

Stichtag: 20.05.2020

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	737.000	B	934.489,69	11.467,80	2,702		945.957,49	2,702	0	0,000	0	0
BE0000340498	Königreich Belgien Obl. Lin. S.80 16/66	EUR	743.000	B	1.123.047,62	14.621,47	3,249		1.137.669,09	3,249	0	0,000	0	0
BE0000343526	Königreich Belgien Obl. Lin. S.83 17/57	EUR	566.000	B	835.510,24	11.656,35	2,420		847.166,59	2,420	0	0,000	0	0
BE0000346552	Königreich Belgien Obl. Lin. S.86 18/33	EUR	836.000	B	947.511,03	858,90	2,709		948.369,93	2,709	0	0,000	0	0
Konzern 450063 Belgien, Königreich					3.840.558,58	38.604,52	11,079		3.879.163,10	11,079		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	176.729,72	0,00	0,505		176.729,72	0,505	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	69,08	0,00	0,000		69,08	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-3.144,53	0,00	-0,009		0,00	0,000	0	0,000	0	0
DE0001102481	WPL: Bundesrep.Deutschland Anl. 19/50	EUR	855.000	B	0,00	0,00	0,000		868.149,90	2,480	0	0,000	0	0
FR0013257524	WPL: Rep. Frankreich OAT 17/48	EUR	500.000	B	0,00	0,00	0,000		681.446,08	1,946	0	0,000	0	0
IE00BFZRPZ02	WPL: Republik Irland Treasury Bonds 18/33	EUR	235.925	B	0,00	0,00	0,000		264.606,24	0,756	0	0,000	0	0
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					173.654,27	0,00	0,496		1.991.001,02	5,687		0,000		0
DE0001102432	Bundesrep.Deutschland Anl. 17/48	EUR	2.402.000	B	3.308.971,18	23.051,98	9,517		3.332.023,16	9,517	0	0,000	0	0
DE0001102481	Bundesrep.Deutschland Anl. 19/50	EUR	894.000	B	907.749,72	0,00	2,593		907.749,72	2,593	0	0,000	0	0
Konzern 110000 Deutschland, Bundesrepublik					4.216.720,90	23.051,98	12,109		4.239.772,88	12,109		0,000		0
FI4000306758	Republik Finnland Bonds 18/34	EUR	509.000	B	582.578,50	580,47	1,666		583.158,97	1,666	0	0,000	0	0
Konzern 453568 Finnland, Republik					582.578,50	580,47	1,666		583.158,97	1,666		0,000		0
FR0013313582	Rep. Frankreich OAT 17/34	EUR	1.602.000	B	1.823.447,98	19.860,86	5,265		1.843.308,84	5,265	0	0,000	0	0
FR0013234333	Rep. Frankreich OAT 17/39	EUR	1.274.000	B	1.580.157,36	20.223,88	4,571		1.600.381,24	4,571	0	0,000	0	0
FR0013257524	Rep. Frankreich OAT 17/48	EUR	1.331.000	B	1.787.607,67	26.401,80	5,181		1.814.009,47	5,181	0	0,000	0	0
FR0013404969	Rep. Frankreich OAT 18/50	EUR	1.337.000	B	1.634.125,12	19.890,61	4,724		1.654.015,73	4,724	0	0,000	0	0
Konzern 450287 Frankreich, Republik					6.825.338,13	86.377,15	19,741		6.911.715,28	19,741		0,000		0
IE00BV8C9B83	Republik Irland Treasury Bonds 17/37	EUR	639.000	B	757.563,26	208,33	2,164		757.771,59	2,164	0	0,000	0	0
IE00BFZRQ242	Republik Irland Treasury Bonds 18/31	EUR	559.000	B	624.635,88	1.343,90	1,788		625.979,78	1,788	0	0,000	0	0

Stichtag: 20.05.2020

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
IE00BFZRPZ02	Republik Irland Treasury Bonds 18/33	EUR	517.000	B	579.722,44	128,90	1,656		579.851,34	1,656	0	0,000	0	0
Konzern 464541 Irland, Republik					1.961.921,58	1.681,13	5,608		1.963.602,71	5,608		0,000		0
IT0005240350	Republik Italien B.T.P. 17/33	EUR	1.637.000	B	1.732.979,27	8.936,71	4,975		1.741.915,98	4,975	0	0,000	0	0
IT0005273013	Republik Italien B.T.P. 17/48	EUR	1.686.000	B	1.990.408,31	12.961,13	5,722		2.003.369,44	5,722	0	0,000	0	0
IT0005358806	Republik Italien B.T.P. 18/35	EUR	1.399.000	B	1.624.563,43	10.443,08	4,670		1.635.006,51	4,670	0	0,000	0	0
IT0005321325	Republik Italien B.T.P. 18/38	EUR	1.540.000	B	1.697.521,52	10.122,99	4,877		1.707.644,51	4,877	0	0,000	0	0
Konzern 465688 Italien, Republik					7.045.472,53	42.463,91	20,244		7.087.936,44	20,244		0,000		0
NL0013552060	Königreich Niederlande Anl. 19/40	EUR	822.000	B	905.849,34	1.437,38	2,591		907.286,72	2,591	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					905.849,34	1.437,38	2,591		907.286,72	2,591		0,000		0
AT0000A1XML2	Republik Österreich MTN 17/17	EUR	670.000	B	1.287.694,64	9.418,44	3,705		1.297.113,08	3,705	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					1.287.694,64	9.418,44	3,705		1.297.113,08	3,705		0,000		0
PTOTEW0E0017	Republik Portugal Obr. 18/34	EUR	775.000	B	900.468,63	1.624,32	2,576		902.092,95	2,576	0	0,000	0	0
Konzern 450603 Portugal, Republik					900.468,63	1.624,32	2,576		902.092,95	2,576		0,000		0
ES0000012B47	Königreich Spanien Bonos 18/48	EUR	1.393.000	B	1.798.476,53	20.963,51	5,197		1.819.440,04	5,197	0	0,000	0	0
ES0000012E69	Königreich Spanien Bonos 19/35	EUR	1.337.000	B	1.493.058,92	20.071,44	4,322		1.513.130,36	4,322	0	0,000	0	0
ES00000128Q6	Königreich Spanien Obligaciones 17/33	EUR	1.847.000	B	2.179.983,81	35.221,68	6,327		2.215.205,49	6,327	0	0,000	0	0
ES0000012G34	Königreich Spanien Obligaciones 20/30	EUR	1.442.000	B	1.518.137,60	1.086,44	4,339		1.519.224,04	4,339	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					6.989.656,86	77.343,07	20,184		7.066.999,93	20,184		0,000		0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 34.729.913,96 & + & 282.582,37 & = & 35.012.496,33 \end{array}$$

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.