

Stichtag: 20.02.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 10+ 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
BE0000348574	Königreich Belgien Obl. Lin. 19/50	EUR	274.000	B	360.181,60	3.143,51	2,599		363.325,11	2,599	0	0,000	0	0
BE0000338476	Königreich Belgien Obl. Lin. S.78 16/47	EUR	500.000	B	640.773,70	5.398,91	4,622		646.172,61	4,622	0	0,000	0	0
BE0000340498	Königreich Belgien Obl. Lin. S.80 16/66	EUR	240.000	B	374.514,26	3.482,30	2,704		377.996,56	2,704	0	0,000	0	0
BE0000346552	Königreich Belgien Obl. Lin. S.86 18/33	EUR	311.000	B	362.157,17	3.271,45	2,614		365.428,62	2,614	0	0,000	0	0
Konzern 450063	Belgien, Königreich				1.737.626,73	15.296,17	12,538		1.752.922,90	12,538		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	25.622,73	0,00	0,183		25.622,73	0,183	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	37,38	0,00	0,000		37,38	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-1.354,39	0,00	-0,010		0,00	0,000	0	0,000	0	0
Konzern 239000	DekaBank Deutsche Girozentrale				24.305,72	0,00	0,174		25.660,11	0,184		0,000		0
DE0001102432	Bundesrep.Deutschland Anl. 17/48	EUR	790.000	B	1.064.353,25	5.207,31	7,650		1.069.560,56	7,650	0	0,000	0	0
DE0001102481	Bundesrep.Deutschland Anl. 19/50	EUR	293.000	B	288.090,99	0,00	2,061		288.090,99	2,061	0	0,000	0	0
Konzern 110000	Deutschland, Bundesrepublik				1.352.444,24	5.207,31	9,711		1.357.651,55	9,711		0,000		0
FR0013154044	Rep. Frankreich OAT 16/36	EUR	659.000	B	775.883,54	6.189,38	5,594		782.072,92	5,594	0	0,000	0	0
FR0013313582	Rep. Frankreich OAT 17/34	EUR	510.000	B	597.744,68	4.789,96	4,310		602.534,64	4,310	0	0,000	0	0
FR0013257524	Rep. Frankreich OAT 17/48	EUR	523.000	B	728.969,95	7.859,29	5,270		736.829,24	5,270	0	0,000	0	0
FR0013404969	Rep. Frankreich OAT 18/50	EUR	525.000	B	663.699,75	5.917,01	4,790		669.616,76	4,790	0	0,000	0	0
Konzern 450287	Frankreich, Republik				2.766.297,92	24.755,64	19,964		2.791.053,56	19,964		0,000		0
IE00BV8C9B83	Republik Irland Treasury Bonds 17/37	EUR	258.000	B	319.864,53	3.415,33	2,312		323.279,86	2,312	0	0,000	0	0
IE00BFZRQ242	Republik Irland Treasury Bonds 18/31	EUR	226.000	B	260.827,73	2.859,27	1,886		263.687,00	1,886	0	0,000	0	0
IE00BFZRP202	Republik Irland Treasury Bonds 18/33	EUR	209.000	B	242.674,08	2.115,70	1,751		244.789,78	1,751	0	0,000	0	0
Konzern 464541	Irland, Republik				823.366,34	8.390,30	5,949		831.756,64	5,949		0,000		0
IT0005162828	Republik Italien B.T.P. 16/47	EUR	601.000	B	713.185,36	7.845,99	5,157		721.031,35	5,157	0	0,000	0	0
IT0005240350	Republik Italien B.T.P. 17/33	EUR	552.000	B	636.326,45	6.539,10	4,598		642.865,55	4,598	0	0,000	0	0
IT0005273013	Republik Italien B.T.P. 17/48	EUR	568.000	B	766.168,72	9.474,98	5,548		775.643,70	5,548	0	0,000	0	0

Stichtag: 20.02.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 10+ 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
IT0005321325	Republik Italien B.T.P. 18/38	EUR	519.000	B	635.325,91	7.402,88	4,597		642.728,79	4,597	0	0,000	0	0
	Konzern 465688 Italien, Republik				2.751.006,44	31.262,95	19,901		2.782.269,39	19,901		0,000		0
NL0013552060	Königreich Niederlande Anl. 19/40	EUR	332.000	B	364.683,14	181,42	2,610		364.864,56	2,610	0	0,000	0	0
	Konzern 456326 Niederlande, Königreich der				364.683,14	181,42	2,610		364.864,56	2,610		0,000		0
AT0000A1K9F1	Republik Österreich Bundesanl. 16/47	EUR	307.000	B	401.949,05	50,33	2,875		401.999,38	2,875	0	0,000	0	0
AT0000A1XML2	Republik Österreich MTN 17/17	EUR	266.000	B	513.757,80	2.396,18	3,692		516.153,98	3,692	0	0,000	0	0
	Konzern 462186 Österreich, Republik				915.706,85	2.446,51	6,567		918.153,36	6,567		0,000		0
PTOTEW0E0017	Republik Portugal Obr. 18/34	EUR	277.000	B	344.115,72	5.312,95	2,499		349.428,67	2,499	0	0,000	0	0
	Konzern 450603 Portugal, Republik				344.115,72	5.312,95	2,499		349.428,67	2,499		0,000		0
ES0000012B47	Königreich Spanien Bonos 18/48	EUR	482.000	B	680.440,03	4.124,66	4,897		684.564,69	4,897	0	0,000	0	0
ES0000012E69	Königreich Spanien Bonos 19/35	EUR	417.000	B	495.654,25	4.405,27	3,577		500.059,52	3,577	0	0,000	0	0
ES00000128C6	Königreich Spanien Obligaciones 16/46	EUR	576.000	B	833.145,29	5.294,16	5,997		838.439,45	5,997	0	0,000	0	0
ES00000128Q6	Königreich Spanien Obligaciones 17/33	EUR	622.000	B	776.679,40	8.346,87	5,615		785.026,27	5,615	0	0,000	0	0
	Konzern 458634 Spanien, Königreich				2.785.918,97	22.170,96	20,086		2.808.089,93	20,086		0,000		0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 13.865.472,07 & + & 115.024,21 & = & 13.980.496,28 \end{array}$$

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.