

Stichtag: 22.05.2023

Fondswährung: EUR  
Berichtswährung: EUR

# Grosskreditanzeige



## Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 1-3 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.-<br>risiko<br>pos. | Tageswert            | Stückzins/<br>Dividende | % FV          | anzuzeug.<br>Betrag % FV* | anzurech.<br>Betrag % FV* | anzuzeug.<br>Betrag % FV* | Risiko-<br>gew. % | KSA-Wert<br>in 1000 |
|                                                      |                                              |      |           |                          |                      |                         |               | \$13 KWG                  | \$13 KWG                  | \$14KWG                   |                   |                     |
| BE0000334434                                         | Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25      | EUR  | 3.765.000 | B                        | 3.608.714,85         | 27.726,90               | 5,261         | 5,26051                   | 0,00000                   | 5,26051                   | 0                 | 0                   |
| BE0000337460                                         | Königreich Belgien Obl. Lin. S.77 16/26      | EUR  | 2.793.000 | B                        | 2.645.417,88         | 25.710,90               | 3,864         | 3,86408                   | 0,00000                   | 3,86408                   | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 450063 Belgien, Königreich</b>            |                                              |      |           |                          | <b>6.254.132,73</b>  | <b>53.437,80</b>        | <b>9,125</b>  | <b>9,12459</b>            | <b>0,00000</b>            | <b>9,12459</b>            |                   | <b>0</b>            |
|                                                      | Bankguthaben                                 | EUR  |           | B                        | 823.683,33           | 0,00                    | 1,192         | 1,19155                   | 1,19155                   | 1,19155                   | 20                | 165                 |
|                                                      | sonstige Verbindlichkeiten                   | EUR  |           | B                        | -7.253,80            | 0,00                    | -0,010        | 0,00000                   | 0,00000                   | 0,00000                   | 20                | 0                   |
| <b>Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale</b> |                                              |      |           |                          | <b>816.429,53</b>    | <b>0,00</b>             | <b>1,181</b>  | <b>1,19155</b>            | <b>1,19155</b>            | <b>1,19155</b>            |                   | <b>165</b>          |
| DE0001141810                                         | Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.181 20/25 | EUR  | 3.315.000 | B                        | 3.147.393,60         | 0,00                    | 4,553         | 4,55305                   | 0,00000                   | 4,55305                   | 0                 | 0                   |
| DE0001141828                                         | Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.182 20/25 | EUR  | 3.820.000 | B                        | 3.587.285,60         | 0,00                    | 5,189         | 5,18940                   | 0,00000                   | 5,18940                   | 0                 | 0                   |
| DE0001141836                                         | Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.183 21/26 | EUR  | 4.036.000 | B                        | 3.750.614,44         | 0,00                    | 5,426         | 5,42567                   | 0,00000                   | 5,42567                   | 0                 | 0                   |
| DE0001141844                                         | Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.184 21/26 | EUR  | 3.459.000 | B                        | 3.180.930,99         | 0,00                    | 4,602         | 4,60156                   | 0,00000                   | 4,60156                   | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 110000 Deutschland, Bundesrepublik</b>    |                                              |      |           |                          | <b>13.666.224,63</b> | <b>0,00</b>             | <b>19,770</b> | <b>19,76969</b>           | <b>0,00000</b>            | <b>19,76969</b>           |                   | <b>0</b>            |
| FI4000511449                                         | Republik Finnland Bonds 21/26                | EUR  | 666.000   | B                        | 607.954,77           | 0,00                    | 0,879         | 0,87947                   | 0,00000                   | 0,87947                   | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 453568 Finnland, Republik</b>             |                                              |      |           |                          | <b>607.954,77</b>    | <b>0,00</b>             | <b>0,879</b>  | <b>0,87947</b>            | <b>0,00000</b>            | <b>0,87947</b>            |                   | <b>0</b>            |
| FR0013131877                                         | Rep. Frankreich OAT 16/26                    | EUR  | 5.210.000 | B                        | 4.866.817,30         | 25.978,63               | 7,078         | 7,07796                   | 0,00000                   | 7,07796                   | 0                 | 0                   |
| FR0013508470                                         | Rep. Frankreich OAT 20/26                    | EUR  | 4.647.000 | B                        | 4.301.774,37         | 0,00                    | 6,223         | 6,22299                   | 0,00000                   | 6,22299                   | 0                 | 0                   |
| FR0014007TY9                                         | Rep. Frankreich OAT 21/25                    | EUR  | 3.258.000 | B                        | 3.094.122,60         | 0,00                    | 4,476         | 4,47599                   | 0,00000                   | 4,47599                   | 0                 | 0                   |
| FR001400FYQ4                                         | Rep. Frankreich OAT 22/26                    | EUR  | 1.362.000 | B                        | 1.346.745,60         | 22.575,62               | 1,981         | 1,98087                   | 0,00000                   | 1,98087                   | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 450287 Frankreich, Republik</b>           |                                              |      |           |                          | <b>13.609.459,87</b> | <b>48.554,25</b>        | <b>19,758</b> | <b>19,75781</b>           | <b>0,00000</b>            | <b>19,75781</b>           |                   | <b>0</b>            |
| IT0005386245                                         | Republik Italien B.T.P. 19/25                | EUR  | 3.203.000 | B                        | 3.039.062,45         | 3.468,44                | 4,401         | 4,40135                   | 0,00000                   | 4,40135                   | 0                 | 0                   |
| IT0005419848                                         | Republik Italien B.T.P. 20/26                | EUR  | 3.259.000 | B                        | 3.007.241,27         | 5.041,67                | 4,358         | 4,35760                   | 0,00000                   | 4,35760                   | 0                 | 0                   |
| IT0005437147                                         | Republik Italien B.T.P. 21/26                | EUR  | 3.467.000 | B                        | 3.134.614,20         | 0,00                    | 4,535         | 4,53456                   | 0,00000                   | 4,53456                   | 0                 | 0                   |

Stichtag: 22.05.2023

Fondswährung: EUR  
Berichtswährung: EUR

# Grosskreditanzeige



## Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 1-3 UCITS ETF

| ISIN                                              | Gattung                            | Whg. | Nominale  | Ausf.-<br>risiko<br>pos. | Tageswert            | Stückzins/<br>Dividende | % FV          | anzuzeitg.<br>Betrag % FV*<br>§13 KWG | anzurech.<br>Betrag % FV*<br>§13 KWG | anzuzeitg.<br>Betrag % FV*<br>§14KWG | Risiko-<br>gew. % | KSA-Wert<br>in 1000 |
|---------------------------------------------------|------------------------------------|------|-----------|--------------------------|----------------------|-------------------------|---------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------|---------------------|
| IT0005454241                                      | Republik Italien B.T.P. 21/26      | EUR  | 3.094.000 | B                        | 2.764.465,80         | 0,00                    | 3,999         | 3,99910                               | 0,00000                              | 3,99910                              | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 465688 Italien, Republik</b>           |                                    |      |           |                          | <b>11.945.383,72</b> | <b>8.510,11</b>         | <b>17,293</b> | <b>17,29261</b>                       | <b>0,00000</b>                       | <b>17,29261</b>                      |                   | <b>0</b>            |
| NL0015000QL2                                      | Koenigreich Niederlande Anl. 22/26 | EUR  | 2.053.000 | B                        | 1.909.926,43         | 0,00                    | 2,763         | 2,76292                               | 0,00000                              | 2,76292                              | 0                 | 0                   |
| NL0011220108                                      | Königreich Niederlande Anl. 15/25  | EUR  | 3.322.000 | B                        | 3.149.222,78         | 7.121,82                | 4,566         | 4,56600                               | 0,00000                              | 4,56600                              | 0                 | 0                   |
| NL0011819040                                      | Königreich Niederlande Anl. 16/26  | EUR  | 3.161.000 | B                        | 2.953.922,89         | 13.553,33               | 4,293         | 4,29278                               | 0,00000                              | 4,29278                              | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 456326 Niederlande, Königreich der</b> |                                    |      |           |                          | <b>8.013.072,10</b>  | <b>20.675,15</b>        | <b>11,622</b> | <b>11,62169</b>                       | <b>0,00000</b>                       | <b>11,62169</b>                      |                   | <b>0</b>            |
| AT0000A2QRW0                                      | Republik Oesterreich MTN 21/25     | EUR  | 1.509.000 | B                        | 1.427.034,89         | 0,00                    | 2,064         | 2,06436                               | 0,00000                              | 2,06436                              | 0                 | 0                   |
| AT0000A308C5                                      | Republik Oesterreich MTN 22/26     | EUR  | 814.000   | B                        | 793.664,81           | 10.615,45               | 1,163         | 1,16348                               | 0,00000                              | 1,16348                              | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 462186 Österreich, Republik</b>        |                                    |      |           |                          | <b>2.220.699,70</b>  | <b>10.615,45</b>        | <b>3,228</b>  | <b>3,22784</b>                        | <b>0,00000</b>                       | <b>3,22784</b>                       |                   | <b>0</b>            |
| SK4000017158                                      | Slowakei Anl. 20/25                | EUR  | 500.000   | B                        | 470.465,00           | 34,15                   | 0,681         | 0,68063                               | 0,00000                              | 0,68063                              | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 128625 Slowakische Republik</b>        |                                    |      |           |                          | <b>470.465,00</b>    | <b>34,15</b>            | <b>0,681</b>  | <b>0,68063</b>                        | <b>0,00000</b>                       | <b>0,68063</b>                       |                   | <b>0</b>            |
| ES0000012G91                                      | Koenigreich Spanien Bonos 20/26    | EUR  | 3.551.000 | B                        | 3.273.802,90         | 0,00                    | 4,736         | 4,73591                               | 0,00000                              | 4,73591                              | 0                 | 0                   |
| ES0000012K38                                      | Koenigreich Spanien Bonos 22/25    | EUR  | 3.091.000 | B                        | 2.904.736,34         | 0,00                    | 4,202         | 4,20202                               | 0,00000                              | 4,20202                              | 0                 | 0                   |
| ES0000012L29                                      | Koenigreich Spanien Bonos 23/26    | EUR  | 1.813.000 | B                        | 1.796.211,62         | 17.663,09               | 2,624         | 2,62397                               | 0,00000                              | 2,62397                              | 0                 | 0                   |
| ES0000012F92                                      | Königreich Spanien Bonos 20/25     | EUR  | 3.565.000 | B                        | 3.389.102,90         | 0,00                    | 4,903         | 4,90271                               | 0,00000                              | 4,90271                              | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 458634 Spanien, Königreich</b>         |                                    |      |           |                          | <b>11.363.853,76</b> | <b>17.663,09</b>        | <b>16,465</b> | <b>16,46461</b>                       | <b>0,00000</b>                       | <b>16,46461</b>                      |                   | <b>0</b>            |

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

\* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

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.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 68.967.675,81 & + & 159.490,00 & = & 69.127.165,81 \end{array}$$