



# 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) 73,19 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 Bundesobl. S.173 16/21 | DE0001141737         | Geldmarktinstrument | Bundesrepublik Deutschland | 0,78               | 15,34       |
| Bundesrep.Deutschland Anl. 10/21             | DE0001135424         | Geldmarktinstrument | Bundesrepublik Deutschland | 0,52               | 14,21       |
| Bundesrep.Deutschland Bundesobl. S.172 15/20 | DE0001141729         | Geldmarktinstrument | Bundesrepublik Deutschland | 0,30               | 13,87       |
| Bundesrep.Deutschland Anl. 10/20             | DE0001135416         | Geldmarktinstrument | Bundesrepublik Deutschland | 0,19               | 11,90       |
| Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 19/21 | DE0001104750         | Geldmarktinstrument | Bundesrepublik Deutschland | 0,70               | 9,50        |
| UEBERLAUFKONTO LBBW Stuttgart                |                      | flüssige Mittel     | Bundesrepublik Deutschland | 0                  | 9,17        |
| Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 18/20 | DE0001104743         | Geldmarktinstrument | Bundesrepublik Deutschland | 0,46               | 8,75        |
| Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 18/20 | DE0001104735         | Geldmarktinstrument | Bundesrepublik Deutschland | 0,21               | 8,73        |
| LAUFENDES BANKKONTO DekaBank Frankfurt       |                      | flüssige Mittel     | Bundesrepublik Deutschland | 0                  | 8,54        |

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

WAM<sup>2</sup>: 0,39

WAL<sup>3</sup>: 0,39

# Reporting nach Geldmarktfondsverordnung

**Deka Deutsche Börse EUROGOV® Germany Money Market**

## 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> :     | 17,71 % |
| Wöchentlicher Liquiditätspuffer <sup>5</sup> : | 25,21 % |

## 5. Kreditprofil des Geldmarktfonds

**Interne Kreditrisikobewertung<sup>6</sup>**

|                           |                 |
|---------------------------|-----------------|
| <b>Positiv</b>            | <b>100.00 %</b> |
| davon Bankguthaben        | 17.7 %          |
| davon Geldmarkinstrumente | 82.3 %          |
| davon Finanzderivate      | 0.0 %           |
| <b>Negativ</b>            | <b>0.0 %</b>    |
| davon Bankguthaben        | 0.0 %           |
| davon Geldmarkinstrumente | 0.0 %           |
| davon Finanzderivate      | 0.0 %           |

Investitionen in Verbriefungen und ABCP, Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und Anteile von Geldmarktfonds sind vertraglich ausgeschlossen.

# Reporting nach Geldmarktfondsverordnung

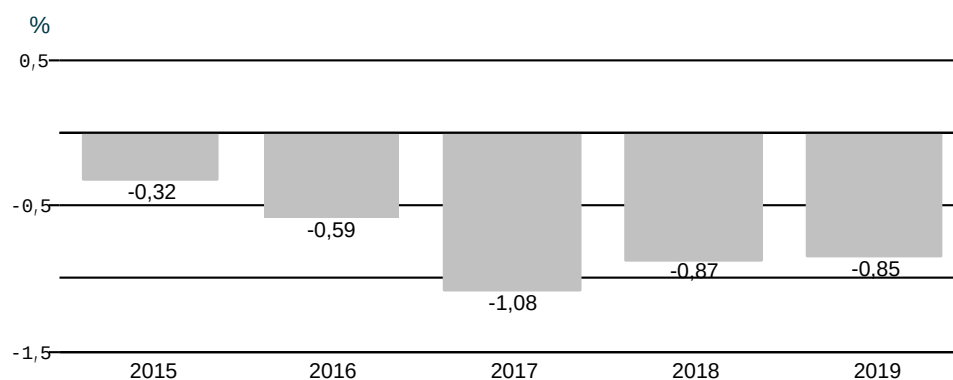
## Deka Deutsche Börse EUROGOV® Germany Money Market

### 6. Nettorendite des Geldmarktfonds

#### Kumulierte Renditen in %

| Stichtag   | Laufendes Jahr | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|------------|----------------|---------|----------|--------|---------|---------|
| 26.06.2020 | -0,40          | -0,04   | -0,19    | -0,83  | -2,59   | -3,90   |

#### Kalenderjahr-Performance (Nettorendite)



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> In einem internen Bewertungsprozess wird die Kreditqualität jedes Emittenten bzw. Kontrahenten beurteilt. Eine positive Bewertung liegt vor, wenn gemäß der internen Beurteilung auf Sicht eines Jahres ein Ausfall auch bei signifikanter oder maßvoller Verschlechterung des Marktumfeldes und der adressenspezifischen Rahmenbedingungen nicht erwartet wird. Für die Bewertung der Geldmarktinstrumente werden neben der Einstufung des Emittenten zusätzlich die emissionsspezifischen Merkmale, beispielsweise hinsichtlich des Ranges oder zusätzlicher Sicherungsabreden, berücksichtigt. Die Kreditqualität unterliegt einer laufenden Überwachung und regelmäßigen Überprüfung.