

Stichtag: 18.12.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Diversified 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
DE000AAR0231	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.225 18/23	EUR	2.400.000	B	2.432.625,60	2.663,93	2,570		2.435.289,53	2,570	0	0,000	10	244
DE000AAR0249	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.226 19/24	EUR	2.400.000	B	2.446.715,28	2.663,93	2,585		2.449.379,21	2,585	0	0,000	10	245
Konzern 804110 Aareal Bank AG					4.879.340,88	5.327,86	5,156		4.884.668,74	5,156	0,000			488
DE000CZ40MU7	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P23 18/25	EUR	3.200.000	B	3.354.567,04	11.397,26	3,553		3.365.964,30	3,553	0	0,000	10	337
DE000CZ40MW3	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P25 18/23	EUR	3.200.000	B	3.266.934,72	2.191,78	3,451		3.269.126,50	3,451	0	0,000	10	327
DE000CZ40NN0	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P29 19/24	EUR	3.200.000	B	3.260.711,68	3.803,28	3,446		3.264.514,96	3,446	0	0,000	10	326
DE000CZ45VS1	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P36 20/30	EUR	4.000.000	B	4.105.104,40	314,52	4,333		4.105.418,92	4,333	0	0,000	10	411
Konzern 803200 Commerzbank AG					13.987.317,84	17.706,84	14,782		14.005.024,68	14,782	0,000			1.401
	Bankguthaben	EUR		B	559.803,91	0,00	0,591		559.803,91	0,591	0	0,000	0	0
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	407,02	0,00	0,000		407,02	0,000	0	0,000	0	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-5.027,48	0,00	-0,005		0,00	0,000	0	0,000	0	0
DE000CZ45VS1	WPL: Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P36 20/30	EUR	2.000.000	B	0,00	0,00	0,000		2.052.492,26	2,166	0	0,000	0	0
XS2106576494	WPL: Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H342 20/25	EUR	1.000.000	B	0,00	0,00	0,000		1.020.901,53	1,078	0	0,000	0	0
XS2056484889	WPL: Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H337 19/29	EUR	400.000	B	0,00	0,00	0,000		411.198,65	0,434	0	0,000	0	0
DE000HV2AYA1	WPL: UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2100 20/30	EUR	700.000	B	0,00	0,00	0,000		717.562,36	0,757	0	0,000	0	0
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					555.183,45	0,00	0,586		4.762.365,73	5,027	0,000			0
DE000A2LQNP8	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15286 19/24	EUR	2.400.000	B	2.453.994,72	5.377,05	2,596		2.459.371,77	2,596	0	0,000	10	246
DE000A2YNVY3	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15294 20/28	EUR	2.400.000	B	2.475.141,60	2.203,28	2,615		2.477.344,88	2,615	0	0,000	10	248
Konzern 801900 Deutsche Pfandbriefbank AG					4.929.136,32	7.580,33	5,211		4.936.716,65	5,211	0,000			494
DE000A2G9HE4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1205 18/25	EUR	3.200.000	B	3.351.992,64	1.709,59	3,540		3.353.702,23	3,540	0	0,000	10	335
DE000A2TSDW4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1216 19/27	EUR	3.200.000	B	3.282.096,32	299,02	3,465		3.282.395,34	3,465	0	0,000	10	328
DE000A289PA7	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1227 20/28	EUR	3.200.000	B	3.288.329,28	158,68	3,471		3.288.487,96	3,471	0	0,000	10	329
DE000A289PC3	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1229 20/25	EUR	3.200.000	B	3.273.552,64	86,79	3,455		3.273.639,43	3,455	0	0,000	10	327
Emittent 804140 DZ HYP AG					13.195.970,88	2.254,08	13,931		13.198.224,96	13,931	0,000			1.320

Stichtag: 18.12.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Diversified 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 238000	DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main				13.195.970,88	2.254,08	13,931		13.198.224,96	13,931		0,000		1.320
DE000A1KRJR4	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 18/23	EUR	3.200.000	B	3.269.949,76	1.621,92	3,453		3.271.571,68	3,453	0	0,000	10	327
DE000A1KRJT0	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 19/27	EUR	2.400.000	B	2.482.079,76	1.750,68	2,622		2.483.830,44	2,622	0	0,000	10	248
Emittent 801530	ING-DiBa AG				5.752.029,52	3.372,60	6,075		5.755.402,12	6,075		0,000		576
Konzern 881111	ING Groep N.V.				5.752.029,52	3.372,60	6,075		5.755.402,12	6,075		0,000		576
DE000LB1DSM2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Hyp.-Pfe. 17/25	EUR	3.200.000	B	3.314.774,72	9.803,28	3,509		3.324.578,00	3,509	0	0,000	0	0
DE000LB1DRT9	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.778 17/24	EUR	3.200.000	B	3.269.851,20	6.067,76	3,458		3.275.918,96	3,458	0	0,000	0	0
DE000LB1M2X2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.791 18/25	EUR	3.200.000	B	3.295.630,08	7.584,70	3,487		3.303.214,78	3,487	0	0,000	0	0
DE000LB2CQG8	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.812 20/27	EUR	2.400.000	B	2.464.979,28	104,55	2,602		2.465.083,83	2,602	0	0,000	0	0
Konzern 346012	Landesbank Baden-Württemberg				12.345.235,28	23.560,29	13,055		12.368.795,57	13,055		0,000		0
DE000DHY5025	Deutsche Hypothekenbank MTN Hyp.-Pfe. S.502 19/29	EUR	2.400.000	B	2.606.976,96	14.400,00	2,767		2.621.376,96	2,767	0	0,000	0	0
Emittent 804200	Deutsche Hypothekenbank [A.-G.]				2.606.976,96	14.400,00	2,767		2.621.376,96	2,767		0,000		0
DE000NLB2TD7	Norddtte Ldsbk -GZ- MTN Pfe. 18/28	EUR	3.200.000	B	3.442.036,80	22.229,51	3,657		3.464.266,31	3,657	0	0,000	0	0
DE000NLB8739	Norddtte Ldsbk -GZ- Öff.-Pfe. MTN 17/27	EUR	2.560.000	B	2.714.354,18	14.819,67	2,881		2.729.173,85	2,881	0	0,000	0	0
Emittent 301000	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				6.156.390,98	37.049,18	6,537		6.193.440,16	6,537		0,000		0
Konzern 301000	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				8.763.367,94	51.449,18	9,304		8.814.817,12	9,304		0,000		0
DE000BHY0BS0	Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 19/22	EUR	2.689.000	B	2.713.855,50	84,72	2,865		2.713.940,22	2,865	0	0,000	0	0
Emittent 802900	Berlin Hyp AG				2.713.855,50	84,72	2,865		2.713.940,22	2,865		0,000		0
Konzern	Regionalverbandsgesellschaft der S-Finanzgruppe mbH				2.713.855,50	84,72	2,865		2.713.940,22	2,865		0,000		0
XS1883355601	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H321 18/25	EUR	3.200.000	B	3.348.272,96	3.857,53	3,538		3.352.130,49	3,538	0	0,000	0	0
XS2106576494	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H342 20/25	EUR	4.000.000	B	4.081.715,60	366,12	4,309		4.082.081,72	4,309	0	0,000	0	0
XS1936190021	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H324 19/22	EUR	4.800.000	B	4.840.152,00	0,00	5,109		4.840.152,00	5,109	0	0,000	0	0
XS2056484889	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H337 19/29	EUR	1.800.000	B	1.850.047,92	42,90	1,953		1.850.090,82	1,953	0	0,000	0	0
Emittent 268008	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale				14.120.188,48	4.266,55	14,909		14.124.455,03	14,909		0,000		0
Konzern 150774	Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen KdöR				14.120.188,48	4.266,55	14,909		14.124.455,03	14,909		0,000		0
DE000HV2ARM0	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2023 19/29	EUR	3.200.000	B	3.509.446,72	26.469,95	3,732		3.535.916,67	3,732	0	0,000	10	354
DE000HV2ASU1	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2064 19/27	EUR	3.200.000	B	3.282.787,84	28,93	3,465		3.282.816,77	3,465	0	0,000	10	328
DE000HV2ATM6	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2091 20/28	EUR	3.200.000	B	3.285.015,68	85,92	3,467		3.285.101,60	3,467	0	0,000	10	329
DE000HV2AYA1	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2100 20/30	EUR	3.200.000	B	3.279.727,68	158,68	3,462		3.279.886,36	3,462	0	0,000	10	328
Emittent 802200	UniCredit Bank AG				13.356.977,92	26.743,48	14,127		13.383.721,40	14,127		0,000		1.338
Konzern 850832	UniCredit S.p.A.				13.356.977,92	26.743,48	14,127		13.383.721,40	14,127		0,000		1.338

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 94.598.604,01 & + & 142.345,93 & = & 94.740.949,94 \end{array}$$

Forderungen ggü. Mitgliedern des Haftungsverbundes werden mit 0%, Deka-Zielfonds mit dem haftungsverbundprivilegierten Risikogewicht berücksichtigt.

Disclaimer:

Stichtag: 18.12.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

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.