

Stichtag: 17.12.2019

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 3-5 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	1.067.000	B	1.095.459,56	338,17	2,412		1.095.797,73	2,412	0	0,000	0	0
BE0000342510	Königreich Belgien Obl. Lin. S.82 17/24	EUR	1.214.000	B	1.266.869,70	961,91	2,790		1.267.831,61	2,790	0	0,000	0	0
Konzern 450063 Belgien, Königreich					2.362.329,26	1.300,08	5,202		2.363.629,34	5,202		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	330.788,85	0,00	0,728		330.788,85	0,728	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	168,24	0,00	0,000		168,24	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-3.623,05	0,00	-0,008		0,00	0,000	0	0,000	0	0
DE0001102374	WPL: Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25	EUR	1.522.666	B	0,00	0,00	0,000		1.612.231,62	3,548	0	0,000	0	0
DE0001141786	WPL: Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.178 18/23	EUR	235.344	B	0,00	0,00	0,000		240.898,99	0,530	0	0,000	0	0
BE0000339482	WPL: Königreich Belgien Obl. Lin. S.79 16/23	EUR	600.000	B	0,00	0,00	0,000		616.193,66	1,356	0	0,000	0	0
FR0010466938	WPL: Rep. Frankreich OAT 07/23	EUR	1.300.000	B	0,00	0,00	0,000		1.551.285,60	3,414	0	0,000	0	0
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					327.334,04	0,00	0,720		4.351.566,96	9,577		0,000		0
DE0001102374	Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25	EUR	2.583.000	B	2.724.073,39	10.862,75	6,019		2.734.936,14	6,019	0	0,000	0	0
DE0001141786	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.178 18/23	EUR	1.797.000	B	1.839.415,85	0,00	4,048		1.839.415,85	4,048	0	0,000	0	0
DE0001141794	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.179 19/24	EUR	2.358.000	B	2.416.902,84	0,00	5,319		2.416.902,84	5,319	0	0,000	0	0
DE0001141802	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24	EUR	1.572.000	B	1.613.998,65	0,00	3,552		1.613.998,65	3,552	0	0,000	0	0
Konzern 110000 Deutschland, Bundesrepublik					8.594.390,73	10.862,75	18,938		8.605.253,48	18,938		0,000		0
FI4000219787	Republik Finnland Bonds 16/23	EUR	615.000	B	627.086,78	0,00	1,380		627.086,78	1,380	0	0,000	0	0
FI4000391529	Republik Finnland Bonds 19/24	EUR	337.000	B	343.815,25	0,00	0,757		343.815,25	0,757	0	0,000	0	0
Konzern 453568 Finnland, Republik					970.902,03	0,00	2,137		970.902,03	2,137		0,000		0
FR0010466938	Rep. Frankreich OAT 07/23	EUR	2.630.000	B	3.121.573,30	16.796,79	6,907		3.138.370,09	6,907	0	0,000	0	0
FR0011486067	Rep. Frankreich OAT 13/23	EUR	2.414.000	B	2.608.538,23	24.008,09	5,794		2.632.546,32	5,794	0	0,000	0	0
FR0013344751	Rep. Frankreich OAT 18/24	EUR	1.774.000	B	1.811.391,49	0,00	3,986		1.811.391,49	3,986	0	0,000	0	0
FR0013415627	Rep. Frankreich OAT 19/25	EUR	1.432.000	B	1.460.342,86	0,00	3,214		1.460.342,86	3,214	0	0,000	0	0
Konzern 450287 Frankreich, Republik					9.001.845,88	40.804,88	19,901		9.042.650,76	19,901		0,000		0

Stichtag: 17.12.2019

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 3-5 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
IT0005246340	Republik Italien B.T.P. 17/24	EUR	1.696.000	B	1.801.545,81	2.930,69	3,971		1.804.476,50	3,971	0	0,000	0	0
IT0005282527	Republik Italien B.T.P. 17/24	EUR	1.746.000	B	1.825.101,48	2.364,78	4,022		1.827.466,26	4,022	0	0,000	0	0
IT0005344335	Republik Italien B.T.P. 18/23	EUR	1.962.000	B	2.118.485,78	10.375,64	4,685		2.128.861,42	4,685	0	0,000	0	0
IT0005367492	Republik Italien B.T.P. 19/24	EUR	1.945.000	B	2.055.208,95	15.816,34	4,558		2.071.025,29	4,558	0	0,000	0	0
Konzern 465688 Italien, Republik					7.800.342,02	31.487,45	17,236		7.831.829,47	17,236		0,000	0	0
NL0010418810	Königreich Niederlande Anl. 13/23	EUR	1.977.000	B	2.144.189,95	14.841,00	4,752		2.159.030,95	4,752	0	0,000	0	0
NL0010733424	Königreich Niederlande Anl. 14/24	EUR	1.720.000	B	1.918.771,80	14.756,28	4,255		1.933.528,08	4,255	0	0,000	0	0
NL0012650469	Königreich Niederlande Anl. 17/24	EUR	1.727.000	B	1.764.290,25	0,00	3,883		1.764.290,25	3,883	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					5.827.252,00	29.597,28	12,890		5.856.849,28	12,890		0,000	0	0
AT0000A1PE50	Republik Österreich Bundesanl. 16/23	EUR	962.000	B	980.374,20	0,00	2,158		980.374,20	2,158	0	0,000	0	0
AT0000A28KX7	Republik Österreich MTN 19/24	EUR	429.000	B	437.811,66	0,00	0,964		437.811,66	0,964	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					1.418.185,86	0,00	3,121		1.418.185,86	3,121		0,000	0	0
ES00000126B2	Königreich Spanien Bonos 14/24	EUR	2.620.000	B	2.983.010,69	9.646,04	6,586		2.992.656,73	6,586	0	0,000	0	0
ES00000126Z1	Königreich Spanien Bonos 15/25	EUR	2.352.000	B	2.557.360,65	23.956,98	5,681		2.581.317,63	5,681	0	0,000	0	0
ES0000012B62	Königreich Spanien Bonos 18/23	EUR	2.119.000	B	2.162.745,70	2.877,44	4,766		2.165.623,14	4,766	0	0,000	0	0
ES0000012E85	Königreich Spanien Bonos 19/24	EUR	1.260.000	B	1.280.720,32	1.222,13	2,821		1.281.942,45	2,821	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					8.983.837,36	37.702,59	19,855		9.021.539,95	19,855		0,000	0	0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 45.286.419,18 & + & 151.755,03 & = & 45.438.174,21 \end{array}$$

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.