

# Reporting nach Geldmarktfondsverordnung



## Deka Deutsche Börse EUROGOV® Germany Money Market

*Gegenstand dieses Dokuments sind gesetzliche Pflichtinformationen für den Anleger eines Geldmarktfonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial.*

Deka Deutsche Börse EUROGOV® Germany Money Market UCITS ETF  
(WKN / ISIN: ETFL22 / DE000ETFL227);  
verwaltet von Deka Investment GmbH (Deka-Gruppe)  
Investmentfonds: Standard-VNAV-Geldmarktfonds

### 1. Gesamtwert der Vermögenswerte des Geldmarktfonds

Fondsvermögen (EUR) 19,10 Mio.

### 2. Angaben zu den 10 größten Beteiligungen des Geldmarktfonds

Name des Wertpapiers	ISIN des Wertpapiers	Anlagentyp	Land <sup>1</sup>	Laufzeit in Jahren	Anteil in %
Bundesrep.Deutschland Anl. 09/20	DE0001135390	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,15	14,20
Bundesrep.Deutschland Anl. 10/20	DE0001135408	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,65	13,16
Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.171 15/20	DE0001141711	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,44	12,52
Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.172 15/20	DE0001141729	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,93	11,08
Bundesrep.Deutschland Anl. 10/20	DE0001135416	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,82	9,51
UEBERLAUFKONTO LBBW Stuttgart		flüssige Mittel	Bundesrepublik Deutschland	0	9,03
LAUFENDES BANKKONTO DekaBank Frankfurt		flüssige Mittel	Bundesrepublik Deutschland	0	8,42
Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 18/20	DE0001104719	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,34	8,14
Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 18/20	DE0001104735	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,84	6,98
Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 18/20	DE0001104727	Geldmarktinstrument	Bundesrepublik Deutschland	0,59	6,97



# Reporting nach Geldmarktfondsverordnung

## Deka Deutsche Börse EUROGOV® Germany Money Market

### 3. Gewichtete durchschnittliche Zinsbindungsdauer (WAM) und gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAL)

WAM <sup>2</sup> :	0,47
WAL <sup>3</sup> :	0,47

### 4. Fristigkeitsgliederung des Portfolios des Geldmarktfonds

#### Liquiditätsprofil in %

1 Tag oder weniger	100,00
2 - 7 Tage	0,00
8 - 30 Tage	0,00
Mehr als 30 Tage	0,00

#### Liquiditätsindikatoren

Täglicher Liquiditätspuffer <sup>4</sup> :	17,45 %
Wöchentlicher Liquiditätspuffer <sup>5</sup> :	24,95 %

### 5. Kreditprofil des Geldmarktfonds

#### Interne Kreditrisikobewertung<sup>6</sup>

Positiv:	100,00 %
Negativ:	0,00 %

Die ausgewiesenen Fondsanteile "Positiv" und "Negativ" beziehen sich nur auf die Investitionen in Geldmarktinstrumente/Emissionen. Bankguthaben bleiben unberücksichtigt.

# Reporting nach Geldmarktfondsverordnung

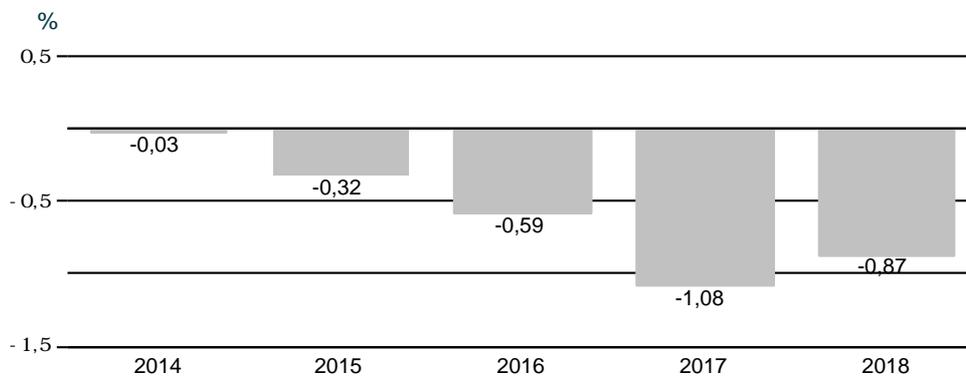
## Deka Deutsche Börse EUROGOV® Germany Money Market

### 6. Nettoerndite des Geldmarktfonds

#### Kumulierte Renditen in %

Stichtag	Laufendes Jahr	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
08.11.2019	-0,77	-0,11	-0,29	-0,88	-2,77	-3,58

#### Kalenderjahr-Performance (Nettoerndite)



Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für die künftige Entwicklung. Bei der Berechnung wurden sämtliche Kosten und Gebühren mit Ausnahme des Ausgabeaufschlags und gegebenenfalls anteilig anfallender Kosten der Verwahrung im Kundendepot abgezogen. Die Darstellung der Wertentwicklung der Kalenderjahre basiert auf der Fondswährung EUR. Dieser Fonds wurde im Jahr 2009 aufgelegt.

<sup>1</sup> *Land:* Bei Geldmarktinstrumenten wird auf den ISO-Ländercode des Emittenten, ansonsten auf das Auflegungsland des Finanzinstruments abgestellt.

<sup>2</sup> *WAM:* Die gewichtete durchschnittliche Zinsbindungsdauer (**Weighted Average Maturity**) bezeichnet die durchschnittliche Zeitspanne bis zur rechtlichen Fälligkeit oder, falls dieser Zeitraum kürzer ist, bis zur nächsten Zinsanpassung an einen Geldmarktsatz für alle Basiswerte im Geldmarktfonds, die die relativen Bestände an jedem einzelnen Vermögenswert widerspiegelt.

<sup>3</sup> *WAL:* Die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (**Weighted Average Life**) bezeichnet die durchschnittliche Zeitspanne bis zur rechtlichen Fälligkeit aller Basiswerte im Geldmarktfonds, die die relativen Bestände an jedem einzelnen Vermögenswert widerspiegelt.

<sup>4</sup> Der tägliche Liquiditätspuffer bezeichnet den Anteil der Vermögenswerte, welcher täglich fällig wird sowie Bareinlagen, die unter Einhaltung einer Frist von einem Arbeitstag abgezogen werden können.

<sup>5</sup> Der wöchentliche Liquiditätspuffer bezeichnet den Anteil der Vermögenswerte, welcher wöchentlich fällig wird oder Bareinlagen, die unter Einhaltung einer Frist von fünf Arbeitstagen abgezogen sowie Geldmarktinstrumente oder Anteile an anderen Geldmarktfonds, sofern sie innerhalb von fünf Arbeitstagen zurückgegeben oder abgewickelt werden können.

<sup>6</sup> Zur Kreditrisikobewertung wurde bei der Deka Investment ein Credit Risk Committee (CRC) eingerichtet, welches sich aus Credit- und Aktienanalysten sowie Risikomanagern zusammensetzt. Diese führen eine Bonitätsprüfung aller relevanten Emittenten und Einzelemissionen durch. Mit Hilfe eines Ampelsystems, d.h. "grün" (geringes Ausfallrisiko) bis "rot" (hohes Ausfallrisiko), wird das mit der jeweiligen Adresse bzw. Emission verbundene Ausfallrisiko signalisiert und klassifiziert, wobei grüne und gelbe Einstufungen als positive und orange und rote Einstufungen als negative Kreditrisikobewertungen gelten. Die internen Kreditrisikobewertungen werden regelmäßig aktualisiert und intern kommuniziert. Bei kritischen Adressen oder Emissionen erhält der Fondsmanager innerhalb des Orderprozesses einen Hinweis auf die besondere Situation dieser Adresse/ des Instrumentes und seine Handlungsmöglichkeiten werden an spezifische Genehmigungserfordernisse geknüpft.