

Stichtag: 17.12.2019

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	Add-On	Bemessungsgrundl.	% Bem.-grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko-gew. %	KSA-Wert in 1000
DE000AAR0231	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.225 18/23	EUR	2.914.000	B	2.951.236,26	3.203,40	2,652		2.954.439,66	2,652	0	0,000	10	295
DE000AAR0249	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.226 19/24	EUR	2.914.000	B	2.957.371,10	3.163,49	2,657		2.960.534,59	2,657	0	0,000	10	296
Konzern 804110 Aareal Bank AG					5.908.607,36	6.366,89	5,309		5.914.974,25	5,309	0,000			591
DE000CZ40MB7	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P18 17/27	EUR	3.885.000	B	4.076.015,74	7.762,04	3,665		4.083.777,78	3,665	0	0,000	10	408
DE000CZ40MU7	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P23 18/25	EUR	3.885.000	B	4.050.551,12	13.600,15	3,648		4.064.151,27	3,648	0	0,000	10	406
DE000CZ40MW3	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P25 18/23	EUR	3.885.000	B	3.957.668,15	2.574,08	3,554		3.960.242,23	3,554	0	0,000	10	396
DE000CZ40NNO	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P29 19/24	EUR	3.885.000	B	3.941.929,62	4.576,85	3,542		3.946.506,47	3,542	0	0,000	10	395
Konzern 803200 Commerzbank AG					16.026.164,63	28.513,12	14,409		16.054.677,75	14,409	0,000			1.605
	Bankguthaben	EUR		B	508.007,33	0,00	0,456		508.007,33	0,456	100	0,456	20	102
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	242,32	0,00	0,000		242,32	0,000	100	0,000	20	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-5.225,72	0,00	-0,005		0,00	0,000	100	0,000	20	0
DE000A2TSDV6	WPL: DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1215 19/29	EUR	2.100.000	B	0,00	0,00	0,000		2.095.478,10	1,881	100	1,881	20	419
DE000LB1DSM2	WPL: Ldsbk Baden-Württemb. MTN Hyp.-Pfe. 17/25	EUR	1.100.000	B	0,00	0,00	0,000		1.135.459,62	1,019	100	1,019	20	227
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					503.023,93	0,00	0,451		3.739.187,38	3,356	3,356			748
DE000DL19SH3	Deutsche Bank AG MTN Hyp.-Pfe. 16/24	EUR	3.885.000	B	3.959.792,08	7.589,55	3,561		3.967.381,63	3,561	0	0,000	10	397
Konzern 804010 Deutsche Bank AG					3.959.792,08	7.589,55	3,561		3.967.381,63	3,561	0,000			397
DE000A2G9HE4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1205 18/25	EUR	3.885.000	B	4.034.807,54	1.910,66	3,623		4.036.718,20	3,623	0	0,000	10	404
DE000A2TSDV6	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1215 19/29	EUR	2.914.000	B	2.907.104,31	621,02	2,610		2.907.725,33	2,610	0	0,000	10	291
DE000A2TSDW4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1216 19/27	EUR	3.885.000	B	3.903.289,80	91,54	3,503		3.903.381,34	3,503	0	0,000	10	390
DE000A161ZQ3	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.371 15/26 [WL]	EUR	3.400.000	B	3.585.297,62	22.356,16	3,238		3.607.653,78	3,238	0	0,000	10	361
Emittent 804140 DZ HYP AG					14.430.499,27	24.979,38	12,974		14.455.478,65	12,974	0,000			1.446
Konzern 238000 DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main					14.430.499,27	24.979,38	12,974		14.455.478,65	12,974	0,000			1.446
DE000HSH5Y29	Hamburg Commercial Bank AG H.-Pf. DIP S.2580 16/23	EUR	3.303.000	B	3.363.126,49	7.986,76	3,026		3.371.113,25	3,026	0	0,000	10	337
Konzern 150215 Hamburg Commercial Bank AG					3.363.126,49	7.986,76	3,026		3.371.113,25	3,026	0,000			337

Stichtag: 17.12.2019

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige



Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF

ISIN	Gattung	Whg.	Nominale	Ausf.- risikop.	Tageswert	Stückzins/ Dividende	% FV	Add-On	Bemessungs- grundl.	% Bem.- grundl.	anzur. % FV*	Betrag	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000
DE000A1KRJR4	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 18/23	EUR	3.900.000	B	3.977.053,47	1.891,39	3,571		3.978.944,86	3,571	0	0,000	10	398
DE000A1KRJT0	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 19/27	EUR	2.900.000	B	2.941.733,90	2.079,92	2,642		2.943.813,82	2,642	0	0,000	10	294
	Emittent 801530 ING-DiBa AG				6.918.787,37	3.971,31	6,213		6.922.758,68	6,213	0,000			692
	Konzern 881111 ING Groep N.V.				6.918.787,37	3.971,31	6,213		6.922.758,68	6,213	0,000			692
DE000LB1DSM2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Hyp.-Pfe. 17/25	EUR	3.885.000	B	3.998.462,20	11.774,74	3,599		4.010.236,94	3,599	0	0,000	10	401
DE000LB1DRT9	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.778 17/24	EUR	3.885.000	B	3.956.060,54	7.301,67	3,557		3.963.362,21	3,557	0	0,000	10	396
DE000LB1M2X2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.791 18/25	EUR	3.900.000	B	3.986.999,25	9.162,33	3,587		3.996.161,58	3,587	0	0,000	10	400
DE000LB125N3	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.800 19/26	EUR	2.914.000	B	3.002.098,96	10.149,10	2,704		3.012.248,06	2,704	0	0,000	10	301
	Konzern 346012 Landesbank Baden-Württemberg				14.943.620,95	38.387,84	13,447		14.982.008,79	13,447	0,000			1.498
DE000DHY5025	Deutsche Hypothekenbank MTN Hyp.-Pfe. S.502 19/29	EUR	2.914.000	B	3.092.916,69	17.257,09	2,791		3.110.173,78	2,791	0	0,000	10	311
	Emittent 804200 Deutsche Hypothekenbank [A.-G.]				3.092.916,69	17.257,09	2,791		3.110.173,78	2,791	0,000			311
DE000NLB2TD7	Norddte Ldsbk -GZ- MTN Pfe. 18/28	EUR	3.885.000	B	4.107.107,78	26.742,64	3,710		4.133.850,42	3,710	0	0,000	10	413
DE000NLB8739	Norddte Ldsbk -GZ- Öff.-Pfe. MTN 17/27	EUR	3.108.000	B	3.252.745,47	17.828,42	2,935		3.270.573,89	2,935	0	0,000	10	327
	Emittent 301000 Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				7.359.853,25	44.571,06	6,646		7.404.424,31	6,646	0,000			740
	Konzern 301000 Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				10.452.769,94	61.828,15	9,437		10.514.598,09	9,437	0,000			1.051
DE000BHY0BS0	Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 19/22	EUR	3.885.000	B	3.916.359,72	121,01	3,515		3.916.480,73	3,515	0	0,000	10	392
	Emittent 802900 Berlin Hyp AG				3.916.359,72	121,01	3,515		3.916.480,73	3,515	0,000			392
	Konzern Regionalverbandsgesellschaft der S-Finanzgruppe mbH				3.916.359,72	121,01	3,515		3.916.480,73	3,515	0,000			392
XS1548773040	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H295 17/22	EUR	4.900.000	B	4.933.405,75	0,00	4,428		4.933.405,75	4,428	0	0,000	10	493
XS1883355601	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H321 18/25	EUR	3.900.000	B	4.046.997,24	4.528,69	3,636		4.051.525,93	3,636	0	0,000	10	405
XS1936190021	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H324 19/22	EUR	5.800.000	B	5.844.695,96	0,00	5,246		5.844.695,96	5,246	0	0,000	10	584
XS2056484889	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H337 19/29	EUR	1.900.000	B	1.882.293,33	43,61	1,689		1.882.336,94	1,689	0	0,000	10	188
	Emittent 268008 Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale				16.707.392,28	4.572,30	14,999		16.711.964,58	14,999	0,000			1.671
	Konzern 150774 Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen KdöR				16.707.392,28	4.572,30	14,999		16.711.964,58	14,999	0,000			1.671
DE000HV2AMD0	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.1879 16/22	EUR	3.885.000	B	3.922.923,82	3.887,65	3,524		3.926.811,47	3,524	0	0,000	10	393
DE000HV2ARM0	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2023 19/29	EUR	3.885.000	B	4.163.931,35	31.851,68	3,766		4.195.783,03	3,766	0	0,000	10	420
DE000HV2ART5	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2029 18/25	EUR	2.914.000	B	3.042.220,37	1.443,07	2,732		3.043.663,44	2,732	0	0,000	10	304
DE000HV2AST3	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2063 19/24	EUR	2.914.000	B	2.937.538,71	79,62	2,637		2.937.618,33	2,637	0	0,000	10	294
	Emittent 802200 UniCredit Bank AG				14.066.614,25	37.262,02	12,658		14.103.876,27	12,658	0,000			1.410
	Konzern 850832 UniCredit S.p.A.				14.066.614,25	37.262,02	12,658		14.103.876,27	12,658	0,000			1.410

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

Tageswert + Forderung = Fondsvermögen

111.196.758,27 + 221.578,33 = 111.418.336,60

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.