

Stichtag: 18.12.2020

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
BE0000332412	Königreich Belgien Obl. Lin. S.72 14/24	EUR	1.622.000	B	1.812.690,43	21.143,77	3,900		1.833.834,20	3,900	0	0,000	0	0
BE0000334434	Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25	EUR	1.904.000	B	2.033.157,84	7.636,87	4,340		2.040.794,71	4,340	0	0,000	0	0
BE0000342510	Königreich Belgien Obl. Lin. S.82 17/24	EUR	1.391.000	B	1.456.118,13	1.162,34	3,099		1.457.280,47	3,099	0	0,000	0	0
Konzern 450063	Belgien, Königreich				5.301.966,40	29.942,98	11,340		5.331.909,38	11,340		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	246.483,88	0,00	0,524		246.483,88	0,524	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	39,60	0,00	0,000		39,60	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-4.239,32	0,00	-0,009		0,00	0,000	0	0,000	0	0
Konzern 239000	DekaBank Deutsche Girozentrale				242.284,16	0,00	0,515		246.523,48	0,524		0,000		0
DE0001102390	Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26	EUR	2.987.000	B	3.184.380,96	12.690,67	6,800		3.197.071,63	6,800	0	0,000	0	0
DE0001141802	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24	EUR	2.203.000	B	2.268.260,13	0,00	4,824		2.268.260,13	4,824	0	0,000	0	0
DE0001141810	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.181 20/25	EUR	1.958.000	B	2.023.142,66	0,00	4,303		2.023.142,66	4,303	0	0,000	0	0
DE0001141828	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.182 20/25	EUR	1.763.000	B	1.827.525,80	0,00	3,887		1.827.525,80	3,887	0	0,000	0	0
Konzern 110000	Deutschland, Bundesrepublik				9.303.309,55	12.690,67	19,813		9.316.000,22	19,813		0,000		0
FI4000391529	Republik Finnland Bonds 19/24	EUR	434.000	B	445.741,91	0,00	0,948		445.741,91	0,948	0	0,000	0	0
Konzern 453568	Finnland, Republik				445.741,91	0,00	0,948		445.741,91	0,948		0,000		0
FR0010916924	Rep. Frankreich OAT 10/26	EUR	2.482.000	B	3.041.293,88	57.358,00	6,590		3.098.651,88	6,590	0	0,000	0	0
FR0012517027	Rep. Frankreich OAT 15/25	EUR	2.257.000	B	2.375.994,23	6.523,66	5,067		2.382.517,89	5,067	0	0,000	0	0
FR0013415627	Rep. Frankreich OAT 19/25	EUR	2.505.000	B	2.577.084,63	0,00	5,481		2.577.084,63	5,481	0	0,000	0	0
FR0013508470	Rep. Frankreich OAT 20/26	EUR	1.241.000	B	1.281.171,17	0,00	2,725		1.281.171,17	2,725	0	0,000	0	0
Konzern 450287	Frankreich, Republik				9.275.543,91	63.881,66	19,863		9.339.425,57	19,863		0,000		0
IT0005345183	Republik Italien B.T.P. 18/25	EUR	1.786.000	B	2.011.107,44	4.563,59	4,287		2.015.671,03	4,287	0	0,000	0	0
IT0005367492	Republik Italien B.T.P. 19/24	EUR	1.872.000	B	2.003.629,87	15.489,78	4,294		2.019.119,65	4,294	0	0,000	0	0
IT0005386245	Republik Italien B.T.P. 19/25	EUR	2.103.000	B	2.149.402,48	2.860,19	4,577		2.152.262,67	4,577	0	0,000	0	0
IT0005408502	Republik Italien B.T.P. 20/25	EUR	2.006.000	B	2.183.878,04	17.547,05	4,682		2.201.425,09	4,682	0	0,000	0	0

Stichtag: 18.12.2020

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
Konzern 465688 Italien, Republik					8.348.017,83	40.460,61	17,841		8.388.478,44	17,841		0,000		0
NL0010733424	Königreich Niederlande Anl. 14/24	EUR	1.655.000	B	1.818.068,97	14.509,59	3,898		1.832.578,56	3,898	0	0,000	0	0
NL0011220108	Königreich Niederlande Anl. 15/25	EUR	1.644.000	B	1.717.618,98	1.801,64	3,657		1.719.420,62	3,657	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					3.535.687,95	16.311,23	7,554		3.551.999,18	7,554		0,000		0
AT0000A28KX7	Republik Österreich MTN 19/24	EUR	974.000	B	997.695,67	0,00	2,122		997.695,67	2,122	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					997.695,67	0,00	2,122		997.695,67	2,122		0,000		0
PTOTEKOE0011	Republik Portugal Obr. 15/25	EUR	1.532.000	B	1.782.573,92	8.205,64	3,809		1.790.779,56	3,809	0	0,000	0	0
Konzern 450603 Portugal, Republik					1.782.573,92	8.205,64	3,809		1.790.779,56	3,809		0,000		0
SK4000017158	Slowakei Anl. 20/25	EUR	216.000	B	223.895,30	328,44	0,477		224.223,74	0,477	0	0,000	0	0
Konzern 128625 Slowakische Republik					223.895,30	328,44	0,477		224.223,74	0,477		0,000		0
ES0000012G91	Koenigreich Spanien Bonos 20/26	EUR	256.000	B	261.499,24	0,00	0,556		261.499,24	0,556	0	0,000	0	0
ES00000126B2	Königreich Spanien Bonos 14/24	EUR	2.618.000	B	2.953.208,72	10.256,82	6,303		2.963.465,54	6,303	0	0,000	0	0
ES0000012E85	Königreich Spanien Bonos 19/24	EUR	1.755.000	B	1.806.029,61	1.742,98	3,845		1.807.772,59	3,845	0	0,000	0	0
ES0000012F92	Königreich Spanien Bonos 20/25	EUR	2.310.000	B	2.357.447,40	0,00	5,014		2.357.447,40	5,014	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					7.378.184,97	11.999,80	15,718		7.390.184,77	15,718		0,000		0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 46.834.901,57 & + & 183.821,03 & = & 47.018.722,60 \end{array}$$

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.