

Stichtag: 20.11.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 3-5 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
BE0000332412	Königreich Belgien Obl. Lin. S.72 14/24	EUR	1.622.000	B	1.816.494,02	17.908,66	3,902		1.834.402,68	3,902	0	0,000	0	0
BE0000334434	Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25	EUR	1.904.000	B	2.034.551,57	6.468,38	4,341		2.041.019,95	4,341	0	0,000	0	0
BE0000342510	Königreich Belgien Obl. Lin. S.82 17/24	EUR	1.391.000	B	1.457.023,95	628,81	3,100		1.457.652,76	3,100	0	0,000	0	0
Konzern 450063 Belgien, Königreich					5.308.069,54	25.005,85	11,343		5.333.075,39	11,343		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	252.030,78	0,00	0,536		252.030,78	0,536	100	0,536	20	50
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	140,02	0,00	0,000		140,02	0,000	100	0,000	20	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-4.447,48	0,00	-0,009		0,00	0,000	100	0,000	20	0
DE0001141802	WPL: Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24	EUR	1.761.000	B	0,00	0,00	0,000		1.814.076,54	3,858	100	3,858	20	363
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					247.723,32	0,00	0,527		2.066.247,34	4,395		4,395		413
DE0001102390	Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26	EUR	2.987.000	B	3.189.999,21	11.548,10	6,809		3.201.547,31	6,809	0	0,000	0	0
DE0001141802	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.180 19/24	EUR	2.203.000	B	2.270.610,07	0,00	4,829		2.270.610,07	4,829	0	0,000	0	0
DE0001141810	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.181 20/25	EUR	1.958.000	B	2.025.081,08	0,00	4,307		2.025.081,08	4,307	0	0,000	0	0
DE0001141828	Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.182 20/25	EUR	1.763.000	B	1.830.093,26	0,00	3,892		1.830.093,26	3,892	0	0,000	0	0
Konzern 110000 Deutschland, Bundesrepublik					9.315.783,62	11.548,10	19,838		9.327.331,72	19,838		0,000		0
FI4000391529	Republik Finnland Bonds 19/24	EUR	434.000	B	445.903,32	0,00	0,948		445.903,32	0,948	0	0,000	0	0
Konzern 453568 Finnland, Republik					445.903,32	0,00	0,948		445.903,32	0,948		0,000		0
FR0010916924	Rep. Frankreich OAT 10/26	EUR	2.482.000	B	3.050.839,40	50.694,00	6,597		3.101.533,40	6,597	0	0,000	0	0
FR0012517027	Rep. Frankreich OAT 15/25	EUR	2.257.000	B	2.378.178,33	5.657,96	5,070		2.383.836,29	5,070	0	0,000	0	0
FR0013415627	Rep. Frankreich OAT 19/25	EUR	2.505.000	B	2.578.822,35	0,00	5,485		2.578.822,35	5,485	0	0,000	0	0
FR0013508470	Rep. Frankreich OAT 20/26	EUR	1.241.000	B	1.282.337,59	0,00	2,727		1.282.337,59	2,727	0	0,000	0	0
Konzern 450287 Frankreich, Republik					9.290.177,67	56.351,96	19,879		9.346.529,63	19,879		0,000		0
IT0005345183	Republik Italien B.T.P. 18/25	EUR	1.786.000	B	2.008.267,70	1.110,00	4,274		2.009.377,70	4,274	0	0,000	0	0
IT0005367492	Republik Italien B.T.P. 19/24	EUR	1.872.000	B	2.002.459,68	12.997,17	4,287		2.015.456,85	4,287	0	0,000	0	0
IT0005386245	Republik Italien B.T.P. 19/25	EUR	2.103.000	B	2.143.915,55	2.300,16	4,565		2.146.215,71	4,565	0	0,000	0	0

Stichtag: 20.11.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 3-5 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
IT0005408502	Republik Italien B.T.P. 20/25	EUR	2.006.000	B	2.180.260,02	14.723,39	4,669		2.194.983,41	4,669	0	0,000	0	0
	Konzern 465688 Italien, Republik				8.334.902,95	31.130,72	17,794		8.366.033,67	17,794		0,000		0
NL0010733424	Königreich Niederlande Anl. 14/24	EUR	1.655.000	B	1.822.349,79	11.970,41	3,901		1.834.320,20	3,901	0	0,000	0	0
NL0011220108	Königreich Niederlande Anl. 15/25	EUR	1.644.000	B	1.719.237,66	1.486,36	3,660		1.720.724,02	3,660	0	0,000	0	0
	Konzern 456326 Niederlande, Königreich der				3.541.587,45	13.456,77	7,561		3.555.044,22	7,561		0,000		0
AT0000A28KX7	Republik Österreich MTN 19/24	EUR	974.000	B	999.405,23	0,00	2,126		999.405,23	2,126	0	0,000	0	0
	Konzern 462186 Österreich, Republik				999.405,23	0,00	2,126		999.405,23	2,126		0,000		0
PTOTEKOE0011	Republik Portugal Obr. 15/25	EUR	1.532.000	B	1.782.711,80	4.826,85	3,802		1.787.538,65	3,802	0	0,000	0	0
	Konzern 450603 Portugal, Republik				1.782.711,80	4.826,85	3,802		1.787.538,65	3,802		0,000		0
SK4000017158	Slowakei Anl. 20/25	EUR	216.000	B	223.832,48	287,01	0,477		224.119,49	0,477	0	0,000	0	0
	Konzern 128625 Slowakische Republik				223.832,48	287,01	0,477		224.119,49	0,477		0,000		0
ES0000012G91	Koenigreich Spanien Bonos 20/26	EUR	256.000	B	261.128,50	0,00	0,555		261.128,50	0,555	0	0,000	0	0
ES00000126B2	Königreich Spanien Bonos 14/24	EUR	2.618.000	B	2.956.219,42	4.733,92	6,298		2.960.953,34	6,298	0	0,000	0	0
ES0000012E85	Königreich Spanien Bonos 19/24	EUR	1.755.000	B	1.805.407,99	1.406,40	3,843		1.806.814,39	3,843	0	0,000	0	0
ES0000012F92	Königreich Spanien Bonos 20/25	EUR	2.310.000	B	2.354.927,19	0,00	5,009		2.354.927,19	5,009	0	0,000	0	0
	Konzern 458634 Spanien, Königreich				7.377.683,10	6.140,32	15,705		7.383.823,42	15,705		0,000		0

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 46.867.780,48 & + & 148.747,58 & = & 47.016.528,06 \end{array}$$

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.