

Stichtag: 22.09.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

Vollständige Durchschau gemäß Art. 390 Absatz 7 CRR i.V.m. Art. 6 Absatz 1 der delegierten Verordnung (EU) 1187/2014

In der nachfolgenden Aufstellung werden für eigene Fonds die über WM Datenservice öffentlich zugänglichen Konzernverflechtungen ausgewiesen. Für Fremdfonds werden die Angaben der jeweiligen Kapitalanlagegesellschaft übernommen. Die Bildung der Kreditnehmereinheit / Gruppe verbundener Kunden gemäß Artikel 4 (1) Nr. 39 CRR obliegt dem Kreditinstitut und kann abweichen.

Hiermit bestätigen wir Ihnen, dass der Fonds unseres Erachtens keine zusätzlichen Risiken aus der Struktur des Geschäfts gem. Artikel 7 Absatz 1 der EU-VO Nr. 1187/2014 aufweist.

Einzelaufstellung														
ISIN	Gattung	Whg.	Nominale	Ausf.-risikop.	Tageswert	Stückzins/Dividende	% FV	Add-On	Bemessungsgrundl.	% Bem.-grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko-gew. %	KSA-Wert in 1000
BE0000347568	Königreich Belgien Obl. Lin. 19/29	EUR	1.614.000	B	1.794.170,82	3.740,94	3,352		1.797.911,76	3,352	0	0,000	0	0
BE0000341504	Königreich Belgien Obl. Lin. S.81 17/27	EUR	1.339.000	B	1.457.263,83	2.758,71	2,722		1.460.022,54	2,722	0	0,000	0	0
BE0000342510	Königreich Belgien Obl. Lin. S.82 17/24	EUR	1.255.000	B	1.314.116,78	5.794,95	2,461		1.319.911,73	2,461	0	0,000	0	0
BE0000345547	Königreich Belgien Obl. Lin. S.85 18/28	EUR	1.436.000	B	1.574.961,72	2.958,55	2,942		1.577.920,27	2,942	0	0,000	0	0
Konzern 450063	Belgien, Königreich				6.140.513,15	15.253,15	11,478		6.155.766,30	11,478		0,000	0	0
	Bankguthaben	EUR		B	353.862,32	0,00	0,660		353.862,32	0,660	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	242,68	0,00	0,000		242,68	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-5.245,01	0,00	-0,010		0,00	0,000	0	0,000	0	0
DE0001102416	WPL: Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	636.000	B	0,00	0,00	0,000		676.218,35	1,261	0	0,000	0	0
DE0001102473	WPL: Bundesrep.Deutschland Anl. 19/29	EUR	177.471	B	0,00	0,00	0,000		186.736,76	0,348	0	0,000	0	0
NL0012818504	WPL: Königreich Niederlande Anl. 18/28	EUR	999.000	B	0,00	0,00	0,000		1.100.767,04	2,053	0	0,000	0	0
FR0013451507	WPL: Rep. Frankreich OAT 18/29	EUR	2.455.000	B	0,00	0,00	0,000		2.526.833,30	4,712	0	0,000	0	0
Konzern 239000	DekaBank Deutsche Girozentrale				348.859,99	0,00	0,651		4.844.660,44	9,034		0,000	0	0
DE0001102416	Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	2.671.000	B	2.835.854,12	4.050,29	5,295		2.839.904,41	5,295	0	0,000	0	0
DE0001102424	Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	2.583.000	B	2.796.536,61	1.415,34	5,217		2.797.951,95	5,217	0	0,000	0	0
DE0001102465	Bundesrep.Deutschland Anl. 19/29	EUR	2.321.000	B	2.492.328,56	3.519,55	4,654		2.495.848,11	4,654	0	0,000	0	0
DE0001102473	Bundesrep.Deutschland Anl. 19/29	EUR	2.321.000	B	2.442.179,41	0,00	4,554		2.442.179,41	4,554	0	0,000	0	0
Konzern 110000	Deutschland, Bundesrepublik				10.566.898,70	8.985,18	19,720		10.575.883,88	19,720		0,000	0	0
FR0013286192	Rep. Frankreich OAT 17/28	EUR	2.617.000	B	2.857.050,34	6.560,42	5,340		2.863.610,76	5,340	0	0,000	0	0
FR0013341682	Rep. Frankreich OAT 17/28	EUR	2.439.000	B	2.671.186,70	15.193,77	5,009		2.686.380,47	5,009	0	0,000	0	0
FR0013451507	Rep. Frankreich OAT 18/29	EUR	2.455.000	B	2.526.833,30	0,00	4,712		2.526.833,30	4,712	0	0,000	0	0
FR0013415627	Rep. Frankreich OAT 19/25	EUR	2.498.000	B	2.567.269,54	0,00	4,787		2.567.269,54	4,787	0	0,000	0	0
Konzern 450287	Frankreich, Republik				10.622.339,88	21.754,19	19,848		10.644.094,07	19,848		0,000	0	0
IT0005323032	Republik Italien B.T.P. 18/28	EUR	2.250.000	B	2.480.265,00	6.603,26	4,637		2.486.868,26	4,637	0	0,000	0	0

Stichtag: 22.09.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 1-10 UCITS ETF

ISIN	Gattung	Whg.	Nominale	Ausf.- risikop.	Tageswert	Stückzins/ Dividende	% FV	Add-On	Bemessungs- grundl.	% Bem.- grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000
IT0005340929	Republik Italien B.T.P. 18/28	EUR	1.935.000	B	2.265.478,65	17.023,74	4,256		2.282.502,39	4,256	0	0,000	0	0
IT0005365165	Republik Italien B.T.P. 19/29	EUR	1.976.000	B	2.363.256,48	8.698,70	4,423		2.371.955,18	4,423	0	0,000	0	0
IT0005383309	Republik Italien B.T.P. 19/30	EUR	2.172.000	B	2.286.659,88	14.100,20	4,290		2.300.760,08	4,290	0	0,000	0	0
Konzern 465688 Italien, Republik					9.395.660,01	46.425,90	17,606		9.442.085,91	17,606		0,000	0	0
NL0012650469	Königreich Niederlande Anl. 17/24	EUR	1.499.000	B	1.532.626,32	0,00	2,858		1.532.626,32	2,858	0	0,000	0	0
NL0012171458	Königreich Niederlande Anl. 17/27	EUR	1.500.000	B	1.635.930,00	2.188,36	3,055		1.638.118,36	3,055	0	0,000	0	0
NL0012818504	Königreich Niederlande Anl. 18/28	EUR	1.207.000	B	1.328.194,87	1.760,90	2,480		1.329.955,77	2,480	0	0,000	0	0
NL0014555419	Königreich Niederlande Anl. 20/30	EUR	1.369.000	B	1.423.282,22	0,00	2,654		1.423.282,22	2,654	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					5.920.033,41	3.949,26	11,046		5.923.982,67	11,046		0,000	0	0
AT0000A269M8	Republik Österreich MTN 19/29	EUR	1.100.000	B	1.187.175,00	3.260,93	2,220		1.190.435,93	2,220	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					1.187.175,00	3.260,93	2,220		1.190.435,93	2,220		0,000	0	0
ES0000012E51	Königreich Spanien Bonos 19/29	EUR	2.078.000	B	2.320.547,90	12.134,95	4,350		2.332.682,85	4,350	0	0,000	0	0
ES0000012F43	Königreich Spanien Bonos 19/29	EUR	2.114.000	B	2.205.663,04	11.401,74	4,134		2.217.064,78	4,134	0	0,000	0	0
ES0000012A89	Königreich Spanien Obligaciones 17/27	EUR	2.173.000	B	2.406.358,47	28.323,21	4,540		2.434.681,68	4,540	0	0,000	0	0
ES0000012G34	Königreich Spanien Obligaciones 20/30	EUR	2.139.000	B	2.352.857,22	10.738,83	4,407		2.363.596,05	4,407	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					9.285.426,63	62.598,73	17,431		9.348.025,36	17,431		0,000	0	0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 53.466.906,77 & + & 162.227,34 & = & 53.629.134,11 \end{array}$$

Forderungen ggü. Mitgliedern des Haftungsverbundes werden mit 0%, Deka-Zielfonds mit dem haftungsverbundprivilegierten Risikogewicht berücksichtigt.

Disclaimer:

Die Portfoliozusammensetzung wird bei Publikumsfonds aufgrund des Erfordernisses der Gleichbehandlung aller Anleger gemäß § 26 Abs. 3. KAGB i. V. m. § 2 Abs. 2 Satz 1 KAVerOV mit einem Zeitabstand von einem Monat im Internet-Reporting bereitgestellt und darf nur für Zwecke des Meldewesens nach Artikel 390 Absatz 7 CRR i. V. m. der delegierten Verordnung (EU) 1187/2014 genutzt werden.