

Stichtag: 20.11.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 5-7 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
BE0000351602	Königreich Belgien Bons d'Etat 20/27	EUR	4.653.000	B	4.832.978,04	0,00	2,139		4.832.978,04	2,139	0	0,000	0	0
BE0000341504	Königreich Belgien Obl. Lin. S.81 17/27	EUR	7.985.000	B	8.721.181,07	27.127,12	3,872		8.748.308,19	3,872	0	0,000	0	0
Konzern 450063 Belgien, Königreich					13.554.159,11	27.127,12	6,011		13.581.286,23	6,011		0,000		0
	Bankguthaben	EUR		B	2.398.258,60	0,00	1,061		2.398.258,60	1,061	100	1,061	20	480
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	545,24	0,00	0,000		545,24	0,000	100	0,000	20	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-23.705,04	0,00	-0,010		0,00	0,000	100	0,000	20	0
DE0001102416	WPL: Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	11.735.000	B	0,00	0,00	0,000		12.507.081,56	5,536	100	5,536	20	2.501
DE0001102440	WPL: Bundesrep.Deutschland Anl. 18/28	EUR	3.425.869	B	0,00	0,00	0,000		3.744.872,63	1,657	100	1,657	20	749
FR0013250560	WPL: Rep. Frankreich OAT 16/27	EUR	1.388.641	B	0,00	0,00	0,000		1.540.035,78	0,682	100	0,682	20	308
SI0002103685	WPL: Republik Slowenien Bonds 17/27	EUR	1.745.000	B	0,00	0,00	0,000		1.938.044,12	0,858	100	0,858	20	388
AT0000A1VGK0	WPL: Republik Österreich Bundesanl. 17/27	EUR	800.000	B	0,00	0,00	0,000		860.161,92	0,381	100	0,381	20	172
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					2.375.098,80	0,00	1,051		22.988.999,85	10,175		10,175		4.598
DE0001102416	Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	11.735.000	B	12.484.397,10	22.684,46	5,536		12.507.081,56	5,536	0	0,000	0	0
DE0001102424	Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	11.350.000	B	12.320.708,75	15.703,42	5,460		12.336.412,17	5,460	0	0,000	0	0
DE0001102440	Bundesrep.Deutschland Anl. 18/28	EUR	9.811.000	B	10.697.840,82	37.930,51	4,752		10.735.771,33	4,752	0	0,000	0	0
DE0001102523	Bundesrep.Deutschland Anl. 20/27	EUR	8.465.000	B	8.892.656,03	0,00	3,936		8.892.656,03	3,936	0	0,000	0	0
Konzern 110000 Deutschland, Bundesrepublik					44.395.602,74	76.318,39	19,683		44.471.921,09	19,683		0,000		0
FI4000278551	Republik Finnland Bonds 17/27	EUR	3.909.000	B	4.206.396,72	3.748,36	1,863		4.210.145,08	1,863	0	0,000	0	0
Konzern 453568 Finnland, Republik					4.206.396,72	3.748,36	1,863		4.210.145,08	1,863		0,000		0
FR0013250560	Rep. Frankreich OAT 16/27	EUR	21.112.000	B	23.325.223,74	105.849,21	10,370		23.431.072,95	10,370	0	0,000	0	0
Konzern 450287 Frankreich, Republik					23.325.223,74	105.849,21	10,370		23.431.072,95	10,370		0,000		0
IE00BKFCV568	Republik Irland Treasury Bonds 20/27	EUR	4.216.000	B	4.401.844,23	5.128,50	1,951		4.406.972,73	1,951	0	0,000	0	0
Konzern 464541 Irland, Republik					4.401.844,23	5.128,50	1,951		4.406.972,73	1,951		0,000		0
IT0005240830	Republik Italien B.T.P. 17/27	EUR	8.932.000	B	10.071.723,20	94.493,41	4,500		10.166.216,61	4,500	0	0,000	0	0

Stichtag: 20.11.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 5-7 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
IT0005274805	Republik Italien B.T.P. 17/27	EUR	9.896.000	B	11.081.639,76	63.396,74	4,933		11.145.036,50	4,933	0	0,000	0	0
IT0005323032	Republik Italien B.T.P. 18/28	EUR	11.897.000	B	13.324.521,03	74.356,25	5,930		13.398.877,28	5,930	0	0,000	0	0
IT0005390874	Republik Italien B.T.P. 19/27	EUR	9.868.000	B	10.268.147,40	30.086,67	4,558		10.298.234,07	4,558	0	0,000	0	0
Konzern 465688 Italien, Republik					44.746.031,39	262.333,07	19,920		45.008.364,46	19,920		0,000	0	0
NL0012171458	Königreich Niederlande Anl. 17/27	EUR	8.947.000	B	9.793.744,08	24.267,21	4,345		9.818.011,29	4,345	0	0,000	0	0
NL0015031501	Königreich Niederlande Anl. 20/27	EUR	6.657.000	B	6.926.149,17	0,00	3,065		6.926.149,17	3,065	0	0,000	0	0
Konzern 456326 Niederlande, Königreich der					16.719.893,25	24.267,21	7,411		16.744.160,46	7,411		0,000	0	0
AT0000A1VGK0	Republik Österreich Bundesanl. 17/27	EUR	5.764.000	B	6.186.950,79	17.213,04	2,746		6.204.163,83	2,746	0	0,000	0	0
AT0000A1ZGE4	Republik Österreich MTN 18/28	EUR	5.887.000	B	6.462.863,40	33.536,60	2,875		6.496.400,00	2,875	0	0,000	0	0
Konzern 462186 Österreich, Republik					12.649.814,19	50.749,64	5,621		12.700.563,83	5,621		0,000	0	0
PTOTEUOE0019	Republik Portugal Obr. 17/27	EUR	5.565.000	B	7.158.871,09	140.878,36	3,231		7.299.749,45	3,231	0	0,000	0	0
PTOTEMOE0035	Republik Portugal Obr. 20/27	EUR	3.221.000	B	3.428.267,81	2.470,90	1,518		3.430.738,71	1,518	0	0,000	0	0
Konzern 450603 Portugal, Republik					10.587.138,90	143.349,26	4,749		10.730.488,16	4,749		0,000	0	0
SI0002103685	Republik Slowenien Bonds 17/27	EUR	1.745.000	B	1.923.283,33	14.760,79	0,858		1.938.044,12	0,858	0	0,000	0	0
SI0002103776	Republik Slowenien Bonds 18/28	EUR	1.367.000	B	1.496.918,04	9.849,89	0,667		1.506.767,93	0,667	0	0,000	0	0
Konzern 132915 Slowenien, Republik					3.420.201,37	24.610,68	1,525		3.444.812,05	1,525		0,000	0	0
ES0000012B39	Königreich Spanien Bonos 18/28	EUR	10.796.000	B	12.060.427,52	86.131,38	5,376		12.146.558,90	5,376	0	0,000	0	0
ES00000128P8	Königreich Spanien Obligaciones 17/27	EUR	9.912.000	B	11.066.847,12	84.727,23	4,936		11.151.574,35	4,936	0	0,000	0	0
ES0000012A89	Königreich Spanien Obligaciones 17/27	EUR	10.936.000	B	12.206.325,76	10.426,65	5,407		12.216.752,41	5,407	0	0,000	0	0
ES0000012G26	Königreich Spanien Obligaciones 20/27	EUR	8.692.000	B	9.298.042,75	22.289,62	4,125		9.320.332,37	4,125	0	0,000	0	0
Konzern 458634 Spanien, Königreich					44.631.643,15	203.574,88	19,844		44.835.218,03	19,844		0,000	0	0

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.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 225.013.047,55 & + & 927.056,32 & = & 225.940.103,87 \end{array}$$