

Stichtag: 23.07.2020

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	Bemessungs- grundl.	% Bem.- grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000
BE0000339482	Königreich Belgien Obl. Lin. S.79 16/23	EUR	3.620.000	B	3.716.676,08	5.519,02	2,953		3.722.195,10	2,953	0	0,000	0	0
Konzern 450063	Belgien, Königreich				3.716.676,08	5.519,02	2,953		3.722.195,10	2,953		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	1.372.976,10	0,00	1,089		1.372.976,10	1,089	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	380,10	0,00	0,000		380,10	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-13.587,99	0,00	-0,011		0,00	0,000	0	0,000	0	0
BE0000339482	WPL: Königreich Belgien Obl. Lin. S.79 16/23	EUR	3.300.000	B	0,00	0,00	0,000		3.394.570,38	2,693	0	0,000	0	0
FR0013219177	WPL: Rep. Frankreich OAT 16/22	EUR	1.000.000	B	0,00	0,00	0,000		1.011.979,80	0,803	0	0,000	0	0
Konzern 239000	DekaBank Deutsche Girozentrale				1.359.768,21	0,00	1,079		5.779.906,38	4,586		0,000		0
DE0001141752	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.175 17/22	EUR	6.480.000	B	6.553.564,20	0,00	5,200		6.553.564,20	5,200	0	0,000	0	0
DE0001141760	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.176 17/22	EUR	6.164.000	B	6.259.110,52	0,00	4,966		6.259.110,52	4,966	0	0,000	0	0
DE0001141778	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.177 18/23	EUR	5.848.000	B	5.961.854,13	0,00	4,730		5.961.854,13	4,730	0	0,000	0	0
DE0001141786	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.178 18/23	EUR	5.848.000	B	5.983.865,41	0,00	4,748		5.983.865,41	4,748	0	0,000	0	0
Konzern 110000	Deutschland, Bundesrepublik				24.758.394,26	0,00	19,644		24.758.394,26	19,644		0,000		0
FI4000219787	Republik Finnland Bonds 16/23	EUR	2.143.000	B	2.185.191,17	0,00	1,734		2.185.191,17	1,734	0	0,000	0	0
FI4000242862	Republik Finnland Bonds 17/22	EUR	1.905.000	B	1.925.019,26	0,00	1,527		1.925.019,26	1,527	0	0,000	0	0
Konzern 453568	Finnland, Republik				4.110.210,43	0,00	3,261		4.110.210,43	3,261		0,000		0
FR0013219177	Rep. Frankreich OAT 16/22	EUR	7.155.000	B	7.238.176,88	0,00	5,743		7.238.176,88	5,743	0	0,000	0	0
FR0013283686	Rep. Frankreich OAT 17/23	EUR	8.996.000	B	9.147.452,16	0,00	7,258		9.147.452,16	7,258	0	0,000	0	0
FR0013398583	Rep. Frankreich OAT 19/22	EUR	6.609.000	B	6.675.056,96	0,00	5,296		6.675.056,96	5,296	0	0,000	0	0
FR0013479102	Rep. Frankreich OAT 19/23	EUR	1.733.000	B	1.760.271,70	0,00	1,397		1.760.271,70	1,397	0	0,000	0	0
Konzern 450287	Frankreich, Republik				24.820.957,70	0,00	19,694		24.820.957,70	19,694		0,000		0
IE00BDHDPQ37	Republik Irland Treasury Bonds 17/22	EUR	1.943.000	B	1.968.375,58	0,00	1,562		1.968.375,58	1,562	0	0,000	0	0
Konzern 464541	Irland, Republik				1.968.375,58	0,00	1,562		1.968.375,58	1,562		0,000		0
IT0005277444	Republik Italien B.T.P. 17/22	EUR	6.296.000	B	6.421.227,44	27.553,81	5,117		6.448.781,25	5,117	0	0,000	0	0

Stichtag: 23.07.2020

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	Bemessungs- grundl.	% Bem.- grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000
IT0005325946	Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	5.781.000	B	5.918.529,41	22.087,19	4,714		5.940.616,60	4,714	0	0,000	0	0
IT0005344335	Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	6.062.000	B	6.510.619,52	47.477,58	5,203		6.558.097,10	5,203	0	0,000	0	0
IT0005388928	Republik Italien Zero C.T.Z. 19/21	EUR	6.342.000	B	6.350.482,43	0,00	5,039		6.350.482,43	5,039	0	0,000	0	0
Konzern 465688 Italien, Republik					25.200.858,80	97.118,58	20,072		25.297.977,38	20,072		0,000		0
NL0011896857	Königreich Niederlande Anl. 16/22	EUR	5.860.000	B	5.913.355,30	0,00	4,692		5.913.355,30	4,692	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					5.913.355,30	0,00	4,692		5.913.355,30	4,692		0,000		0
AT0000A1PE50	Republik Österreich Bundesanl. 16/23	EUR	3.653.000	B	3.719.566,79	0,00	2,951		3.719.566,79	2,951	0	0,000	0	0
AT0000A1XM92	Republik Österreich MTN 17/22	EUR	2.658.000	B	2.693.723,52	0,00	2,137		2.693.723,52	2,137	0	0,000	0	0
AT0000A2EJZ6	Republik Österreich MTN 20/23	EUR	1.905.000	B	1.936.962,85	0,00	1,537		1.936.962,85	1,537	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					8.350.253,16	0,00	6,625		8.350.253,16	6,625		0,000		0
SI0002103974	Republik Slowenien Bonds 20/23	EUR	762.000	B	774.319,48	492,69	0,615		774.812,17	0,615	0	0,000	0	0
Konzern 132915 Slowenien, Republik					774.319,48	492,69	0,615		774.812,17	0,615		0,000		0
ES0000012A97	Königreich Spanien Bonos 17/22	EUR	5.721.000	B	5.833.703,70	18.991,84	4,644		5.852.695,54	4,644	0	0,000	0	0
ES0000012C46	Königreich Spanien Bonos 18/21	EUR	6.415.000	B	6.453.554,15	2.366,19	5,122		6.455.920,34	5,122	0	0,000	0	0
ES0000012B62	Königreich Spanien Bonos 18/23	EUR	6.000.000	B	6.126.180,00	20.827,87	4,877		6.147.007,87	4,877	0	0,000	0	0
ES00000128O1	Königreich Spanien Obligaciones 17/22	EUR	6.402.000	B	6.495.021,06	6.173,98	5,158		6.501.195,04	5,158	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					24.908.458,91	48.359,88	19,802		24.956.818,79	19,802		0,000		0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 125.881.627,91 & + & 151.490,17 & = & 126.033.118,08 \end{array}$$

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.