

Halbjahresbericht  
zum 31. März 2024.

## **Deka-BasisAnlage konservativ**

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 Deka-BasisAnlage konservativ 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

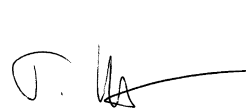
Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung



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 konservativ

## 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 20 % 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 konservativ

Performance*	6 Monate
	5,9%
ISIN	DE000DK2CFP1

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

# Deka-BasisAnlage konservativ

## Vermögensübersicht zum 31. März 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Investmentanteile</b>	<b>417.163.716,16</b>	<b>85,55</b>
Deutschland	178.273.411,46	36,55
Irland	47.699.530,61	9,78
Luxemburg	180.025.367,71	36,93
Österreich	11.165.406,38	2,29
<b>2. Zertifikate</b>	<b>29.908.157,00</b>	<b>6,13</b>
Irland	29.908.157,00	6,13
<b>3. Derivate</b>	<b>103.079,82</b>	<b>0,02</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>40.419.226,95</b>	<b>8,29</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>519.442,91</b>	<b>0,10</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-401.351,53</b>	<b>-0,09</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>487.712.271,31</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Investmentanteile</b>	<b>417.163.716,16</b>	<b>85,55</b>
EUR	396.994.470,30	81,42
USD	20.169.245,86	4,13
<b>2. Zertifikate</b>	<b>29.908.157,00</b>	<b>6,13</b>
EUR	29.908.157,00	6,13
<b>3. Derivate</b>	<b>103.079,82</b>	<b>0,02</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>40.419.226,95</b>	<b>8,29</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>519.442,91</b>	<b>0,10</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-401.351,53</b>	<b>-0,09</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>487.712.271,31</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-BasisAnlage konservativ

## 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>29.908.157,00</b>	<b>6,13</b>
<b>Zertifikate</b>								<b>29.908.157,00</b>	<b>6,13</b>
<b>EUR</b>								<b>29.908.157,00</b>	<b>6,13</b>
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18	STK		62.000	62.000	0	EUR 80,448	4.987.776,00	1,02
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK		26.000	27.500	1.500	EUR 195,210	5.075.460,00	1,04
XS2183935274	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 20/00	STK		376.850	56.400	220.550	EUR 52,660	19.844.921,00	4,07
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>417.163.716,16</b>	<b>85,55</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>209.544.736,44</b>	<b>42,97</b>
<b>EUR</b>								<b>209.544.736,44</b>	<b>42,97</b>
DE000DK1CJZ4	Deka Bund + S Finanz: 7-15 I	ANT		286.181	8.600	33.150	EUR 88,970	25.461.523,57	5,22
DE000ETFL177	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany UCITS ETF	ANT		119.858	0	7.900	EUR 88,570	10.615.823,06	2,18
DE000ETFL185	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 1-3 UCITS ETF	ANT		132.673	0	7.300	EUR 74,546	9.890.241,46	2,03
DE000ETFL193	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 3-5 UCITS ETF	ANT		74.585	0	6.300	EUR 87,768	6.546.176,28	1,34
DE000ETFL201	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 5-10 UCITS ETF	ANT		317.102	4.300	28.200	EUR 105,850	33.565.246,70	6,88
DE000ETFL599	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF	ANT		75.850	13.300	5.100	EUR 88,670	6.725.619,50	1,38
DE000ETFL565	Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF	ANT		222.000	0	43.000	EUR 15,982	3.548.004,00	0,73
DE000ETFL318	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF	ANT		331.274	0	68.000	EUR 9,316	3.086.148,58	0,63
DE000ETFL573	Deka MSCI USA Climate Change ESG UCITS ETF	ANT		191.198	0	46.900	EUR 45,190	8.640.237,62	1,77
LU0133819333	Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien	ANT		160.549	4.000	23.250	EUR 61,340	9.848.075,66	2,02
DE000ETFL524	Deka US Treasury 7-10 UCITS ETF	ANT		22.365	300	1.550	EUR 827,660	18.510.615,90	3,80
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial I (A)	ANT		12.009	0	1.210	EUR 224,490	2.695.900,41	0,55
LU0249486092	Deka-FlexZins CF	ANT		24.950	12.500	1.000	EUR 980,890	24.473.205,50	5,02
LU0851807460	Deka-Globale Aktien LowRisk I (A)	ANT		40.134	0	6.230	EUR 243,740	9.782.261,16	2,01
DE0007019416	Deka-Institutionell Renten Europa	ANT		45.441	0	2.800	EUR 62,260	2.829.156,66	0,58
DE0009771824	Deka-VarioInvest TF	ANT		385.200	210.000	15.900	EUR 63,610	24.502.572,00	5,02
AT0000A2W9P5	IQAM OptionsprämienStrategie Protect (S)	ANT		4.853	0	200	EUR 1040,460	5.049.352,38	1,04
DE000A1JSHJ5	Weltzins-INVEST (I)	ANT		179.400	0	76.000	EUR 21,040	3.774.576,00	0,77
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>207.618.979,72</b>	<b>42,58</b>
<b>EUR</b>								<b>187.449.733,86</b>	<b>38,45</b>
LU1136108757	AGIF-Allianz Euro Credit SRI Inh. Anteile WT	ANT		6.535	730	550	EUR 1034,020	6.757.320,70	1,39
LU0272941112	Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro I (C)	ANT		7.820	280	250	EUR 1230,030	9.618.834,60	1,97
LU1220060260	AXA Wld Fds-Euro Credit Plus Namens-Ant. I Dis.	ANT		69.174	10.400	7.000	EUR 96,370	6.666.298,38	1,37
LU0368229703	BGF - Euro Bond Fund Actions Nominatives I2	ANT		234.086	0	26.500	EUR 13,720	3.211.659,92	0,66
LU1435395980	BLRK STR.FDS-BK Sust.Euro Bd Action Nom.I2 Acc.	ANT		34.067	0	3.600	EUR 94,200	3.209.111,40	0,66
DE000DWS17Z6	Deutsche Extra Bond Tot.Return FD	ANT		108.587	0	9.000	EUR 44,790	4.863.611,73	1,00
LU1432415641	DWS Inv.-Euro High Yield Corp.	ANT		44.100	0	5.000	EUR 94,750	4.178.475,00	0,86
AT0000A1PY56	ERSTE RESPONSIBLE BD EMERG.CO. Inh.-Ant. I A ANT	ANT		71.150	0	5.600	EUR 85,960	6.116.054,00	1,25
LU1334564140	Helium Fd-Helium Fund Actions-Nom. I Cap.	ANT		9.320	9.320	0	EUR 1219,121	11.362.290,62	2,33
LU0404498767	HSBC GIF-Euro High Yield Bond X (Cap.)	ANT		39.896	0	49.800	EUR 52,634	2.099.886,06	0,43
IE000COQKPO9	I.M.II-NASDAQ-100 ESG ETF Reg.Shs Acc.	ANT		57.000	57.000	0	EUR 48,775	2.780.175,00	0,57
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.	ANT		775.000	0	108.000	EUR 5,195	4.026.357,50	0,83
IE00B3VWN393	iShs VII-\$ Trsy Bd 3-7yr U.ETF Reg.Shares	ANT		154.100	0	4.700	EUR 120,160	18.516.656,00	3,80
IE00BJSJNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.	ANT		392.000	0	495.000	EUR 7,060	2.767.520,00	0,57
IE00BF4G7183	JPM ICAV-EU Res.EI Eq.ETF Reg.Sh.J E.R.E.I.E.O A	ANT		64.500	70.000	5.500	EUR 41,900	2.702.550,00	0,55
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.	ANT		12.681	0	0	EUR 107,160	1.358.903,78	0,28
LU2051469893	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Dis.	ANT		14.315	0	0	EUR 105,240	1.506.538,17	0,31
LU1529809490	JPM.Fds-Europe Sustainable Eq. Act. Nom. S2(acc)	ANT		23.013	0	4.000	EUR 122,760	2.825.075,88	0,58
LU1727352749	JPMorgan Fds-EU Government Bd Act. Nom. I2 Acc.	ANT		193.100	200.000	6.900	EUR 95,805	18.499.945,50	3,79
LU0986646882	Kempen I.F.-K.(L.)EO Sus.Cred. I Acc.	ANT		6.693	1.030	670	EUR 982,510	6.575.939,43	1,35
DE000A2QDRK7	LBBW Renten Short Term Nachha. I	ANT		158.790	0	12.000	EUR 98,960	15.713.858,40	3,22
LU0360477631	Mor.St.Inv.-Euro Bond Fund Actions Nom. Z	ANT		82.710	0	8.000	EUR 38,240	3.162.830,40	0,65
LU1781541252	MUL-AMUNDI MSCI Japan U.ETF Nam.-An. Acc	ANT		219.200	77.000	18.000	EUR 16,924	3.709.740,80	0,76
IE00BM990G73	Natixis Int.I-LS.sust.EUR Cred Reg.Shs S2 A Acc.	ANT		711.071	106.700	54.000	EUR 9,490	6.748.063,79	1,38

# Deka-BasisAnlage konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
IE000S1PE6L2	NBIF-Neu.Ber.Eur.Su.Eq. Reg.Shs I3 Dis.		ANT	191.500	0	44.000	EUR 9,830	1.882.445,00	0,39
LU2080996049	SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. IZ Acc.		ANT	64.551	8.800	7.800	EUR 102,041	6.586.848,59	1,35
LU1642485772	T. Rowe Price - US Equity Fd I 10		ANT	31.650	0	7.350	EUR 137,290	4.345.228,50	0,89
LU0569864134	UBAM-Global High Yield Solut. Inhaber-Ant. IH Dis.		ANT	32.286	0	74.800	EUR 97,780	3.156.925,08	0,65
LU1974696418	UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.U.E A. Nom.(hdg) A-acc.		ANT	574.000	0	57.000	EUR 10,636	6.105.064,00	1,25
LU1669794551	UI-Aktia EM Local Ccy Bond+ Namens-Ant. IX Acc.		ANT	28.250	0	50.650	EUR 119,880	3.386.610,00	0,69
LU2145396326	Vontobel F-Sust.Emerg.Mark.De. Act. Nom. HI Acc.		ANT	13.000	13.000	0	EUR 96,730	1.257.490,00	0,26
IE000EESGXZ0	W.M.Fds(I)-W.Euro Hi.Yi.Bd Fd Reg.Shs E Acc.		ANT	178.800	178.800	0	EUR 11,476	2.051.926,68	0,42
IE00BW4NVS37	WMF(I)-W.Emerg.Local Debt Fund Reg.Shs S Acc.Unh.		ANT	291.500	404.000	112.500	EUR 11,572	3.373.325,45	0,69
IE00BG36TC12	Xtr.(IE)-MSCI Japan ESG UC.ETF Reg.Shares 1C		ANT	65.900	65.900	0	EUR 20,865	1.375.003,50	0,28
LU0322253906	Xtr.MSCI Europe Small Cap 1C		ANT	87.000	87.000	0	EUR 56,910	4.951.170,00	1,02
<b>USD</b>								<b>20.169.245,86</b>	<b>4,13</b>
LU1955039745	AAF Parnassus US ESG Equities Namens-Ant. X1 Acc.		ANT	24.451	13.500	3.050	USD 189,075	4.284.193,15	0,88
LU1200235437	DPAM L-Bonds Em.Mkts. Sust. Actions au Port.F Acc.		ANT	65.758	0	32.800	USD 131,490	8.012.713,76	1,64
IE00BZ1BLN67	Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr N.-Anteile S Acc.		ANT	7.615	0	1.450	USD 209,090	1.475.507,69	0,30
LU1727362110	JPMorgl.-US Select Equity Fd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	16.200	17.600	1.400	USD 221,330	3.322.718,93	0,68
LU1727352665	JPMorgan Fds-Emer.Mrkt Opp.Fd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	32.567	0	0	USD 101,860	3.074.112,33	0,63
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>447.071.873,16</b>	<b>91,68</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>87.752,04</b>	<b>0,02</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>								<b>87.752,04</b>	<b>0,02</b>
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 24 4600		XEUR		Anzahl 125			EUR 23,800	29.750,00	0,01
S & P 500 Index (S500) Put Juni 24 4900		XCBO		Anzahl 22			USD 28,450	58.002,04	0,01
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>87.752,04</b>	<b>0,02</b>
<b>Zins-Derivate</b>	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>15.327,78</b>	<b>0,00</b>
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Juni 24		XCBT	USD	24.000.000				15.327,78	0,00
<b>Summe Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>15.327,78</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	39.125.937,95			% 100,000	39.125.937,95	8,02
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	54.603.856,00			% 100,000	334.285,44	0,07
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	1.034.860,74			% 100,000	959.003,56	0,20
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>40.419.226,95</b>	<b>8,29</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>40.419.226,95</b>	<b>8,29</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	444.815,12				444.815,12	0,09
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	57.571,28				57.571,28	0,01
Sonstige Forderungen			EUR	17.056,51				17.056,51	0,00
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>519.442,91</b>	<b>0,10</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-177.528,52				-177.528,52	-0,04
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-223.823,01				-223.823,01	-0,05
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-401.351,53</b>	<b>-0,09</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>487.712.271,31</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>4.753.484,000</b>	
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>102,60</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)

# Deka-BasisAnlage konservativ

## 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>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU0297135294	Deka-OptiRent CF	ANT	0	237.744
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
FR0011510023	Candriam Index Arbitrage Act.au Port.V 3 Déc.	ANT	0	13.293
LU2360511021	Eur.Specialist IF-MG Su.Eu.Cr. Act. Nom. EI Acc.	ANT	0	69.080
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.	ANT	0	291.000
IE00BFYV9M80	Guinness A.M.Fds-G.Sust.Energy Reg.Shs Y Acc.	ANT	19.000	267.593
FR0010757831	Helium Opportunités Act. au Porteur A 3 Déc.	ANT	0	7.490
LU1829219390	MUL Amundi Euro Stoxx Banks UCITS ETF Inh.A. AccN.	ANT	0	23.200
LU2018762653	MUL Amundi US Curve Ste 2-10Y UCITS ETF Inh.A. Acc	ANT	7.500	150.150
LU2196483163	Nordea 1-Emerging Stars Bd Fd Act. Nom. HBI Acc.	ANT	0	14.800
LU2016215001	Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.	ANT	0	594.916

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>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): Ten-Year US Treasury Note Future (TY), US Treasury Long Bond Future (US))	EUR	36.759
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM))	EUR	49.659
<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	21.856



# Deka-BasisAnlage konservativ

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	4.753,484
Anteilwert	EUR	102,60

### 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**