

Stichtag: 22.06.2020

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	Bemessungs- grundl.	% Bem.- grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000
DE000AAR0231	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.225 18/23	EUR	3.050.000	B	3.087.105,08	1.500,00	2,688		3.088.605,08	2,688	0	0,000	10	309
DE000AAR0249	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.226 19/24	EUR	3.050.000	B	3.097.996,94	1.500,00	2,697		3.099.496,94	2,697	0	0,000	10	310
Konzern 804110 Aareal Bank AG					6.185.102,02	3.000,00	5,385		6.188.102,02	5,385		0,000		619
DE000CZ40MU7	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P23 18/25	EUR	4.067.000	B	4.252.242,09	1.880,29	3,702		4.254.122,38	3,702	0	0,000	10	425
DE000CZ40MW3	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P25 18/23	EUR	4.067.000	B	4.145.340,99	7.917,32	3,614		4.153.258,31	3,614	0	0,000	10	415
DE000CZ40NN0	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P29 19/24	EUR	3.493.000	B	3.548.864,95	1.992,25	3,090		3.550.857,20	3,090	0	0,000	10	355
DE000CZ45VS1	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P36 20/30	EUR	5.083.000	B	5.141.213,57	147,62	4,474		5.141.361,19	4,474	0	0,000	10	514
Konzern 803200 Commerzbank AG					17.087.661,60	11.937,48	14,881		17.099.599,08	14,881		0,000		1.710
	Bankguthaben	EUR		B	771.563,40	0,00	0,671		771.563,40	0,671	100	0,671	20	154
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	551,28	0,00	0,000		551,28	0,000	100	0,000	20	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-6.751,48	0,00	-0,006		0,00	0,000	100	0,000	20	0
DE000A2TSD55	WPL: DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1220 20/24	EUR	300.000	B	0,00	0,00	0,000		303.936,43	0,265	100	0,265	20	61
DE000HV2AST3	WPL: UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2063 19/24	EUR	2.500.000	B	0,00	0,00	0,000		2.533.577,97	2,205	100	2,205	20	507
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					765.363,20	0,00	0,666		3.609.629,08	3,141		3,141		722
DE000A2LQNP8	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15286 19/24	EUR	3.000.000	B	3.060.241,80	3.012,30	2,666		3.063.254,10	2,666	0	0,000	10	306
DE000A2YNVY3	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15294 20/28	EUR	3.000.000	B	3.063.646,20	1.270,49	2,667		3.064.916,69	2,667	0	0,000	10	306
Konzern 801900 Deutsche Pfandbriefbank AG					6.123.888,00	4.282,79	5,333		6.128.170,79	5,333		0,000		613
DE000A2G9HE4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1205 18/25	EUR	4.067.000	B	4.246.701,62	12.445,46	3,707		4.259.147,08	3,707	0	0,000	10	426
DE000A2TSDV6	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1215 19/29	EUR	3.050.000	B	3.100.570,53	1.433,33	2,700		3.102.003,86	2,700	0	0,000	10	310
DE000A2TSDW4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1216 19/27	EUR	4.067.000	B	4.139.472,72	178,90	3,603		4.139.651,62	3,603	0	0,000	10	414
DE000A2TSD55	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1220 20/24	EUR	3.050.000	B	3.089.897,05	123,33	2,689		3.090.020,38	2,689	0	0,000	10	309
Emittent 804140 DZ HYP AG					14.576.641,92	14.181,02	12,698		14.590.822,94	12,698		0,000		1.459
Konzern 238000 DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main					14.576.641,92	14.181,02	12,698		14.590.822,94	12,698		0,000		1.459
DE000A1KRJR4	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 18/23	EUR	4.100.000	B	4.182.146,78	7.253,42	3,646		4.189.400,20	3,646	0	0,000	10	419

Stichtag: 22.06.2020

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. %	Betrag % FV*	Risiko- gew. %	KSA-Wert in 1000
DE000A1KRJT0	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 19/27	EUR	3.000.000	B	3.076.241,10	328,77	2,677		3.076.569,87	2,677	0	0,000	10	308
	Emittent 801530 ING-DiBa AG				7.258.387,88	7.582,19	6,323		7.265.970,07	6,323		0,000		727
	Konzern 881111 ING Groep N.V.				7.258.387,88	7.582,19	6,323		7.265.970,07	6,323		0,000		727
DE000LB1DSM2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Hyp.-Pfe. 17/25	EUR	4.067.000	B	4.199.405,25	4.917,07	3,659		4.204.322,32	3,659	0	0,000	10	420
DE000LB1DRT9	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.778 17/24	EUR	4.067.000	B	4.145.800,97	3.689,19	3,611		4.149.490,16	3,611	0	0,000	10	415
DE000LB1M2X2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.791 18/25	EUR	4.100.000	B	4.205.926,78	4.648,91	3,664		4.210.575,69	3,664	0	0,000	10	421
DE000LB2CQG8	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.812 20/27	EUR	3.050.000	B	3.102.007,08	133,33	2,700		3.102.140,41	2,700	0	0,000	10	310
	Konzern 346012 Landesbank Baden-Württemberg				15.653.140,08	13.388,50	13,634		15.666.528,58	13,634		0,000		1.567
DE000DHY5025	Deutsche Hypothekenbank MTN Hyp.-Pfe. S.502 19/29	EUR	3.050.000	B	3.282.643,02	6.956,51	2,863		3.289.599,53	2,863	0	0,000	10	329
	Emittent 804200 Deutsche Hypothekenbank [A.-G.]				3.282.643,02	6.956,51	2,863		3.289.599,53	2,863		0,000		329
DE000LB2TD7	Norddte Ldsbk -GZ- MTN Pfe. 18/28	EUR	4.067.000	B	4.345.743,23	13.167,75	3,793		4.358.910,98	3,793	0	0,000	10	436
DE000NLB8739	Norddte Ldsbk -GZ- Öff.-Pfe. MTN 17/27	EUR	3.253.000	B	3.427.824,35	8.776,88	2,991		3.436.601,23	2,991	0	0,000	10	344
	Emittent 301000 Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				7.773.567,58	21.944,63	6,784		7.795.512,21	6,784		0,000		780
	Konzern 301000 Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				11.056.210,60	28.901,14	9,647		11.085.111,74	9,647		0,000		1.109
DE000BHY0BS0	Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 19/22	EUR	4.067.000	B	4.100.450,26	335,58	3,569		4.100.785,84	3,569	0	0,000	10	410
	Emittent 802900 Berlin Hyp AG				4.100.450,26	335,58	3,569		4.100.785,84	3,569		0,000		410
	Konzern Regionalverbandsgesellschaft der S-Finanzgruppe mbH				4.100.450,26	335,58	3,569		4.100.785,84	3,569		0,000		410
XS1548773040	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H295 17/22	EUR	5.100.000	B	5.126.185,95	0,00	4,461		5.126.185,95	4,461	0	0,000	10	513
XS2106576494	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H342 20/25	EUR	5.100.000	B	5.169.034,11	214,59	4,499		5.169.248,70	4,499	0	0,000	10	517
XS1936190021	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H324 19/22	EUR	6.100.000	B	6.143.575,35	0,00	5,347		6.143.575,35	5,347	0	0,000	10	614
XS2056484889	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H337 19/29	EUR	700.000	B	709.876,51	52,02	0,618		709.928,53	0,618	0	0,000	10	71
	Emittent 268008 Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale				17.148.671,92	266,61	14,924		17.148.938,53	14,924		0,000		1.715
	Konzern 150774 Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen KdöR				17.148.671,92	266,61	14,924		17.148.938,53	14,924		0,000		1.715
DE000HV2ARM0	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2023 19/29	EUR	4.067.000	B	4.426.735,10	16.042,98	3,866		4.442.778,08	3,866	0	0,000	10	444
DE000HV2ART5	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2029 18/25	EUR	3.050.000	B	3.197.977,77	11.302,08	2,793		3.209.279,85	2,793	0	0,000	10	321
DE000HV2AST3	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2063 19/24	EUR	3.050.000	B	3.090.725,13	240,00	2,690		3.090.965,13	2,690	0	0,000	10	309
DE000HV2ASU1	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2064 19/27	EUR	4.067.000	B	4.123.523,98	242,24	3,589		4.123.766,22	3,589	0	0,000	10	412
	Emittent 802200 UniCredit Bank AG				14.838.961,98	27.827,30	12,938		14.866.789,28	12,938		0,000		1.487
	Konzern 850832 UniCredit S.p.A.				14.838.961,98	27.827,30	12,938		14.866.789,28	12,938		0,000		1.487

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

Tageswert	+	Forderung	=	Fondsvermögen
114.794.479,46	+	111.702,61	=	114.906.182,07

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.