleihen ohne Finanztitel 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 Non-Financials Diversified UCITS ETF

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	2,7%	-0,2%	-4,3%
ISIN	DE000ETFL383		

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

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Löschung	XS2337060607	0.000000 % CCEP Finance (Ireland) DAC EO-Notes 2021(21/25) 20250905
Löschung	FR0013516077	0.500000 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) 20280604
Löschung	XS2384273715	0.500000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2021(21/30) 20300902
Löschung	XS2356040357	0.750000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29) 20290117
Löschung	FR0013512621	1.000000 % Compagnie Fin. Ind. Autoroutes EO-Med.-Term Nts 2020(20/31) 20310518
Löschung	FR0013519071	1.125000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/30) 20300622
Löschung	XS2170736263	1.125000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2020(20/32) 20320525
Löschung	XS2177441990	1.201000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20270820
Löschung	XS2156506854	1.250000 % Naturgy Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) 20260114
Löschung	XS2170386853	1.250000 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(32) 20321110
Löschung	XS2199266698	1.375000 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/32) 20320705
Löschung	XS2178833690	1.375000 % Equinor ASA EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) 20320521
Löschung	XS2455983861	1.375000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320310
Löschung	FR0013508694	1.375000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2020(32) 20320420
Löschung	FR0013505112	1.500000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300331
Löschung	XS2185867913	1.625000 % Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) 20300608
Löschung	FR0013506532	1.750000 % Pernod-Ricard S.A. EO-Bonds 2020(20/30) 20300407
Löschung	XS2153409029	1.994000 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) 20320407
Löschung	XS2176785447	2.000000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(31) 20310517
Löschung	DE000A289XJ2	2.000000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2020(26) 20260821
Löschung	XS2195092601	2.250000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/29) 20290328
Löschung	XS2526839175	2.250000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) 20250309
Löschung	FR0013507878	2.375000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/32) 20320414
Löschung	XS2147889690	2.500000 % Diageo Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2020(31/32) 20320326
Löschung	FR0013505260	2.625000 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27) 20271214
Löschung	DE000A289RN6	2.625000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2020(25) 20250406
Löschung	FR0013505633	2.750000 % Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30) 20300401
Löschung	BE6320935271	2.875000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) 20320401
Löschung	XS2597110027	4.375000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/30) 20300313
Neuaufnahme	XS2337060607	0.000000 % CCEP Finance (Ireland) DAC EO-Notes 2021(21/25) 20250905
Neuaufnahme	FR0014001IO6	0.000000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(29) 20290717
Neuaufnahme	XS2381853279	0.250000 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2021(21/28) 20280831
Neuaufnahme	XS2337061753	0.875000 % CCEP Finance (Ireland) DAC EO-Notes 2021(21/33) 20330505
Neuaufnahme	FR0014009KS6	0.875000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/25) 20250405
Neuaufnahme	FR0013519071	1.125000 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/30) 20300622
Neuaufnahme	XS2170736263	1.125000 % Richemont Intl Holding S.A. EO-Notes 2020(20/32) 20320525
Neuaufnahme	XS2320459063	1.750000 % Imperial Brands Fin.Ned.BV EO-Medium-Term Nts 2021(21/33) 20330317
Neuaufnahme	DE000A289XJ2	2.000000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2020(26) 20260821
Neuaufnahme	XS2195092601	2.250000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/29) 20290328
Neuaufnahme	XS2484587048	2.592000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310524
Neuaufnahme	FR001400CH94	2.750000 % Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320901
Neuaufnahme	FR001400HX81	2.875000 % LOréal S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280518
Neuaufnahme	XS2589790109	3.375000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2023(31/31) 20310823
Neuaufnahme	XS2631416950	3.500000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2023(23/25) 20251205

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

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

Zu- oder Abgang	ISIN	Wertpapiername
Neuaufnahme	XS2574873266	3.500000 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(27/28) 20280111
Neuaufnahme	XS2629468278	3.625000 % Robert Bosch GmbH MTN v.2023(2023/2030) 20300601
Neuaufnahme	XS2607193435	3.625000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290420
Neuaufnahme	DE000A3LH6U5	3.700000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2023(31) 20310529
Neuaufnahme	XS2582814039	3.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310512
Neuaufnahme	XS2631867533	3.750000 % RELX Finance B.V. EO-Notes 2023(23/31) 20310611
Neuaufnahme	XS2630117328	4.000000 % Continental AG MTN v.23(28/28) 20280531
Neuaufnahme	XS2648077191	4.000000 % CRH SMW Finance DAC EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310710
Neuaufnahme	XS2626022573	4.125000 % WPP Finance S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280529
Neuaufnahme	XS2634690114	4.250000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310615
Neuaufnahme	XS2597110027	4.375000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/30) 20300313
Neuaufnahme	XS2630111719	4.625000 % Bayer AG MTN v.2023(2033/2033) 20330525
Neuaufnahme	FR001400IEQ0	4.875000 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(28/28) 20280613
Neuaufnahme	XS2589367528	5.375000 % B.A.T. Netherlands Finance BV EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310215

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

Zusammensetzung des Index (%)		
XS2630111719	4.625000 % Bayer AG MTN v.2023(2033/2033) 20330525	3,99
FR001400DNG3	4.625000 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/32) 20320606	3,43
XS2589790109	3.375000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2023(31/31) 20310823	3,25
XS2634690114	4.250000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310615	3,22
XS2523390271	2.500000 % RWE AG Medium Term Notes v.22(25/25) 20250823	3,22
XS2447561403	0.500000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25) 20250221	3,14
XS2477935345	1.625000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/26) 20261116	3,12
XS2350621863	0.000000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(26/26) 20260613	3,00
XS2459544339	1.875000 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) 20290920	2,95
XS2267889991	2.000000 % Autostrade per l'Italia S.p.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/28) 20281203	2,88
XS2234567233	0.875000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2020(28) 20280921	2,80
DE000A3KNP96	0.750000 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(28/29) 20290323	2,74
DE000A3LH6U5	3.700000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2023(31) 20310529	2,64
XS2631416950	3.500000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2023(23/25) 20251205	2,62
FR001400FDB0	4.250000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2023(23/32) 20320124	2,61
XS2629468278	3.625000 % Robert Bosch GmbH MTN v.2023(2023/2030) 20300601	2,61
FR001400F1G3	3.625000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/30) 20300110	2,60
FR001400HX81	2.875000 % L'Oréal S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280518	2,58
FR001400DQ92	5.000000 % Veolia Environnement S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20321102	2,48
FR0014003Q41	0.000000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25) 20251130	2,43
XS2484587048	2.592000 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310524	2,43
XS2456247787	1.500000 % BASF SE MTN v.2022(2022/2031) 20310316	2,26
FR001400CH94	2.750000 % Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2022(22/32) 20320901	2,25
XS2531569965	3.250000 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/31) 20310912	2,25
FR0014001IO6	0.000000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(29) 20290717	2,22
XS2484327999	1.875000 % Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 2022(30) 20300523	2,16
FR0014009KS6	0.875000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/25) 20250405	2,14
XS2589367528	5.375000 % B.A.T. Netherlands Finance BV EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310215	2,12
XS2433135543	1.475000 % Holding d'Infrastr. de Transp. EO-Med.-Term Notes 2022(22/31) 20310117	2,11
XS2574873266	3.500000 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(27/28) 20280111	2,09
XS2582814039	3.750000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2023(23/31) 20310512	2,04
XS2337061753	0.875000 % CCEP Finance (Ireland) DAC EO-Notes 2021(21/33) 20330505	1,99
FR001400IEQ0	4.875000 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(28/28) 20280613	1,99
XS2626022573	4.125000 % WPP Finance S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/28) 20280529	1,97
XS2631867533	3.750000 % RELX Finance B.V. EO-Notes 2023(23/31) 20310611	1,97
XS2630117328	4.000000 % Continental AG MTN v.23(28/28) 20280531	1,96
XS2648077191	4.000000 % CRH SMW Finance DAC EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) 20310710	1,96
XS2607193435	3.625000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29) 20290420	1,95
XS2320459063	1.750000 % Imperial Brands Fin.Ned.BV EO-Medium-Term Nts 2021(21/33) 20330317	1,94
XS2381853279	0.250000 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2021(21/28) 20280831	1,87

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. August 2023.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände		198.452.041,20	100,02
1. Anleihen		195.041.307,12	98,30
- Restlaufzeit bis 3 Jahre	32.322.794,56		16,29
- Restlaufzeit 3 bis 5 Jahre	26.781.972,95		13,50
- Restlaufzeit 5 bis 7 Jahre	48.265.976,92		24,33
- Restlaufzeit 7 bis 10 Jahre	87.670.562,69		44,19
2. Forderungen		2.258.045,00	1,14
3. Bankguthaben		1.152.689,08	0,58
II. Verbindlichkeiten		-39.068,66	-0,02
III. Fondsvermögen		198.412.972,54	100,00

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

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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									
XS2456247787	1,5000 % BASF SE - Anleihe 2022/2031		EUR	5.100	400	700	% 86,036	4.387.857,42	2,21
XS2630111719	4,6250 % Bayer AG - Medium Term Notes 2023/2033		EUR	7.703	8.163	460	% 101,320	7.804.660,34	3,93
XS2630117328	4,0000 % Continental AG - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	3.856	4.085	229	% 99,480	3.835.965,00	1,93
XS2484327999	1,8750 % Deutsche Bahn Finance GmbH - Anleihe 2022/2030		EUR	4.627	468	719	% 91,263	4.222.725,13	2,13
XS2574873266	3,5000 % E.ON SE - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	4.113	4.699	586	% 99,236	4.081.563,11	2,06
XS2629468278	3,6250 % Robert Bosch GmbH - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	5.100	5.400	300	% 99,054	5.051.748,39	2,55
XS2523390271	2,5000 % RWE AG - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	6.427	650	998	% 97,868	6.289.967,36	3,17
							EUR	35.674.486,75	17,98
Ausland									
XS2631416950	3,5000 % ASML Holding N.V. - Registered Notes 2023/2025		EUR	5.142	5.447	305	% 99,747	5.128.975,83	2,59
FR001400CH94	2,7500 % Autoroutes du Sud de la France - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	4.800	5.000	200	% 92,504	4.440.185,28	2,24
XS2267889991	2,0000 % Autostrade per l'Italia S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2028		EUR	6.427	659	1.007	% 87,684	5.635.473,17	2,84
XS2589367528	5,3750 % B.A.T. Netherlands Finance BV - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	4.113	4.630	517	% 100,828	4.147.067,98	2,09
XS2447561403	0,5000 % BMW Finance N.V. - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	6.427	650	998	% 95,332	6.126.997,92	3,09
FR001400DNG3	4,6250 % Bouygues S.A. - Bonds 2022/2032		EUR	6.400	600	1.000	% 104,205	6.669.125,12	3,36
XS2582814039	3,7500 % British Telecommunications PLC - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	4.113	4.630	517	% 97,133	3.995.092,22	2,01
XS2337061753	0,8750 % CCEP Finance (Ireland) DAC - Guaranteed Notes 2021/2033		EUR	5.142	5.447	305	% 75,826	3.898.980,12	1,97
XS2648077191	4,0000 % CRH SMW Finance DAC - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	3.856	4.085	229	% 99,263	3.827.577,42	1,93
FR0014003Q41	0,0000 % Danone S.A. - Medium Term Notes 2021/2025		EUR	5.100	400	700	% 92,328	4.708.728,51	2,37
XS2459544339	1,8750 % EDP Finance B.V. - Anleihe 2022/2029		EUR	6.400	600	1.000	% 89,846	5.750.174,08	2,90
FR001400FDB0	4,2500 % Electricité de France (E.D.F.) - Medium Term Notes 2023/2032		EUR	5.100	400	700	% 99,349	5.066.781,66	2,55
FR001400FIG3	3,6250 % Engie S.A. - Medium Term Notes 2023/2030		EUR	5.100	400	700	% 98,683	5.032.820,25	2,54
XS2433135543	1,4750 % Holding d'Infrastructures de Transport S.A.S. - Medium Term Notes 2022/2031		EUR	5.100	400	700	% 80,389	4.099.839,00	2,07
XS2320459063	1,7500 % Imperial Brands Fin.Ned.BV - Medium Term Notes 2021/2033		EUR	5.142	5.787	645	% 73,634	3.786.259,25	1,91
FR0014001O6	0,0000 % La Poste - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	5.400	6.200	800	% 80,448	4.344.183,90	2,19
FR001400HX81	2,8750 % L'Oréal S.A. - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	5.100	5.400	300	% 98,234	5.009.922,27	2,52
DE000A3LH6U5	3,7000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	5.142	5.447	305	% 100,206	5.152.615,66	2,60
XS2381853279	0,2500 % National Grid PLC - Medium Term Notes 2021/2028		EUR	4.370	4.919	549	% 83,596	3.653.139,52	1,84
XS2350621863	0,0000 % Nestlé Finance Intl Ltd. - Medium Term Notes 2021/2026		EUR	6.427	650	998	% 91,130	5.856.954,02	2,95
XS2531569965	3,2500 % Orsted A/S - Medium Term Notes 2022/2031		EUR	4.627	403	682	% 94,955	4.393.563,69	2,21
FR001400IEQ0	4,8750 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	3.856	4.085	229	% 100,900	3.890.713,64	1,96
XS2631867533	3,7500 % RELX Finance B.V. - Guaranteed Notes 2023/2031		EUR	3.856	4.085	229	% 99,702	3.844.516,45	1,94
FR0014009KS6	0,8750 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2022/2025		EUR	4.400	5.000	600	% 95,708	4.211.170,92	2,12
XS2589790109	3,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	6.400	7.300	900	% 98,863	6.327.228,16	3,19
XS2634690114	4,2500 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2023/2031		EUR	6.427	6.809	382	% 97,996	6.298.174,00	3,17
FR001400DQ92	5,0000 % Suez S.A. - Medium Term Notes 2022/2032		EUR	4.600	400	700	% 104,857	4.823.424,76	2,43
XS2484587048	2,5920 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2022/2031		EUR	5.100	5.400	300	% 92,306	4.707.614,16	2,37
XS2477935345	1,6250 % TenneT Holding B.V. - Anleihe 2022/2026		EUR	6.427	659	1.007	% 95,026	6.107.306,88	3,08
XS2607193435	3,6250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA - Medium Term Notes 2023/2029		EUR	3.856	4.085	229	% 98,664	3.804.477,28	1,92

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials Diversified UCITS ETF

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
DE000A3KNP96	0,7500 % TRATON Finance Luxembourg S.A. - Medium Term Notes 2021/2029		EUR	6.400	600	1.000	% 83,219	5.326.030,72	2,68
XS2234567233	0,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe 2020/2028		EUR	6.400	600	1.000	% 85,081	5.445.204,48	2,74
XS2626022573	4,1250 % WPP Finance S.A. - Medium Term Notes 2023/2028		EUR	3.856	4.085	229	% 100,013	3.856.502,05	1,94
Summe Wertpapiervermögen							EUR	159.366.820,37	80,32
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	195.041.307,12	98,30
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle							EUR	1.152.689,08	0,58
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.152.689,08	0,58
Zinsansprüche							EUR	2.258.045,00	1,14
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	2.258.045,00	1,14
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung							EUR	-39.068,66	-0,02
Fondsvermögen							EUR	-39.068,66	-0,02
Anteilwert							EUR	198.412.972,54	100,00 ¹⁾
Umlaufende Anteile							STK	94,15	
								2.107.308,00	

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 (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					
XS2199266698	1,3750 % Bayer AG - Anleihe 2020/2032	EUR	800	8.900	
Ausland					
XS2195092601	2,2500 % Abertis Infraestructuras S.A. - Medium Term Notes 2020/2029	EUR	5.200	5.200	
FR0013505633	2,7500 % Aéroports de Paris S.A. - Anleihe 2020/2030	EUR	0	8.100	
XS2185867913	1,6250 % Airbus SE - Anleihe 2020/2030	EUR	659	7.434	
BE6320935271	2,8750 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2020/2032	EUR	0	9.388	
FR0013519071	1,1250 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2030	EUR	4.700	4.700	
FR0013507878	2,3750 % Capgemini SE - Anleihe 2020/2032	EUR	0	6.500	
FR0013505260	2,6250 % Carrefour S.A. - Anleihe 2020/2027	EUR	0	5.400	
XS2337060607	0,0000 % CCEP Finance (Ireland) DAC - Guaranteed Notes 2021/2025	EUR	4.630	4.630	
FR0013512621	1,0000 % Compagnie Fin. Ind. Autoroutes - Anleihe 2020/2031	EUR	400	5.500	
XS2147889690	2,5000 % Diageo Finance PLC - Anleihe 2020/2032	EUR	0	5.440	
XS2176785447	2,0000 % ENI S.p.A. - Medium Term Notes 2020/2031	EUR	447	5.887	
XS2178833690	1,3750 % Equinor ASA - Anleihe 2020/2032	EUR	447	5.887	
FR0013516077	0,5000 % EssilorLuxottica S.A. - Medium Term Notes 2020/2028	EUR	600	7.400	
XS2384273715	0,5000 % Holcim Finance [Luxembourg] S.A. - Medium Term Notes 2021/2030	EUR	0	5.440	
XS2455983861	1,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	400	5.800	
FR0013508694	1,3750 % La Poste - Anleihe 2020/2032	EUR	0	6.200	
DE000A289XJ2	2,0000 % Mercedes-Benz International Finance B.V. - Anleihe 2020/2026	EUR	7.295	7.295	
DE000A289RN6	2,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	0	8.130	
XS2156506854	1,2500 % Naturgy Finance B.V. - Anleihe 2020/2026	EUR	0	5.400	
FR0013506532	1,7500 % Pernod-Ricard S.A. - Anleihe 2020/2030	EUR	0	5.400	
XS2170736263	1,1250 % Richemont Intl Holding S.A. - Guaranteed Notes 2020/2032	EUR	4.919	4.919	
FR0013505112	1,5000 % Sanofi S.A. - Medium Term Notes 2020/2030	EUR	0	5.400	
XS2170386853	1,2500 % Shell International Finance BV - Medium Term Notes 2020/2032	EUR	467	5.887	
XS2526839175	2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV - Medium Term Notes 2022/2025	EUR	0	5.400	
XS2356040357	0,7500 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2021/2029	EUR	0	6.775	
XS2597110027	4,3750 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2023/2030	EUR	7.334	7.334	
XS2177441990	1,2010 % Telefonica Emisiones S.A.U. - Anleihe 2020/2027	EUR	600	7.400	
XS2153409029	1,9940 % TotalEnergies Capital International S.A. - Medium Term Notes 2020/2032	EUR	0	8.100	

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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		344.592,31	0,164
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		1.925.240,91	0,914
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		10.728,38	0,005
Summe der Erträge		2.280.561,60	1,082
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-208.792,60	-0,099
2. Sonstige Aufwendungen		-0,01	0,000
Summe der Aufwendungen		-208.792,61	-0,099
III. Ordentlicher Nettoertrag		2.071.768,99	0,983
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		110.930,82	0,053
2. Realisierte Verluste		-15.179.227,36	-7,203
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-15.068.296,54	-7,150
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-12.996.527,55	-6,167
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		351.728,61	0,167
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		19.903.184,18	9,445
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		20.254.912,79	9,612
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		7.258.385,24	3,444
Entwicklung des Sondervermögens		2022 / 2023	
	EUR	EUR	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		223.657.444,51	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-740.065,48	
2. Zwischenausschüttungen		-1.160.800,16	
3. Mittelzufluss (netto)		-29.149.141,50	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	1.894.238,00		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-31.043.379,50		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-1.452.850,07	
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		7.258.385,24	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	351.728,61		
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	19.903.184,18		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		198.412.972,54	

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

Deka iBoxx € Liquid Non-Financials 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	94,15
Umlaufende Anteile	STK	2.107.308,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,30

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)

0,15

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.

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

