

Stichtag: 18.12.2020

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	Bemessungsgrundl.	% Bem.-grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko-gew. %	KSA-Wert in 1000
BE0000325341	Königreich Belgien Obl. Lin. S.65 12/22	EUR	5.012.000	B	5.458.218,36	49.605,07	4,132		5.507.823,43	4,132	0	0,000	0	0
	Konzern 450063 Belgien, Königreich				5.458.218,36	49.605,07	4,132		5.507.823,43	4,132	0,000		0	0
	Bankguthaben	EUR		B	1.229.078,29	0,00	0,922		1.229.078,29	0,922	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	323,60	0,00	0,000		323,60	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-12.063,43	0,00	-0,009		0,00	0,000	0	0,000	0	0
DE0001141778	WPL: Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.177 18/23	EUR	5.207.000	B	0,00	0,00	0,000		5.300.503,14	3,976	0	0,000	0	0
FR0013219177	WPL: Rep. Frankreich OAT 16/22	EUR	50.000	B	0,00	0,00	0,000		50.504,50	0,038	0	0,000	0	0
	Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale				1.217.338,46	0,00	0,913		6.580.409,53	4,936	0,000		0	0
DE0001141760	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.176 17/22	EUR	6.135.000	B	6.217.871,58	0,00	4,664		6.217.871,58	4,664	0	0,000	0	0
DE0001141778	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.177 18/23	EUR	5.821.000	B	5.925.361,80	0,00	4,445		5.925.361,80	4,445	0	0,000	0	0
DE0001141786	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.178 18/23	EUR	5.821.000	B	5.949.665,06	0,00	4,463		5.949.665,06	4,463	0	0,000	0	0
DE0001141794	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.179 19/24	EUR	7.394.000	B	7.582.768,82	0,00	5,688		7.582.768,82	5,688	0	0,000	0	0
	Konzern 110000 Deutschland, Bundesrepublik				25.675.667,26	0,00	19,260		25.675.667,26	19,260	0,000		0	0
FR0013219177	Rep. Frankreich OAT 16/22	EUR	6.453.000	B	6.518.768,98	0,00	4,890		6.518.768,98	4,890	0	0,000	0	0
FR0013283686	Rep. Frankreich OAT 17/23	EUR	8.114.000	B	8.244.777,40	0,00	6,185		8.244.777,40	6,185	0	0,000	0	0
FR0013344751	Rep. Frankreich OAT 18/24	EUR	8.119.000	B	8.305.818,19	0,00	6,231		8.305.818,19	6,231	0	0,000	0	0
FR0013479102	Rep. Frankreich OAT 19/23	EUR	3.275.000	B	3.325.238,50	0,00	2,494		3.325.238,50	2,494	0	0,000	0	0
	Konzern 450287 Frankreich, Republik				26.394.603,07	0,00	19,800		26.394.603,07	19,800	0,000		0	0
IE00BDHDPQ37	Republik Irland Treasury Bonds 17/22	EUR	1.586.000	B	1.606.062,90	0,00	1,205		1.606.062,90	1,205	0	0,000	0	0
	Konzern 464541 Irland, Republik				1.606.062,90	0,00	1,205		1.606.062,90	1,205	0,000		0	0
IT0005277444	Republik Italien B.T.P. 17/22	EUR	5.711.000	B	5.835.328,47	19.973,08	4,392		5.855.301,55	4,392	0	0,000	0	0
IT0005325946	Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	5.244.000	B	5.400.218,76	15.413,30	4,062		5.415.632,06	4,062	0	0,000	0	0
IT0005344335	Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	5.499.000	B	5.932.364,64	30.350,08	4,473		5.962.714,72	4,473	0	0,000	0	0
IT0005413684	Republik Italien B.T.P. 20/23	EUR	5.268.000	B	5.359.505,16	5.539,83	4,025		5.365.044,99	4,025	0	0,000	0	0

Stichtag: 18.12.2020

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	Bemessungsgrundl.	% Bem.-grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko-gew. %	KSA-Wert in 1000
Konzern 465688 Italien, Republik					22.527.417,03	71.276,29	16,952		22.598.693,32	16,952		0,000		0
NL0010060257	Königreich Niederlande Anl. 12/22	EUR	4.799.000	B	5.024.217,07	47.332,60	3,804		5.071.549,67	3,804	0	0,000	0	0
NL0010418810	Königreich Niederlande Anl. 13/23	EUR	5.540.000	B	5.896.457,45	42.498,63	4,455		5.938.956,08	4,455	0	0,000	0	0
NL0012650469	Königreich Niederlande Anl. 17/24	EUR	4.839.000	B	4.947.593,93	0,00	3,711		4.947.593,93	3,711	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					15.868.268,45	89.831,23	11,971		15.958.099,68	11,971		0,000		0
AT0000A1PE50	Republik Österreich Bundesanl. 16/23	EUR	3.017.000	B	3.070.201,17	0,00	2,303		3.070.201,17	2,303	0	0,000	0	0
AT0000A1XM92	Republik Österreich MTN 17/22	EUR	2.195.000	B	2.221.405,85	0,00	1,666		2.221.405,85	1,666	0	0,000	0	0
AT0000A2EJZ6	Republik Österreich MTN 20/23	EUR	1.948.000	B	1.978.839,18	0,00	1,484		1.978.839,18	1,484	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					7.270.446,20	0,00	5,454		7.270.446,20	5,454		0,000		0
SI0002103974	Republik Slowenien Bonds 20/23	EUR	629.000	B	638.970,40	916,79	0,480		639.887,19	0,480	0	0,000	0	0
Konzern 132915 Slowenien, Republik					638.970,40	916,79	0,480		639.887,19	0,480		0,000		0
ES00000123U9	Königreich Spanien Bonos 13/23	EUR	6.486.000	B	7.310.526,26	311.965,97	5,718		7.622.492,23	5,718	0	0,000	0	0
ES0000012A97	Königreich Spanien Bonos 17/22	EUR	5.591.000	B	5.697.983,79	3.584,37	4,277		5.701.568,16	4,277	0	0,000	0	0
ES0000012B62	Königreich Spanien Bonos 18/23	EUR	6.342.000	B	6.493.129,86	8.817,99	4,877		6.501.947,85	4,877	0	0,000	0	0
ES0000012F84	Königreich Spanien Bonos 20/23	EUR	6.525.000	B	6.614.001,00	0,00	4,961		6.614.001,00	4,961	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					26.115.640,91	324.368,33	19,834		26.440.009,24	19,834		0,000		0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 132.772.633,04 & + & 535.997,71 & = & 133.308.630,75 \end{array}$$

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.