

Stichtag: 22.05.2023

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.-<br>risiko<br>pos. | Tageswert            | Stückzins/<br>Dividende | % FV          | anzuzeitg.<br>Betrag % FV* | anzurech.<br>Betrag % FV* | anzuzeitg.<br>Betrag % FV* | Risiko-<br>gew. % | KSA-Wert<br>in 1000 |
| BE0000349580          | Königreich Belgien Bons d'Etat 20/30  | EUR  | 2.796.000 | B                        | 2.301.240,81         | 2.573,85                | 3,144         | 3,14393                    | 0,00000                   | 3,14393                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 450063</b> | <b>Belgien, Königreich</b>            |      |           |                          | <b>2.301.240,81</b>  | <b>2.573,85</b>         | <b>3,144</b>  | <b>3,14393</b>             | <b>0,00000</b>            | <b>3,14393</b>             |                   | <b>0</b>            |
|                       | Bankguthaben                          | EUR  |           | B                        | 97.198,26            | 0,00                    | 0,133         | 0,13264                    | 0,13264                   | 0,13264                    | 20                | 19                  |
|                       | sonstige Verbindlichkeiten            | EUR  |           | B                        | -7.286,36            | 0,00                    | -0,010        | 0,00000                    | 0,00000                   | 0,00000                    | 20                | 0                   |
| <b>Konzern 239000</b> | <b>DekaBank Deutsche Girozentrale</b> |      |           |                          | <b>89.911,90</b>     | <b>0,00</b>             | <b>0,123</b>  | <b>0,13264</b>             | <b>0,13264</b>            | <b>0,13264</b>             |                   | <b>19</b>           |
| DE0001102473          | Bundesrep.Deutschland Anl. 19/29      | EUR  | 4.261.000 | B                        | 3.681.631,83         | 0,00                    | 5,024         | 5,02419                    | 0,00000                   | 5,02419                    | 0                 | 0                   |
| DE0001102499          | Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30      | EUR  | 4.044.000 | B                        | 3.454.829,64         | 0,00                    | 4,715         | 4,71468                    | 0,00000                   | 4,71468                    | 0                 | 0                   |
| DE0001102507          | Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30      | EUR  | 4.838.000 | B                        | 4.084.916,92         | 0,00                    | 5,575         | 5,57454                    | 0,00000                   | 5,57454                    | 0                 | 0                   |
| DE0001102556          | Bundesrep.Deutschland Anl. 21/28      | EUR  | 3.900.000 | B                        | 3.424.200,00         | 0,00                    | 4,673         | 4,67288                    | 0,00000                   | 4,67288                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 110000</b> | <b>Deutschland, Bundesrepublik</b>    |      |           |                          | <b>14.645.578,39</b> | <b>0,00</b>             | <b>19,986</b> | <b>19,98628</b>            | <b>0,00000</b>            | <b>19,98628</b>            |                   | <b>0</b>            |
| FI4000441878          | Republik Finnland Bonds 20/30         | EUR  | 1.195.000 | B                        | 965.808,56           | 0,00                    | 1,318         | 1,31800                    | 0,00000                   | 1,31800                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 453568</b> | <b>Finnland, Republik</b>             |      |           |                          | <b>965.808,56</b>    | <b>0,00</b>             | <b>1,318</b>  | <b>1,31800</b>             | <b>0,00000</b>            | <b>1,31800</b>             |                   | <b>0</b>            |
| FR0011883966          | Rep. Frankreich OAT 14/30             | EUR  | 5.641.000 | B                        | 5.526.487,70         | 140.638,63              | 7,734         | 7,73372                    | 0,00000                   | 7,73372                    | 0                 | 0                   |
| FR0013341682          | Rep. Frankreich OAT 17/28             | EUR  | 5.328.000 | B                        | 4.778.150,40         | 19.706,30               | 6,547         | 6,54746                    | 0,00000                   | 6,54746                    | 0                 | 0                   |
| FR0013451507          | Rep. Frankreich OAT 18/29             | EUR  | 4.447.000 | B                        | 3.710.621,27         | 0,00                    | 5,064         | 5,06375                    | 0,00000                   | 5,06375                    | 0                 | 0                   |
| FR001400HI98          | Rep. Frankreich OAT 23/29             | EUR  | 448.000   | B                        | 445.716,77           | 2.970,30                | 0,612         | 0,61231                    | 0,00000                   | 0,61231                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 450287</b> | <b>Frankreich, Republik</b>           |      |           |                          | <b>14.460.976,14</b> | <b>163.315,23</b>       | <b>19,957</b> | <b>19,95723</b>            | <b>0,00000</b>            | <b>19,95723</b>            |                   | <b>0</b>            |
| IE00BKFCV899          | Republik Irland Treasury Bonds 20/30  | EUR  | 1.775.000 | B                        | 1.474.232,11         | 2.120,27                | 2,015         | 2,01472                    | 0,00000                   | 2,01472                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 464541</b> | <b>Irland, Republik</b>               |      |           |                          | <b>1.474.232,11</b>  | <b>2.120,27</b>         | <b>2,015</b>  | <b>2,01472</b>             | <b>0,00000</b>            | <b>2,01472</b>             |                   | <b>0</b>            |
| IT0005383309          | Republik Italien B.T.P. 19/30         | EUR  | 4.944.000 | B                        | 4.173.527,04         | 9.665,11                | 5,709         | 5,70865                    | 0,00000                   | 5,70865                    | 0                 | 0                   |

Stichtag: 22.05.2023

Fondswährung: EUR  
Berichtswährung: EUR

# Grosskreditanzeige



## Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF

| ISIN                                              | Gattung                               | Whg. | Nominale  | Ausf.-<br>risiko<br>pos. | Tageswert            | Stückzins/<br>Dividende | % FV          | anzuzeitg.<br>Betrag % FV* | anzurech.<br>Betrag % FV* | anzuzeitg.<br>Betrag % FV* | Risiko-<br>gew. % | KSA-Wert<br>in 1000 |
|---------------------------------------------------|---------------------------------------|------|-----------|--------------------------|----------------------|-------------------------|---------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|-------------------|---------------------|
|                                                   |                                       |      |           |                          |                      |                         |               | §13 KWG                    | §13 KWG                   | §14KWG                     |                   |                     |
| IT0005403396                                      | Republik Italien B.T.P. 20/30         | EUR  | 3.932.000 | B                        | 3.187.600,05         | 11.557,04               | 4,366         | 4,36577                    | 0,00000                   | 4,36577                    | 0                 | 0                   |
| IT0005495731                                      | Republik Italien B.T.P. 22/29         | EUR  | 3.496.000 | B                        | 3.290.802,98         | 43.027,69               | 4,550         | 4,54956                    | 0,00000                   | 4,54956                    | 0                 | 0                   |
| IT0005519787                                      | Republik Italien B.T.P. 22/29         | EUR  | 3.912.000 | B                        | 3.886.963,20         | 66.203,08               | 5,395         | 5,39474                    | 0,00000                   | 5,39474                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 465688 Italien, Republik</b>           |                                       |      |           |                          | <b>14.538.893,27</b> | <b>130.452,92</b>       | <b>20,019</b> | <b>20,01872</b>            | <b>0,00000</b>            | <b>20,01872</b>            |                   | <b>0</b>            |
| NL0015000LS8                                      | Koenigreich Niederlande Anl. 21/29    | EUR  | 2.762.000 | B                        | 2.378.119,84         | 0,00                    | 3,245         | 3,24533                    | 0,00000                   | 3,24533                    | 0                 | 0                   |
| NL0015001DQ7                                      | Koenigreich Niederlande Bonds 23/30   | EUR  | 1.145.000 | B                        | 1.128.523,45         | 3.764,38                | 1,545         | 1,54519                    | 0,00000                   | 1,54519                    | 0                 | 0                   |
| NL0014555419                                      | Königreich Niederlande Anl. 20/30     | EUR  | 3.081.000 | B                        | 2.548.017,81         | 0,00                    | 3,477         | 3,47719                    | 0,00000                   | 3,47719                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 456326 Niederlande, Königreich der</b> |                                       |      |           |                          | <b>6.054.661,10</b>  | <b>3.764,38</b>         | <b>8,268</b>  | <b>8,26771</b>             | <b>0,00000</b>            | <b>8,26771</b>             |                   | <b>0</b>            |
| AT0000A33SH3                                      | Republik Oesterreich MTN 23/29        | EUR  | 658.000   | B                        | 657.492,16           | 1.515,96                | 0,899         | 0,89932                    | 0,00000                   | 0,89932                    | 0                 | 0                   |
| AT0000A2CQD2                                      | Republik Österreich MTN 20/30         | EUR  | 2.828.000 | B                        | 2.316.358,24         | 0,00                    | 3,161         | 3,16105                    | 0,00000                   | 3,16105                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 462186 Österreich, Republik</b>        |                                       |      |           |                          | <b>2.973.850,40</b>  | <b>1.515,96</b>         | <b>4,060</b>  | <b>4,06037</b>             | <b>0,00000</b>            | <b>4,06037</b>             |                   | <b>0</b>            |
| PTOTEL0E0028                                      | Republik Portugal Obr. 20/30          | EUR  | 2.463.000 | B                        | 2.047.541,16         | 6.987,50                | 2,804         | 2,80374                    | 0,00000                   | 2,80374                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 450603 Portugal, Republik</b>          |                                       |      |           |                          | <b>2.047.541,16</b>  | <b>6.987,50</b>         | <b>2,804</b>  | <b>2,80374</b>             | <b>0,00000</b>            | <b>2,80374</b>             |                   | <b>0</b>            |
| SK4000017059                                      | Slowakei Anl. 20/30                   | EUR  | 658.000   | B                        | 548.167,50           | 4.092,22                | 0,754         | 0,75365                    | 0,00000                   | 0,75365                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 128625 Slowakische Republik</b>        |                                       |      |           |                          | <b>548.167,50</b>    | <b>4.092,22</b>         | <b>0,754</b>  | <b>0,75365</b>             | <b>0,00000</b>            | <b>0,75365</b>             |                   | <b>0</b>            |
| ES0000012K53                                      | Koenigreich Spanien Bonos 22/29       | EUR  | 4.506.000 | B                        | 3.898.514,60         | 29.430,97               | 5,360         | 5,36032                    | 0,00000                   | 5,36032                    | 0                 | 0                   |
| ES0000012F43                                      | Königreich Spanien Bonos 19/29        | EUR  | 4.990.000 | B                        | 4.244.943,10         | 16.815,62               | 5,816         | 5,81587                    | 0,00000                   | 5,81587                    | 0                 | 0                   |
| ES0000012F76                                      | Königreich Spanien Obligaciones 20/30 | EUR  | 5.612.000 | B                        | 4.670.923,72         | 1.840,00                | 6,377         | 6,37675                    | 0,00000                   | 6,37675                    | 0                 | 0                   |
| <b>Konzern 458634 Spanien, Königreich</b>         |                                       |      |           |                          | <b>12.814.381,42</b> | <b>48.086,59</b>        | <b>17,553</b> | <b>17,55294</b>            | <b>0,00000</b>            | <b>17,55294</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.

$$\begin{array}{rclclcl} \text{Tageswert} & + & \text{Forderung} & = & \text{Fondsvermögen} \\ 72.915.242,76 & + & 362.908,92 & = & 73.278.151,68 \end{array}$$