

Stichtag: 22.09.2020

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	Bemessungsgrundl.	% Bem.-grundl.	anzur. %	Betrag % FV*	Risiko-gew. %	KSA-Wert in 1000
DE000AAR0231	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.225 18/23	EUR	3.073.000	B	3.116.343,13	2.476,87	2,638		3.118.820,00	2,638	0	0,000	10	312
DE000AAR0249	Aareal Bank AG MTN Hyp.-Pfe. S.226 19/24	EUR	3.073.000	B	3.131.975,79	2.476,87	2,651		3.134.452,66	2,651	0	0,000	10	313
Konzern 804110 Aareal Bank AG					6.248.318,92	4.953,74	5,289		6.253.272,66	5,289	0,000			625
DE000CZ40MU7	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P23 18/25	EUR	4.098.000	B	4.296.553,84	8.350,38	3,641		4.304.904,22	3,641	0	0,000	10	430
DE000CZ40MW3	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P25 18/23	EUR	4.098.000	B	4.186.049,63	308,75	3,541		4.186.358,38	3,541	0	0,000	10	419
DE000CZ40NN0	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P29 19/24	EUR	3.833.000	B	3.906.549,90	3.390,53	3,307		3.909.940,43	3,307	0	0,000	10	391
DE000CZ45VS1	Commerzbank AG MT Hyp.-Pfe. S.P36 20/30	EUR	5.122.000	B	5.221.832,39	277,85	4,417		5.222.110,24	4,417	0	0,000	10	522
Konzern 803200 Commerzbank AG					17.610.985,76	12.327,51	14,905		17.623.313,27	14,905	0,000			1.762
	Bankguthaben	EUR		B	641.081,17	0,00	0,542		641.081,17	0,542	100	0,542	20	128
	Entgelt aus Wertpapierleihe	EUR		B	494,43	0,00	0,000		494,43	0,000	100	0,000	20	0
	sonstige Verbindlichkeiten	EUR		B	-6.944,04	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		304.773,47	0,258	100	0,258	20	61
DE000A1KRJT0	WPL: ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 19/27	EUR	1.700.000	B	0,00	0,00	0,000		1.754.612,09	1,484	100	1,484	20	351
XS2106576494	WPL: Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H342 20/25	EUR	1.000.000	B	0,00	0,00	0,000		1.018.713,71	0,862	100	0,862	20	204
XS2056484889	WPL: Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H337 19/29	EUR	1.400.000	B	0,00	0,00	0,000		1.429.747,13	1,209	100	1,209	20	286
Konzern 239000 DekaBank Deutsche Girozentrale					634.631,56	0,00	0,537		5.149.422,01	4,355	4,355			1.030
DE000A2LQNP8	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15286 19/24	EUR	3.100.000	B	3.170.976,98	5.060,79	2,686		3.176.037,77	2,686	0	0,000	10	318
DE000A2YNVY3	Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15294 20/28	EUR	3.100.000	B	3.181.840,31	2.092,08	2,693		3.183.932,39	2,693	0	0,000	10	318
Konzern 801900 Deutsche Pfandbriefbank AG					6.352.817,29	7.152,87	5,379		6.359.970,16	5,379	0,000			636
DE000A2G9HE4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1205 18/25	EUR	4.098.000	B	4.292.493,54	17.690,82	3,645		4.310.184,36	3,645	0	0,000	10	431
DE000A2TSDW4	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1216 19/27	EUR	4.098.000	B	4.193.152,28	283,28	3,547		4.193.435,56	3,547	0	0,000	10	419
DE000A2TSD55	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1220 20/24	EUR	3.073.000	B	3.121.694,76	201,51	2,640		3.121.896,27	2,640	0	0,000	10	312
DE000A289PA7	DZ HYP AG MTN Hyp.-Pfe. R.1227 20/28	EUR	4.098.000	B	4.192.699,04	103,29	3,546		4.192.802,33	3,546	0	0,000	10	419
Emittent 804140 DZ HYP AG					15.800.039,62	18.278,90	13,379		15.818.318,52	13,379	0,000			1.582

Stichtag: 22.09.2020

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
Konzern 238000	DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main				15.800.039,62	18.278,90	13,379		15.818.318,52	13,379		0,000		1.582
DE000A1KRJR4	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 18/23	EUR	4.100.000	B	4.192.213,10	9.829,92	3,554		4.202.043,02	3,554	0	0,000	10	420
DE000A1KRJT0	ING-DiBa AG Hyp.-Pfe. 19/27	EUR	3.100.000	B	3.198.270,31	1.316,44	2,706		3.199.586,75	2,706	0	0,000	10	320
Emittent 801530	ING-DiBa AG				7.390.483,41	11.146,36	6,260		7.401.629,77	6,260		0,000		740
Konzern 881111	ING Groep N.V.				7.390.483,41	11.146,36	6,260		7.401.629,77	6,260		0,000		740
DE000LB1DSM2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Hyp.-Pfe. 17/25	EUR	4.098.000	B	4.246.388,17	8.817,42	3,599		4.255.205,59	3,599	0	0,000	10	426
DE000LB1DRT9	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.778 17/24	EUR	4.098.000	B	4.189.432,94	5.777,51	3,548		4.195.210,45	3,548	0	0,000	10	420
DE000LB1M2X2	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.791 18/25	EUR	4.100.000	B	4.222.264,05	7.225,41	3,577		4.229.489,46	3,577	0	0,000	10	423
DE000LB2CQG8	Ldsbk Baden-Württemb. MTN Pfe. S.812 20/27	EUR	3.073.000	B	3.146.896,43	58,93	2,662		3.146.955,36	2,662	0	0,000	10	315
Konzern 346012	Landesbank Baden-Württemberg				15.804.981,59	21.879,27	13,386		15.826.860,86	13,386		0,000		1.583
DE000DHY5025	Deutsche Hypothekenbank MTN Hyp.-Pfe. S.502 19/29	EUR	3.073.000	B	3.328.132,14	12.818,20	2,826		3.340.950,34	2,826	0	0,000	10	334
Emittent 804200	Deutsche Hypothekenbank [A.-G.]				3.328.132,14	12.818,20	2,826		3.340.950,34	2,826		0,000		334
DE000NLB2TD7	Norddt Ldsbk -GZ- MTN Pfe. 18/28	EUR	4.098.000	B	4.401.866,29	20.993,85	3,741		4.422.860,14	3,741	0	0,000	10	442
DE000NLB8739	Norddt Ldsbk -GZ- Öff.-Pfe. MTN 17/27	EUR	3.278.000	B	3.470.731,65	13.994,19	2,947		3.484.725,84	2,947	0	0,000	10	348
Emittent 301000	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				7.872.597,94	34.988,04	6,688		7.907.585,98	6,688		0,000		791
Konzern 301000	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-				11.200.730,08	47.806,24	9,514		11.248.536,32	9,514		0,000		1.125
DE000BHY0BS0	Berlin Hyp AG Hyp.-Pfe. 19/22	EUR	3.444.000	B	3.478.649,05	24,53	2,942		3.478.673,58	2,942	0	0,000	10	348
Emittent 802900	Berlin Hyp AG				3.478.649,05	24,53	2,942		3.478.673,58	2,942		0,000		348
Konzern	Regionalverbandsgesellschaft der S-Finanzgruppe mbH				3.478.649,05	24,53	2,942		3.478.673,58	2,942		0,000		348
XS1883355601	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H321 18/25	EUR	4.100.000	B	4.287.014,53	20.443,99	3,643		4.307.458,52	3,643	0	0,000	10	431
XS2106576494	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Hyp.-Pfe. S.H342 20/25	EUR	5.100.000	B	5.195.097,15	342,79	4,394		5.195.439,94	4,394	0	0,000	10	520
XS1936190021	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H324 19/22	EUR	6.100.000	B	6.155.532,57	0,00	5,206		6.155.532,57	5,206	0	0,000	10	616
XS2056484889	Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN Öff.-Pfe. S.H337 19/29	EUR	1.900.000	B	1.940.182,15	188,96	1,641		1.940.371,11	1,641	0	0,000	10	194
Emittent 268008	Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale				17.577.826,40	20.975,74	14,885		17.598.802,14	14,885		0,000		1.760
Konzern 150774	Sparkassen- und Giroverband Hessen-Thüringen KdöR				17.577.826,40	20.975,74	14,885		17.598.802,14	14,885		0,000		1.760
DE000HV2ARM0	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2023 19/29	EUR	4.098.000	B	4.482.457,15	25.178,63	3,812		4.507.635,78	3,812	0	0,000	10	451
DE000HV2AST3	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2063 19/24	EUR	3.073.000	B	3.125.160,79	11,79	2,643		3.125.172,58	2,643	0	0,000	10	313
DE000HV2ASU1	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2064 19/27	EUR	4.098.000	B	4.189.347,70	347,10	3,544		4.189.694,80	3,544	0	0,000	10	419
DE000HV2AYA1	UniCredit Bank AG HVB MTN Hyp.-Pfe. S.2100 20/30	EUR	4.098.000	B	4.168.027,03	103,29	3,525		4.168.130,32	3,525	0	0,000	10	417
Emittent 802200	UniCredit Bank AG				15.964.992,67	25.640,81	13,524		15.990.633,48	13,524		0,000		1.599
Konzern 850832	UniCredit S.p.A.				15.964.992,67	25.640,81	13,524		15.990.633,48	13,524		0,000		1.599

Der Kreditnehmerergänzungsschlüssel (BA 095) für diesen Fonds ist 112

* Die Berechnung erfolgte mit dem Fondsvermögen inklusive Stückzinsen.

Tageswert + Forderung = Fondsvermögen

118.064.456,35 + 170.185,97 = 118.234.642,32

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

Stichtag: 22.09.2020

Fondswährung: EUR
Berichtswährung: EUR

Grosskreditanzeige

Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Diversified UCITS ETF



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.