

Stichtag: 17.12.2019

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 1-3 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
BE0000321308	Königreich Belgien Obl. Lin. S.61 11/21	EUR	5.171.000	B	5.623.733,98	49.237,53	4,059		5.672.971,51	4,059	0	0,000	0	0
BE0000325341	Königreich Belgien Obl. Lin. S.65 12/22	EUR	5.093.000	B	5.786.450,15	48.494,82	4,175		5.834.944,97	4,175	0	0,000	0	0
Konzern 450063 Belgien, Königreich					11.410.184,13	97.732,35	8,233		11.507.916,48	8,233		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	1.586.664,94	0,00	1,135		1.586.664,94	1,135	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	298,15	0,00	0,000		298,15	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-10.781,68	0,00	-0,008		0,00	0,000	0	0,000	0	0
DE0001141752	WPL: Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.175 17/22	EUR	4.439.000	B	0,00	0,00	0,000		4.505.763,45	3,224	0	0,000	0	0
BE0000321308	WPL: Königreich Belgien Obl. Lin. S.61 11/21	EUR	2.000.000	B	0,00	0,00	0,000		2.194.148,72	1,570	0	0,000	0	0
ES00000128B8	WPL: Königreich Spanien Bonos 16/21	EUR	2.875.000	B	0,00	0,00	0,000		2.937.897,34	2,102	0	0,000	0	0
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					1.576.181,41	0,00	1,128		11.224.772,59	8,031		0,000		0
DE0001141745	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.174 16/21	EUR	6.048.000	B	6.118.953,32	0,00	4,378		6.118.953,32	4,378	0	0,000	0	0
DE0001141752	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.175 17/22	EUR	5.730.000	B	5.816.180,35	0,00	4,161		5.816.180,35	4,161	0	0,000	0	0
DE0001141760	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.176 17/22	EUR	6.366.000	B	6.482.115,84	0,00	4,638		6.482.115,84	4,638	0	0,000	0	0
DE0001141778	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.177 18/23	EUR	5.093.000	B	5.200.424,10	0,00	3,721		5.200.424,10	3,721	0	0,000	0	0
Konzern 110000 Deutschland, Bundesrepublik					23.617.673,61	0,00	16,897		23.617.673,61	16,897		0,000		0
FI4000242862	Republik Finnland Bonds 17/22	EUR	1.592.000	B	1.614.229,57	0,00	1,155		1.614.229,57	1,155	0	0,000	0	0
Konzern 453568 Finnland, Republik					1.614.229,57	0,00	1,155		1.614.229,57	1,155		0,000		0
FR0013157096	Rep. Frankreich OAT 16/21	EUR	6.565.000	B	6.622.914,46	0,00	4,738		6.622.914,46	4,738	0	0,000	0	0
FR0013219177	Rep. Frankreich OAT 16/22	EUR	7.046.000	B	7.153.099,20	0,00	5,118		7.153.099,20	5,118	0	0,000	0	0
FR0013283686	Rep. Frankreich OAT 17/23	EUR	7.137.000	B	7.273.869,82	0,00	5,204		7.273.869,82	5,204	0	0,000	0	0
FR0013398583	Rep. Frankreich OAT 19/22	EUR	6.509.000	B	6.598.542,36	0,00	4,721		6.598.542,36	4,721	0	0,000	0	0
Konzern 450287 Frankreich, Republik					27.648.425,84	0,00	19,781		27.648.425,84	19,781		0,000		0
IE00BDHDPQ37	Republik Irland Treasury Bonds 17/22	EUR	1.623.000	B	1.644.867,17	0,00	1,177		1.644.867,17	1,177	0	0,000	0	0
Konzern 464541 Irland, Republik					1.644.867,17	0,00	1,177		1.644.867,17	1,177		0,000		0

Stichtag: 17.12.2019

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

ISIN	Gattung	Whg.	Nominale	Ausf.-risikop.	Tageswert	Stückzins/Dividende	% FV	Add-On	Bemessungsgrundl.	% Bem.-grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko-gew. %	KSA-Wert in 1000
IT0005175598	Republik Italien B.T.P. 16/21	EUR	5.543.000	B	5.594.740,58	1.226,67	4,004		5.595.967,25	4,004	0	0,000	0	0
IT0005277444	Republik Italien B.T.P. 17/22	EUR	5.778.000	B	5.905.321,70	19.783,29	4,239		5.925.104,99	4,239	0	0,000	0	0
IT0005325946	Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	5.455.000	B	5.588.138,00	15.518,28	4,009		5.603.656,28	4,009	0	0,000	0	0
IT0005366007	Republik Italien B.T.P. 19/22	EUR	5.432.000	B	5.565.572,34	23.174,57	3,998		5.588.746,91	3,998	0	0,000	0	0
Konzern 465688 Italien, Republik					22.653.772,62	59.702,81	16,250		22.713.475,43	16,250		0,000		0
NL0009712470	Königreich Niederlande Anl. 11/21	EUR	5.250.000	B	5.573.124,38	73.191,60	4,040		5.646.315,98	4,040	0	0,000	0	0
NL0010060257	Königreich Niederlande Anl. 12/22	EUR	4.855.000	B	5.219.052,18	46.858,71	3,767		5.265.910,89	3,767	0	0,000	0	0
NL0011896857	Königreich Niederlande Anl. 16/22	EUR	4.896.000	B	4.958.852,40	0,00	3,548		4.958.852,40	3,548	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					15.751.028,96	120.050,31	11,355		15.871.079,27	11,355		0,000		0
AT0000A001X2	Republik Österreich MTN 06/21 144A	EUR	5.068.000	B	5.432.731,29	46.041,26	3,920		5.478.772,55	3,920	0	0,000	0	0
AT0000A1XM92	Republik Österreich MTN 17/22	EUR	1.982.000	B	2.014.093,54	0,00	1,441		2.014.093,54	1,441	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					7.446.824,83	46.041,26	5,361		7.492.866,09	5,361		0,000		0
ES00000128B8	Königreich Spanien Bonos 16/21	EUR	6.996.000	B	7.128.696,63	20.357,21	5,115		7.149.053,84	5,115	0	0,000	0	0
ES0000012A97	Königreich Spanien Bonos 17/22	EUR	5.945.000	B	6.077.408,82	3.581,62	4,351		6.080.990,44	4,351	0	0,000	0	0
ES0000012C46	Königreich Spanien Bonos 18/21	EUR	6.019.000	B	6.067.647,97	402,91	4,341		6.068.050,88	4,341	0	0,000	0	0
ES00000128O1	Königreich Spanien Obligaciones 17/22	EUR	6.653.000	B	6.771.988,91	16.941,52	4,857		6.788.930,43	4,857	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					26.045.742,33	41.283,26	18,664		26.087.025,59	18,664		0,000		0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 139.408.930,47 & + & 364.809,99 & = & 139.773.740,46 \end{array}$$

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.