

Stichtag: 22.09.2022

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	Bemessungs- grundl.	% Bem.- grundl.	anzur. Betrag % % FV*	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000	
DE000AAR0314	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.240 22/30	EUR	2.900.000	B	2.375.147,85	2.562,33	2,317	2.377.710,18	2,317	0 0,000	10	238	
DE000AAR0330	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.243 22/29	EUR	2.900.000	B	2.650.180,66	15.840,75	2,598	2.666.021,41	2,598	0 0,000	10	267	
Konzern 804110 Aareal Bank AG					5.025.328,51	18.403,08	4,915	5.043.731,59	4,915	0,000		504	
DE000CZ45VS1	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P36 20/30	EUR	4.888.000	B	3.967.978,20	266,50	3,867	3.968.244,70	3,867	0 0,000	10	397	
DE000CZ45WY7	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P47 22/32	EUR	3.911.000	B	3.090.298,55	6.884,43	3,018	3.097.182,98	3,018	0 0,000	10	310	
DE000CZ45W16	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P49 22/27	EUR	5.866.000	B	5.297.340,57	15.669,45	5,178	5.313.010,02	5,178	0 0,000	10	531	
Konzern 803200 Commerzbank AG					12.355.617,32	22.820,38	12,063	12.378.437,70	12,063	0,000		1.238	
	Bankguthaben	EUR		B	885.671,95	0,00	0,863	885.671,95	0,863	0 0,000	0	0	
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	362,16	0,00	0,000	362,16	0,000	0 0,000	0	0	
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-6.711,15	0,00	-0,007	0,00	0,000	0 0,000	0	0	
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					879.322,96	0,00	0,857	886.034,11	0,863	0,000		0	
DE000A2YNVY3	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15294 20/28	EUR	2.900.000	B	2.509.657,39	1.970,41	2,448	2.511.627,80	2,448	0 0,000	10	251	
DE000A3E5K73	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15304 21/26	EUR	2.900.000	B	2.600.402,45	25,42	2,534	2.600.427,87	2,534	0 0,000	10	260	
DE000A3T0YH5	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15317 22/26	EUR	2.900.000	B	2.723.460,18	13.189,04	2,667	2.736.649,22	2,667	0 0,000	10	274	
DE000A30WFU3	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15322 22/27	EUR	2.933.000	B	2.802.507,31	8.718,64	2,740	2.811.225,95	2,740	0 0,000	10	281	
Konzern 801900 Deutsche Pfandbriefbank AG					10.636.027,33	23.903,51	10,388	10.659.930,84	10,388	0,000		1.066	
DE000A3H2TK9	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1234 21/30	EUR	3.911.000	B	3.178.787,66	193,94	3,098	3.178.981,60	3,098	0 0,000	10	318	
DE000A3H2TQ6	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1235 21/29	EUR	3.911.000	B	3.261.191,26	170,37	3,178	3.261.361,63	3,178	0 0,000	10	326	
DE000A3E5UY4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1239 21/26	EUR	3.911.000	B	3.493.661,10	358,95	3,405	3.494.020,05	3,405	0 0,000	10	349	
DE000A3MP619	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1242 22/29	EUR	3.911.000	B	3.394.109,72	17.358,41	3,325	3.411.468,13	3,325	0 0,000	10	341	
Emittent 804140 DZ HYP AG					13.327.749,74	18.081,67	13,006	13.345.831,41	13,006	0,000		1.335	
Konzern 238000 DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main					13.327.749,74	18.081,67	13,006	13.345.831,41	13,006	0,000		1.335	

Stichtag: 22.09.2022

Grosskreditanzeige

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattung	Whg.	Nominale	Ausf.- risikop.	Tageswert	Stückzins/ Dividende	% FV	Bemessungs- grundl.	% Bem.- grundl.	anzur. Betrag % FV*	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000
DE000A1KRJV6	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe.21/28	EUR	4.900.000	B	4.145.765,05	475,23	4,041	4.146.240,28	4,041	0 0,000	10	415
DE000A2YNWA1	ING-DiBa AG MTN Hyp.-Pfe.22/29	EUR	5.900.000	B	5.153.007,49	21.518,84	5,043	5.174.526,33	5,043	0 0,000	10	517
	Emittent 801530 ING-DiBa AG				9.298.772,54	21.994,07	9,083	9.320.766,61	9,083	0,000		932
	Konzern 881111 ING Groep N.V.				9.298.772,54	21.994,07	9,083	9.320.766,61	9,083	0,000		932
DE000BHY0HZ2	Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 21/26	EUR	2.933.000	B	2.632.971,11	26,52	2,566	2.632.997,63	2,566	0 0,000	0	0
DE000BHY0H34	Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 21/30	EUR	3.911.000	B	3.224.546,36	3.361,85	3,146	3.227.908,21	3,146	0 0,000	0	0
DE000BHY0SB0	Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 22/32	EUR	2.933.000	B	2.677.710,51	19.546,64	2,628	2.697.257,15	2,628	0 0,000	0	0
	Emittent 802900 Berlin Hyp AG				8.535.227,98	22.935,01	8,340	8.558.162,99	8,340	0,000		0
DE000LB2ZSM3	Ldsbk Baden-Wuerttemb. MTN Pfe. S.827 22/29	EUR	2.900.000	B	2.426.032,12	635,62	2,365	2.426.667,74	2,365	0 0,000	0	0
DE000LB2ZV93	Ldsbk Baden-Wuerttemb. MTN Pfe. S.829 22/28	EUR	3.911.000	B	3.715.301,77	11.250,82	3,632	3.726.552,59	3,632	0 0,000	0	0
	Emittent 346012 Landesbank Baden-Württemberg				6.141.333,89	11.886,44	5,996	6.153.220,33	5,996	0,000		0
	Konzern 346012 Landesbank Baden-Württemberg				14.676.561,87	34.821,45	14,336	14.711.383,32	14,336	0,000		0
DE000MHB29J3	Muenchener Hypothekenba. MTN Hyp.-Pfe.S.1980 22/29	EUR	2.933.000	B	2.478.973,95	2.430,77	2,418	2.481.404,72	2,418	0 0,000	10	248
DE000MHB30J1	Muenchener Hypothekenba. MTN Hyp.-Pfe.S.1989 22/30	EUR	3.911.000	B	3.510.743,18	22.099,83	3,443	3.532.843,01	3,443	0 0,000	10	353
	Konzern 215000 Münchener Hypothekbank eG				5.989.717,13	24.530,60	5,861	6.014.247,73	5,861	0,000		601
XS2433126807	Lb.Hessen-Thueringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H346 22/27	EUR	4.900.000	B	4.291.716,94	92,63	4,182	4.291.809,57	4,182	0 0,000	0	0
XS1883355601	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H321 18/25	EUR	3.900.000	B	3.645.678,27	19.553,42	3,572	3.665.231,69	3,572	0 0,000	0	0
XS2106576494	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H342 20/25	EUR	4.900.000	B	4.598.627,46	331,59	4,482	4.598.959,05	4,482	0 0,000	0	0
XS2056484889	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H337 19/29	EUR	3.700.000	B	3.049.729,07	370,00	2,972	3.050.099,07	2,972	0 0,000	0	0
	Emittent 268008 Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale				15.585.751,74	20.347,64	15,208	15.606.099,38	15,208	0,000		0
	Konzern 150774 Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen KdöR				15.585.751,74	20.347,64	15,208	15.606.099,38	15,208	0,000		0
DE000HV2AS10	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2071 20/32	EUR	5.866.000	B	4.639.867,56	10.205,23	4,532	4.650.072,79	4,532	0 0,000	10	465
DE000HV2ATM6	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2091 20/28	EUR	3.911.000	B	3.311.114,78	11,79	3,227	3.311.126,57	3,227	0 0,000	10	331
DE000HV2AYA1	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2100 20/30	EUR	3.911.000	B	3.155.304,06	100,72	3,075	3.155.404,78	3,075	0 0,000	10	316
DE000HV2AYU9	UniCredit Bank AG HVB MTN Oeff.-Pfe. S.2118 22/27	EUR	3.900.000	B	3.528.099,51	11.486,30	3,449	3.539.585,81	3,449	0 0,000	10	354
	Emittent 802200 UniCredit Bank AG				14.634.385,91	21.804,04	14,283	14.656.189,95	14,283	0,000		1.466
	Konzern 850832 UniCredit S.p.A.				14.634.385,91	21.804,04	14,283	14.656.189,95	14,283	0,000		1.466

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

Tageswert + Forderung = Fondsvermögen

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

102.409.235,05 + 206.706,44 = 102.615.941,49

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

Stichtag: 22.09.2022

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige

Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF



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.