

Halbjahresbericht  
zum 31. März 2024.

## **Deka-BasisAnlage dynamisch**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

31. März 2024

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds DekabasisAnlage dynamisch für den Zeitraum vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024.

Der Rückgang der Teuerungsraten im Berichtszeitraum sorgte für eine deutliche Entlastung an den Finanzmärkten. Dennoch hat sich in Deutschland die Wirtschaftsdynamik merklich abgekühlt, was sich in einer Schrumpfung des Bruttoinlandsprodukts im Jahr 2023 niederschlug. Auch die Konjunktur in Euroland findet nur schwer aus ihrer Schwächephase heraus. Positiv ausgefallene Konjunkturindikatoren im ersten Quartal 2024 lassen jedoch auf eine Erholung im laufenden Jahr hoffen. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin die Wirtschaftslage in den USA. Die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt sorgten im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik konzentrierte sich weiterhin auf die Inflations-Bekämpfung, wobei sich die Tonlage zum Jahresende 2023 spürbar abmilderte. Während die Fed das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent beibehielt, erhöhte die EZB noch im September den Hauptrefinanzierungssatz auf 4,50 Prozent. Mit ersten Anzeichen für ein Ende des Zinserhöhungs-Zyklus entfernten sich die Verzinsungen ab November wieder sichtlich von ihren zuvor erreichten Höchstständen, bevor im ersten Quartal 2024 insbesondere die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und wieder ansteigende Renditen sorgten. Die Verzinsung 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende März bei 2,3 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,2 Prozent.


An den Aktienmärkten spiegelten sich ab November die Zinssenkungserwartungen in signifikanten Kursanstiegen wider, sodass die wichtigsten Aktienindizes im Berichtszeitraum mehrheitlich erfreuliche Zuwächse verzeichneten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten auf ein neues Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Lediglich der chinesische Aktienmarkt litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise.

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Abschnitt Anlagepolitik. Gerne nehmen wir die Gelegenheit zum Anlass, um Ihnen für das uns entgegengebrachte Vertrauen zu danken.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter [www.deka.de](http://www.deka.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

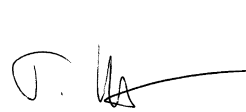
Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung



Dirk Degenhardt (Vorsitzender)



Dirk Heuser



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. März 2024	6
Vermögensaufstellung zum 31. März 2024	7
Anhang	10
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	11

**Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.**

# Deka-BasisAnlage dynamisch

## Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist die Erwirtschaftung eines mittel- bis langfristigen Kapitalwachstums durch ein breit gestreutes Anlageportfolio. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, investiert der Fonds in Wertpapiere und Investmentanteile, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51 % des Fondsvermögens betragen muss. Die Investition in Aktien und Aktienfonds darf insgesamt 80 % des Fondsvermögens nicht überschreiten. Daneben erfolgen Anlagen insbesondere in Rentenfonds, Geldmarktinstrumente und Bankguthaben. Investitionen in Sonstige Anlageinstrumente sind zulässig. Der Fonds verfügt über eine implementierte Risikosteuerung, die sich an der Risikokennzahl SRI (Summary Risk Indicator) orientiert. AnlegerInnen sollen vor sehr hohen Kapitalmarktschwankungen geschützt werden, indem der Fonds sein Vermögen in diesen Marktphasen in defensivere Anlageklassen umschichtet.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Investmentfonds ausgewählt. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens "BBB" oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

Detaillierte Angaben zur Nachhaltigkeitsstrategie und deren Merkmale können Sie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung im Anhang des Verkaufsprospekts, dem entsprechenden Anhang des Jahresberichts sowie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung auf der Webseite des Fonds entnehmen.

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

### Wichtige Kennzahlen

#### Deka-BasisAnlage dynamisch

Performance*	6 Monate
	11,0%
ISIN	DE000A2DJVV1

\* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

# Deka-BasisAnlage dynamisch

## Vermögensübersicht zum 31. März 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Investmentanteile</b>	<b>259.629.379,53</b>	<b>85,12</b>
Deutschland	84.084.906,74	27,57
Irland	43.792.056,79	14,38
Luxemburg	130.997.515,28	42,92
Österreich	754.900,72	0,25
<b>2. Zertifikate</b>	<b>41.280.249,84</b>	<b>13,53</b>
Irland	41.280.249,84	13,53
<b>3. Derivate</b>	<b>212.802,68</b>	<b>0,06</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>3.709.548,15</b>	<b>1,22</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>532.516,28</b>	<b>0,17</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-279.705,40</b>	<b>-0,10</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>305.084.791,08</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Investmentanteile</b>	<b>259.629.379,53</b>	<b>85,12</b>
EUR	223.721.450,72	73,35
USD	35.907.928,81	11,77
<b>2. Zertifikate</b>	<b>41.280.249,84</b>	<b>13,53</b>
EUR	41.280.249,84	13,53
<b>3. Derivate</b>	<b>212.802,68</b>	<b>0,06</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>3.709.548,15</b>	<b>1,22</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>532.516,28</b>	<b>0,17</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-279.705,40</b>	<b>-0,10</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>305.084.791,08</b>	<b>100,00</b>

\*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

# Deka-BasisAnlage dynamisch

## Vermögensaufstellung zum 31. März 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>41.280.249,84</b>	<b>13,53</b>
<b>Zertifikate</b>								<b>41.280.249,84</b>	<b>13,53</b>
<b>EUR</b>								<b>41.280.249,84</b>	<b>13,53</b>
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18		STK	171.945	101.400	5.400	EUR 80,448	13.832.631,36	4,53
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00		STK	31.380	32.000	620	EUR 195,210	6.125.689,80	2,01
XS2183935274	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 20/00		STK	404.898	81.800	197.602	EUR 52,660	21.321.928,68	6,99
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>259.629.379,53</b>	<b>85,12</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>136.120.098,72</b>	<b>44,61</b>
<b>EUR</b>								<b>136.120.098,72</b>	<b>44,61</b>
DE000DK1CJZ4	Deka Bund + S Finanz: 7-15 I		ANT	223.881	27.650	13.750	EUR 88,970	19.918.692,57	6,53
DE000ETFL185	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 1-3 UCITS ETF		ANT	83.080	7.100	0	EUR 74,546	6.193.281,68	2,03
DE000ETFL193	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 3-5 UCITS ETF		ANT	90.304	10.460	3.000	EUR 87,768	7.925.801,47	2,60
DE000ETFL599	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	14.850	1.200	4.500	EUR 88,670	1.316.749,50	0,43
DE000ETFL565	Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	550.836	11.000	36.000	EUR 15,982	8.803.460,95	2,89
DE000ETFL318	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	888.150	44.000	54.000	EUR 9,316	8.274.005,40	2,71
DE000ETFL573	Deka MSCI USA Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	488.188	34.072	69.900	EUR 45,190	22.061.215,72	7,23
LU0133819333	Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien		ANT	395.516	30.100	17.400	EUR 61,340	24.260.951,44	7,94
DE000ETFL524	Deka US Treasury 7-10 UCITS ETF		ANT	8.724	880	150	EUR 827,660	7.220.505,84	2,37
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial I (A)		ANT	18.322	500	0	EUR 224,490	4.113.105,78	1,35
LU0851807460	Deka-Globale Aktien LowRisk I (A)		ANT	100.107	8.350	4.570	EUR 243,740	24.400.080,18	7,99
DE0009771824	Deka-Variolinvest TF		ANT	6.627	10.000	14.000	EUR 63,610	421.543,47	0,14
DE000A1JSHJ5	Weltzins-INVEST (I)		ANT	57.543	0	42.600	EUR 21,040	1.210.704,72	0,40
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>123.509.280,81</b>	<b>40,51</b>
<b>EUR</b>								<b>87.601.352,00</b>	<b>28,74</b>
LU0368229703	BGF - Euro Bond Fund Actions Nominatives I2		ANT	73.304	0	0	EUR 13,720	1.005.730,88	0,33
LU1435395980	BLRK STR.FDS-BK Sust.Euro Bd Action Nom.I2 Acc.		ANT	4.501	830	7.800	EUR 94,200	423.994,20	0,14
DE000DWS17Z6	Deutsche Extra Bond Tot.Return FD		ANT	16.498	0	0	EUR 44,790	738.945,42	0,24
AT0000A1PY56	ERSTE RESPONSIBLE BD EMERG.CO. Inh.-Ant. I A ANT		ANT	8.782	1.100	4.350	EUR 85,960	754.900,72	0,25
LU0404498767	HSBC GIF-Euro High Yield Bond X (Cap.)		ANT	6.763	0	6.400	EUR 52,634	355.963,74	0,12
IE000COQKPO9	I.M.II-NASDAQ-100 ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	137.000	137.000	0	EUR 48,775	6.682.175,00	2,19
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.		ANT	150.500	0	134.000	EUR 5,195	781.892,65	0,26
IE00B3VWN393	iShs VII-\$ Trsy Bd 3-7yr U.ETF Reg.Shares		ANT	60.059	4.700	0	EUR 120,160	7.216.689,44	2,37
IE00B52VJ196	iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)		ANT	17.906	0	0	EUR 69,330	1.241.422,98	0,41
IE00BF4G7183	JPM ICAV-EU Res.EI Eq.ETF Reg.Sh.J E.R.E.I.EEO A		ANT	161.000	161.000	0	EUR 41,900	6.745.900,00	2,21
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	30.655	2.100	0	EUR 107,160	3.284.937,93	1,08
LU2051469893	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Dis.		ANT	32.075	3.700	0	EUR 105,240	3.375.572,16	1,11
LU1529809490	JPM.Fds-Europe Sustainable Eq. Act. Nom. S2(acc)		ANT	67.440	0	2.150	EUR 122,760	8.278.934,40	2,71
LU1727352749	JPMorgan Fds-EU Government Bd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	23.650	35.900	12.250	EUR 95,805	2.265.788,25	0,74
LU0986646882	Kempen I.F.-K.(L.)EO Sus.Cred. I Acc.		ANT	2.021	450	400	EUR 982,510	1.985.652,71	0,65
LU1781541252	MUL-AMUNDI MSCI Japan U.ETF Nam.-An. Acc		ANT	495.400	238.200	41.300	EUR 16,924	8.384.149,60	2,75
IE00BM990G73	Natixis Int.I-LS.sust.EUR Cred Reg.Shs S2 A Acc.		ANT	185.457	30.000	25.000	EUR 9,490	1.759.986,93	0,58
IE00051PE6L2	NBIF-Neu.Ber.Eur.Su.Eq. Reg.Shs I3 Dis.		ANT	446.800	15.000	55.000	EUR 9,830	4.392.044,00	1,44
LU1642485772	T. Rowe Price - US Equity Fd I 10		ANT	76.470	0	6.300	EUR 137,290	10.498.566,30	3,44
LU0569864134	UBAM-Global High Yield Solut. Inhaber-Ant. IH Dis.		ANT	5.640	1.000	11.900	EUR 97,780	551.479,20	0,18
LU2145396326	Vontobel F-Sust.Emerg.Mark.De. Act. Nom. HI Acc.		ANT	7.800	7.800	0	EUR 96,730	754.494,00	0,25
IE000EESGXZ0	W.M.Fds(I)-W.Euro Hi.Yi.Bd Fd Reg.Shs E Acc.		ANT	30.900	30.900	0	EUR 11,476	354.611,49	0,12
IE00BG36TC12	Xtr.(IE)-MSCI Japan ESG UC.ETF Reg.Shares 1C		ANT	172.000	161.000	0	EUR 20,865	3.588.780,00	1,18
LU0322253906	Xtr.MSCI Europe Small Cap 1C		ANT	214.000	214.000	0	EUR 56,910	12.178.740,00	3,99
<b>USD</b>								<b>35.907.928,81</b>	<b>11,77</b>
LU1955039745	AAF Parnassus US ESG Equities Namens-Ant. X1 Acc.		ANT	59.258	39.300	2.100	USD 189,075	10.382.917,57	3,40
LU1200235437	DPAM L-Bonds Em.Mkts. Sust. Actions au Port.F Acc.		ANT	6.240	800	12.200	USD 131,490	760.353,63	0,25
IE00BZ1BLN67	Fr.Tpl.GF-FGTG CB Us Eq.Su.Ldr N-Anteile S Acc.		ANT	22.641	0	1.800	USD 209,090	4.386.995,36	1,44
IE00BJ5JNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.		ANT	937.500	175.000	1.065.000	USD 7,645	6.641.558,94	2,18

# Deka-BasisAnlage dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
LU1727362110	JPMorg.I.-US Select Equity Fd Act. Nom.I2 Acc.		ANT	33.500	34.500	1.000	USD 221,330	6.871.054,58	2,25
LU1727352665	JPMorgan Fds-Emer.Mrkt Opp.Fd Act. Nom.I2 Acc.		ANT	72.728	5.300	0	USD 101,860	6.865.048,73	2,25
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 300.909.629,37</b>	<b>98,65</b>
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b> Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Optionsrechte</b>									
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>									
	DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 24 4600		XEUR	Anzahl 300			EUR 23,800	71.400,00	0,02
	S & P 500 Index (S500) Put Juni 24 4900		XCBO	Anzahl 50			USD 28,450	131.822,82	0,04
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR 203.222,82</b>	<b>0,06</b>
<b>Zins-Derivate</b> Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>									
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Juni 24		XCBT	USD 15.000.000				9.579,86	0,00
<b>Summe Zins-Derivate</b>								<b>EUR 9.579,86</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	3.262.706,45			% 100,000	3.262.706,45	1,07
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	30.112.456,00			% 100,000	184.348,81	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	283.256,08			% 100,000	262.492,89	0,09
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR 3.709.548,15</b>	<b>1,22</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR 3.709.548,15</b>	<b>1,22</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	278.009,45				278.009,45	0,09
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	224.718,00				224.718,00	0,07
	Sonstige Forderungen		EUR	29.788,83				29.788,83	0,01
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR 532.516,28</b>	<b>0,17</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-49.415,60				-49.415,60	-0,02
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-230.289,80				-230.289,80	-0,08
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR -279.705,40</b>	<b>-0,10</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>EUR 305.084.791,08</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>								<b>STK 2.723.049,000</b>	
<b>Anteilwert</b>								<b>EUR 112,04</b>	

\*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.03.2024

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,07910	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	163,34500	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU1136108757	AGIF-Allianz Euro Credit SRI Inh. Anteile WT	ANT	840	1.683
LU2360511021	Eur.Specialist IF-MG Su.Eu.Cr. Act. Nom. EI Acc.	ANT	0	9.460
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.	ANT	57.000	669.500
IE00BFYV9M80	Guinness A.M.Fds-G.Sust.Energy Reg.Shs Y Acc.	ANT	80.707	621.817
LU1829219390	MUL Amundi Euro Stoxx Banks UCITS ETF Inh.A. AccN.	ANT	1.400	53.300
LU2196483163	Nordea 1-Emerging Stars Bd Fd Act. Nom. HBI Acc.	ANT	0	8.600

# Deka-BasisAnlage dynamisch

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
LU2016215001	Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.	ANT	7.500	97.430
LU1974696418	UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.U.E A. Nom.(hdg) A-acc.	ANT	0	63.055

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): S&P 500 Index)	EUR	417
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): Ten-Year US Treasury Note Future (TY), US Treasury Long Bond Future (US))	EUR	21.218
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM))	EUR	28.376
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	48.422
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
USD/EUR	EUR	1.822



# Deka-BasisAnlage dynamisch

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	2.723.049
Anteilwert	EUR	112,04

### Angaben zu Bewertungsverfahren

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgt durch die Verwaltungsgesellschaft auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch (§ 168) und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und -Bewertungsverordnung (KARBV).

#### Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzvolumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

#### Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Für die Bewertung von Renten, rentenähnlichen Genussscheinen und Zertifikaten, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind, wird grundsätzlich der letzte verfügbare handelbare Kurs zugrunde gelegt. Renten, rentenähnliche Genussscheine und Zertifikate, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mit marktnahen Kursstellungen (in der Regel Brokerquotes, alternativ mit sonstigen Preisquellen) bewertet, welche auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden. Die Bewertung von Schuldscheindarlehen erfolgt in der Regel mit Modellbewertungen, die von externen Dienstleistern bezogen und auf Basis geeigneter Verfahren validiert werden.

#### Investmentanteile

Investmentanteile werden zum letzten von der Investmentgesellschaft festgestellten Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Börsenkurs bewertet.

#### Derivate

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Futures und Optionen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mit Verkehrswerten bewertet, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Black-Scholes-Merton) ermittelt werden. Die Bewertung von Swaps erfolgt anhand von Fair Values, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Discounted-Cash-Flow-Verfahren) ermittelt werden. Devisentermingeschäfte werden nach der Forward Point Methode bewertet.

#### Bankguthaben

Bankguthaben wird zum Nennwert bewertet.

#### Sonstiges

Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Fonds geführt werden, wird in diese Währung zu den jeweiligen Devisenkursen (i.d.R. Reuters-Fixing) umgerechnet.

### Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt. Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

---

Frankfurt am Main, den 2. April 2024  
Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

16.09.1988

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 22,4 Mio.

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Dr. Matthias Danne  
Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der  
DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main  
und der  
Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf

### Stellvertretende Vorsitzende

Birgit Dietl-Benzin  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der  
Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,  
Wiesbaden

### Mitglieder

Wolfgang Dürr, Trier

Rita Geyermann  
Direktorin der KfW-Bankengruppe, Frankfurt am Main

Victor Mofitakhar, Bad Nauheim

Sabine Schmittroth  
Geschäftsführende Gesellschafterin der sajos GmbH,  
Frankfurt am Main

### Geschäftsführung

Dirk Degenhardt (Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der bevestor GmbH, Frankfurt am Main

Dirk Heuser

Thomas Ketter  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main;  
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der  
IQAM Invest GmbH, Salzburg

Thomas Schneider  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,  
Luxemburg;

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Europa-Allee 91  
60486 Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

### Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

### Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 31. März 2024

Die vorstehenden Angaben werden in den Jahres- und ggf. Halbjahresberichten jeweils aktualisiert.



**Deka Vermögens-  
management GmbH**

Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 6 52  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

 **Finanzgruppe**