

Halbjahresbericht  
zum 31. März 2022.

## **Deka-BasisAnlage konservativ**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

31. März 2022

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds DekabasisAnlage konservativ für den Zeitraum vom 1. Oktober 2021 bis zum 31. März 2022.

Bis in den Februar 2022 hinein beherrschte die Corona-Pandemie über weite Strecken die Schlagzeilen im Berichtszeitraum, wobei sich die Erholung der Wirtschaft in Euroland im Verlauf spürbar abschwächte. Angesichts der starken Lieferkettenprobleme sowie steigender Rohstoff- und Energiepreise kam es zu einer Verlangsamung des Wachstumstempos. Ende Februar veränderte der völkerrechtswidrige Angriff Russlands auf die Ukraine das Bild jedoch schlagartig und dominiert seitdem das Geschehen an den internationalen Finanzmärkten. Umfangreiche und wirkungsvolle Sanktionsmaßnahmen wurden in großer Geschlossenheit gegen den russischen Aggressor auf den Weg gebracht, doch Versuche, den Konflikt auf diplomatischem Weg zu entschärfen, scheiterten bisher an der unnachgiebigen Haltung Moskaus. Für Beunruhigung sorgten zudem Lieferengpässe bei Rohstoffen und Vorprodukten sowie signifikant ansteigende Inflationsraten. In der Eurozone sind die Verbraucherpreise im März 2022 um 7,5 Prozent gestiegen, den höchsten Wert seit Bestehen des Euro.

Die Geld- und Fiskalpolitik war über weite Strecken von Unterstützungsmaßnahmen hinsichtlich der Corona-Krise geprägt, bevor die Inflationsentwicklung immer stärker in den Vordergrund rückte. Sowohl die EZB als auch die Federal Reserve haben eine Drosselung ihrer Anleihekäufe eingeleitet. Darüber hinaus vollzog die US-Notenbank im März den ersten Schritt der angekündigten Leitzinswende und erhöhte diesen um 25 Basispunkte. An den Rentenmärkten stiegen die Renditen im Verlauf unter Schwankungen an. Ende März rentierten 10-jährige deutsche Bundesanleihen bei plus 0,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries lagen zuletzt bei plus 2,3 Prozent.

Die Aktienmärkte zeigten auf Sicht der letzten sechs Monate ein uneinheitliches Bild und konnten ihre zwischenzeitlichen Gewinne überwiegend nicht halten. Vor allem in den letzten Wochen des Berichtszeitraums flammte die Unsicherheit angesichts der militärischen Eskalation in der Ukraine auf, was sich in einer entsprechend hohen Schwankungsbreite an den Märkten niederschlug. Auch der Ölpreis spiegelte dies wider, zuletzt kostete ein Barrel Öl der Sorte Brent wieder über 100 US-Dollar.

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 2022	6
Vermögensaufstellung zum 31. März 2022	7
Anhang	11
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	12

**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 ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Eine implementierte Risikosteuerung soll Anleger vor hohen Kapitalmarktschwankungen schützen.

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.

Der Fonds kann in Wertpapiere und Investmentanteile investieren, 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. Darüber hinaus sind Investitionen in Derivate und Sonstige Anlageinstrumente zulässig.

Die Investition in Zielfonds erfolgt nur in solche, die nach Grundsätzen der Nachhaltigkeit ausgewählt werden. Dazu werden die Zielfonds nach Kriterien für Umwelt (z.B. Klimaschutz), soziale Verantwortung (z.B. Menschen- und Arbeitsrechte) und Governance (z.B. Bestechung und Korruption) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder ausgeschlossen. Bei der Zielfondsauswahl wird darüber hinaus sichergestellt, dass die ausgewählten Zielfonds zusätzlich besser als der Durchschnitt diese relevanten Umwelt-, Sozial- und Governance-Fragen berücksichtigen.

Die Erträge eines Geschäftsjahres werden grundsätzlich ausgeschüttet.

Die Anleger können börsentäglich die Rücknahme der Anteile verlangen. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Rücknahme aussetzen oder einschränken, wenn außergewöhnliche Umstände dies zur Wahrnehmung der Anlegerinteressen erforderlich erscheinen lassen. Setzt die Verwaltungsgesellschaft die Rücknahme von Anteilen ganz oder teilweise aus und lehnt daher die Rücknahme der Anteile ganz (Rücknahmeaussetzung) oder teilweise (Rücknahmebeschränkung) ab, kann dies dazu führen, dass der Auftrag ganz zu einem späteren Zeitpunkt ausgeführt wird oder dass ein Auftrag in Höhe seines nicht ausgeführten Anteils erlischt.

### Wichtige Kennzahlen

#### Deka-BasisAnlage konservativ

Performance*	6 Monate
	-1,7%
ISIN	DE000DK2CFP1

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

# Deka-BasisAnlage konservativ

## Vermögensübersicht zum 31. März 2022.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>33.367.600,00</b>	<b>5,27</b>
Deutschland	33.367.600,00	5,27
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>531.390.801,09</b>	<b>83,82</b>
Deutschland	173.614.775,84	27,40
Frankreich	42.349.825,42	6,68
Irland	42.659.510,72	6,71
Luxemburg	266.422.327,11	42,03
Österreich	6.344.362,00	1,00
<b>3. Zertifikate</b>	<b>56.289.292,94</b>	<b>8,88</b>
Deutschland	18.437.705,00	2,91
Irland	37.851.587,94	5,97
<b>4. Derivate</b>	<b>-680.655,53</b>	<b>-0,11</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>13.400.982,56</b>	<b>2,11</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>11.614.485,48</b>	<b>1,83</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-11.396.709,19</b>	<b>-1,80</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>633.985.797,35</b>	<b>100,00</b>

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>33.367.600,00</b>	<b>5,27</b>
EUR	33.367.600,00	5,27
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>531.390.801,09</b>	<b>83,82</b>
EUR	480.890.038,11	75,86
JPY	2.390.657,32	0,38
USD	48.110.105,66	7,58
<b>3. Zertifikate</b>	<b>56.289.292,94</b>	<b>8,88</b>
EUR	56.289.292,94	8,88
<b>4. Derivate</b>	<b>-680.655,53</b>	<b>-0,11</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>13.400.982,56</b>	<b>2,11</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>11.614.485,48</b>	<b>1,83</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-11.396.709,19</b>	<b>-1,80</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>633.985.797,35</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-BasisAnlage konservativ

## Vermögensaufstellung zum 31. März 2022.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>37.851.587,94</b>	<b>5,97</b>
<b>Zertifikate</b>								<b>37.851.587,94</b>	<b>5,97</b>
<b>EUR</b>								<b>37.851.587,94</b>	<b>5,97</b>
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18		STK	367.318	24.700	134.500	EUR 68,569	25.186.627,94	3,97
XS2183935274	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 20/00		STK	257.000	267.000	170.500	EUR 49,280	12.664.960,00	2,00
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>18.437.705,00</b>	<b>2,91</b>
<b>Zertifikate</b>								<b>18.437.705,00</b>	<b>2,91</b>
<b>EUR</b>								<b>18.437.705,00</b>	<b>2,91</b>
DE000DK046H2	DekaBank Dt.Girozent. Al-Bon.-Zert.Cap. 22/22		STK	1.566.500	1.566.500	0	EUR 11,770	18.437.705,00	2,91
<b>Neuemissionen</b>								<b>33.367.600,00</b>	<b>5,27</b>
<b>Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen</b>								<b>33.367.600,00</b>	<b>5,27</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>33.367.600,00</b>	<b>5,27</b>
<b>EUR</b>								<b>33.367.600,00</b>	<b>5,27</b>
DE000DK04AA0	7,5500 % DekaBank Dt.Girozentrale Exp-Akt-Anl.PI 21/22		EUR	34.000.000	34.000.000	0	% 98,140	33.367.600,00	5,27
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>531.390.801,09</b>	<b>83,82</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>224.055.343,04</b>	<b>35,38</b>
<b>EUR</b>								<b>224.055.343,04</b>	<b>35,38</b>
DE000DK1CJZ4	Deka Bund + S Finanz: 7-15 I		ANT	313.929	18.800	17.500	EUR 103,370	32.450.840,73	5,13
DE000ETFL177	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany UCITS ETF		ANT	23.178	0	3.500	EUR 95,112	2.204.505,94	0,35
DE000ETFL185	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 1-3 UCITS ETF		ANT	169.023	0	5.000	EUR 76,595	12.946.316,69	2,04
DE000ETFL193	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 3-5 UCITS ETF		ANT	89.385	0	7.600	EUR 92,638	8.280.447,63	1,31
DE000ETFL201	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 5-10 UCITS ETF		ANT	271.202	99.400	15.300	EUR 117,375	31.832.334,75	5,03
DE000ETFL599	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	59.000	59.000	0	EUR 93,828	5.535.852,00	0,87
DE000ETFL565	Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	206.000	230.000	24.000	EUR 14,478	2.982.468,00	0,47
DE000ETFL318	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	471.174	503.700	195.526	EUR 8,534	4.020.998,92	0,63
DE000ETFL573	Deka MSCI USA Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	294.998	223.700	68.200	EUR 37,190	10.970.975,62	1,73
LU0133819333	Deka US Treasury 7-10 UCITS ETF		ANT	108.199	108.199	0	EUR 58,630	6.343.707,37	1,00
DE000ETFL524	Deka US Treasury 7-10 UCITS ETF		ANT	20.710	400	1.900	EUR 896,040	18.556.988,40	2,93
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial I (A)		ANT	20.819	7.500	7.400	EUR 215,110	4.478.375,09	0,71
LU0249486092	Deka-FlexZins CF		ANT	10.300	1.500	15.300	EUR 954,150	9.827.745,00	1,55
LU0851807460	Deka-Globale Aktien LowRisk I (A)		ANT	57.064	5.450	12.000	EUR 227,830	13.000.891,12	2,05
DE0007019416	Deka-Institutionell Renten Europa		ANT	48.541	0	0	EUR 67,990	3.300.302,59	0,52
LU0297135294	Deka-OptiRent 3y CF		ANT	281.244	0	0	EUR 118,940	33.451.161,36	5,29
DE0009771824	Deka-VarioInvest TF		ANT	75.600	24.000	222.000	EUR 63,840	4.826.304,00	0,76
LU1440686027	Deka-ZielKonzept CF (A)		ANT	16.139	1.550	40.280	EUR 976,970	15.767.318,83	2,49
DE000A1JSHJ5	Weltzins-INVEST (I)		GRUPPENFREMDE	145.100	145.100	0	EUR 22,590	3.277.809,00	0,52
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>307.335.458,05</b>	<b>48,44</b>
<b>EUR</b>								<b>256.834.695,07</b>	<b>40,48</b>
DE000A2H5XY6	7orca Vega Return Inhaber-Anteilsklasse I		ANT	63.300	66.500	3.200	EUR 95,200	6.026.160,00	0,95
LU1136108757	AGIF-Allianz Euro Credit SRI Inh. Anteile WT		ANT	5.415	475	2.580	EUR 1.056,560	5.721.272,40	0,90
LU1220060260	AXA Wld Fds-Euro Credit Plus Namens-Ant. I Dis.		ANT	58.024	4.000	0	EUR 100,330	5.821.547,92	0,92
LU0368229703	BGF - Euro Bond Fund Actions Nominatives I2		ANT	217.386	217.386	0	EUR 14,390	3.128.184,54	0,49
LU1373033965	BGF-Euro Corporate Bond Fund Act. Nominatives I2		ANT	529.205	49.400	250.000	EUR 11,050	5.847.715,25	0,92
LU1435395980	BlackRock Str.-BIR.ESG Euro Bd Action Nom.I2 Acc.		ANT	32.967	0	0	EUR 99,420	3.277.579,14	0,52
LU0438336264	BlackRock Str.F-Fxd Inc.Str.Fd Act. Nom. A		ANT	168.403	0	13.800	EUR 121,320	20.430.651,96	3,22
LU0131211178	BNP Paribas Euro Corporate Bd Act.Nom. Cap. I		ANT	33.210	2.510	0	EUR 210,340	6.985.391,40	1,10
FR0010813105	Candriam Diversified Fut. Act. Port. I Cap. 3 Déc.		ANT	775	0	105	EUR 13.116,200	10.165.055,00	1,60
FR0011510023	Candriam Index Arbitrage Act.au Port.V 3 Déc.		ANT	16.703	0	1.700	EUR 1.074,160	17.941.694,48	2,83
FR0013353786	Candriam Risk Arbitrage Act. au Port. I2 3D Acc.		ANT	3.167	3.167	0	EUR 1.512,820	4.791.100,94	0,76
DE000DWS17Z6	Deutsche Extra Bond Tot.Return FD		ANT	126.587	0	0	EUR 50,310	6.368.591,97	1,00
AT0000A1PY56	ERSTE RESPONSIBLE BD EMERG.CO. Inh.-Ant. I A ANT		ANT	67.400	35.400	0	EUR 94,130	6.344.362,00	1,00
LU0335991534	Eurizon Fd-Bond High Yield Reg.Units Z		ANT	9.500	3.000	13.200	EUR 264,590	2.513.605,00	0,40

# Deka-BasisAnlage konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
LU0957027591	Fidelity Fds-Eur.High Yield Fd Reg.Shares I Acc.		ANT	15.820	6.500	19.400	EUR 138,629	2.193.110,78	0,35
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.		ANT	164.406	75.000	119.011	EUR 19,500	3.205.917,00	0,51
IE00BFYV9M80	Guinness A.M.Fds-G.Sust.Energy Reg.Shs Z Acc.		ANT	89.690	89.690	0	EUR 23,348	2.094.064,18	0,33
FR0010757831	Helium Opportunités Act. au Porteur A 3 Déc.		ANT	6.350	6.800	450	EUR 1.488,500	9.451.975,00	1,49
LU0404498767	HSBC GIF-Euro High Yield Bond X (Cap.)		ANT	57.496	15.000	87.100	EUR 50,898	2.926.431,41	0,46
IE00B3VWN393	iShs VII-\$ Trsy Bd 3-7yr U.ETF Reg.Shares		ANT	159.900	8.300	23.000	EUR 117,930	18.857.007,00	2,97
LU2051469976	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. S2		ANT	12.596	10.800	33.204	EUR 117,230	1.476.629,08	0,23
LU2051470040	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. S2 Dis.		ANT	152	75	288	EUR 10.904,600	1.657.499,20	0,26
LU1529809490	JPM.Fds-Europe Sustainable Eq. Act. Nom. S2(acc)		ANT	32.013	12.650	25.437	EUR 102,220	3.272.368,86	0,52
LU0986646882	Kempen I.F.-K.(L.)EO Sus.Cred. I Acc.		ANT	5.913	420	0	EUR 990,980	5.859.664,74	0,92
DE000A2QDRK7	LBBW Renten Short Term Nachha. I		ANT	202.690	202.690	0	EUR 98,840	20.033.879,60	3,16
LU0360481153	Mor.St.Inv.-Eur.High Yield Bd Actions Nom. Z		ANT	35.586	14.000	44.600	EUR 59,890	2.131.245,54	0,34
LU0360477631	Mor.St.Inv.-Euro Bond Fund Actions Nom. Z		ANT	82.310	0	0	EUR 40,350	3.321.208,50	0,52
IE00051PE6L2	NBIF-Neu.Ber.Eur.Su.Eq. Reg.Shs I3 Dis.		ANT	226.500	226.500	0	EUR 9,060	2.052.090,00	0,32
LU0834815101	OptoFlex I		ANT	4.750	0	0	EUR 1.506,840	7.157.490,00	1,13
LU1293075013	Schroder ISF-EURO Cred.Abs.Rt. IZ Acc.		ANT	96.320	0	2.900	EUR 112,205	10.807.575,97	1,70
LU2016215001	Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.		ANT	489.516	23.000	540.000	EUR 12,675	6.204.762,15	0,98
LU2080996049	SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. IZ Acc.		ANT	57.451	57.451	0	EUR 100,727	5.786.843,90	0,91
IE00BKWQ0H23	SPDR MSCI Eur.Health Care UETF Reg.Shares		ANT	16.321	21.500	5.179	EUR 195,580	3.192.061,18	0,50
LU1849560120	Threadneedle L-Credit Opport. Act.N. 2E Acc. (INE)		ANT	693.000	0	81.000	EUR 10,094	6.995.003,40	1,10
LU0569864134	UBAM-Global High Yield Solut. Inhaber-Ant. IH Dis.		ANT	100.936	34.000	0	EUR 98,030	9.894.756,08	1,56
LU1974696418	UBS(L)FS-JPM DL EM IG ESG D.B. Act. Nom. H A Acc.		ANT	567.000	567.000	0	EUR 11,349	6.434.599,50	1,01
LU1925065655	Vontobel Fd-TwentyFour A.R.Cr. Act.Nom.HGCap.		ANT	160.000	0	3.000	EUR 102,910	16.465.600,00	2,60
<b>JPY</b>								<b>2.390.657,32</b>	<b>0,38</b>
LU1013116519	Alma C.I.F.-A.Ei.J.L.Cap Eq Fd Nam.-An.I Cap.		ANT	9.020	12.400	3.380	JPY 21.781,000	1.448.426,87	0,23
LU0231474593	AS SICAV I-Japanese Equity Fd Actions Nom. I Acc		ANT	942	1.170	4.800	JPY 135.673,183	942.230,45	0,15
<b>USD</b>								<b>48.110.105,66</b>	<b>7,58</b>
LU1955039745	AAF Parnassus US Sust.Equities Namens-Ant. X1 Acc.		ANT	48.499	30.890	50.857	USD 164,797	7.166.545,35	1,13
LU2146568683	AMUNDI-Pion.US Equ.ESG Improv. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	707	2.010	2.033	USD 1.472,740	933.626,70	0,15
IE00BKZGKY61	Barings U.F.-B.Em.Mkts Loc.Dbt Reg.Shares C Acc.		ANT	144.400	12.900	8.500	USD 93,180	12.064.731,67	1,90
LU1200235437	DPAM L-Bonds Em.Mkts. Sust. Actions au Port.F Acc.		ANT	130.158	0	10.000	USD 119,590	13.957.045,70	2,20
LU1727360171	JPMorgan-US Value Fund Actions Nom. IZ(acc.)		ANT	17.475	68.500	51.025	USD 153,730	2.408.815,74	0,38
IE00BZ1BLN67	LMGF-LM CB US Eq.Sust.Leaders S Acc.		ANT	25.365	27.110	19.755	USD 193,440	4.399.556,69	0,69
LU0474363545	Robeco CGF-R.BP US Lar.Cap Eq. Actions Nom. I		ANT	7.062	11.030	35.668	USD 370,140	2.343.805,14	0,37
LU2099993318	UBS (Lux) Eq.-USA Gr.Sus. DL Act. Nom. s.I-A3 Acc.		ANT	32.669	32.669	0	USD 165,090	4.835.978,67	0,76
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>621.047.694,03</b>	<b>97,97</b>
<b>Derivate</b>	(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
<b>Aktienindex-Derivate</b>	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>-481.387,50</b>	<b>-0,08</b>
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Juni 22	XEUR	EUR	Anzahl -165					-481.387,50	-0,08
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-481.387,50</b>	<b>-0,08</b>
<b>Zins-Derivate</b>	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>-199.268,03</b>	<b>-0,03</b>
US Treasury Long Bond Future (US) Juni 22	XCBT	USD	9.500.000					-199.268,03	-0,03
<b>Summe Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-199.268,03</b>	<b>-0,03</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>									

# Deka-BasisAnlage konservativ

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	4.643.639,04			% 100,000	4.643.639,04	0,73
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	135.559.875,00			% 100,000	999.409,28	0,16
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	8.652.036,16			% 100,000	7.757.934,24	1,22
	<b>Summe Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>13.400.982,56</b>	<b>2,11</b>
	<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>						<b>EUR</b>	<b>13.400.982,56</b>	<b>2,11</b>
	<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								
	Zinsansprüche		EUR	63.295,89				63.295,89	0,01
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	801.041,73				801.041,73	0,13
	Forderungen aus Anteilschneidgeschäften		EUR	37.540,62				37.540,62	0,01
	Forderungen aus Wertpapiergeschäften		EUR	3.515.634,27				3.515.634,27	0,55
	Forderungen aus Devisenspots		EUR	7.194.374,00				7.194.374,00	1,13
	Sonstige Forderungen		EUR	2.598,97				2.598,97	0,00
	<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>11.614.485,48</b>	<b>1,83</b>
	<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneidgeschäften		EUR	-306.479,16				-306.479,16	-0,05
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-3.591.473,92				-3.591.473,92	-0,57
	Verbindlichkeiten aus Devisenspots		EUR	-7.173.279,53				-7.173.279,53	-1,13
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-325.476,58				-325.476,58	-0,05
	<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-11.396.709,19</b>	<b>-1,80</b>
	<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>633.985.797,35</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile</b>						<b>STK</b>	<b>6.181.006,000</b>	
	<b>Anteilwert</b>						<b>EUR</b>	<b>102,57</b>	

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

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.03.2022

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,11525 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	135,64000 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
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>Börsengehandelte Wertpapiere</b>			
	<b>Zertifikate</b>			
	<b>EUR</b>			
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK	44.300	44.300
	<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>			
	<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>			
	<b>EUR</b>			
DE000ETF144	Deka iBoxx EUR Liquid Sovereign Diversified 5-7 UCITS ETF	ANT	0	98.827
DE000ETF540	Deka MSCI Germany Climate Change ESG UCITS ETF	ANT	279.500	1.090.500
	<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>			
	<b>EUR</b>			
LU0840619489	AGIF-Allianz German Equity Inhaber Anteile W	ANT	0	2.635
LU0856992960	AllianzGI Fund-AdvFixIncShoDur Inhaber Anteile W	ANT	0	23.884
LU1322386183	Fidelity Fds-Euro Bond Fund Reg.Shares I Acc.	ANT	0	308.650
LU0616502026	Global Evolution Fds-EM Debt I	ANT	23.700	45.700
IE00B52VJ196	iShsII-MSCI Europe SRI U.ETF Reg.Shs (Acc)	ANT	42.150	42.150
LU1829219390	MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.	ANT	15.509	54.109
LU0555026250	NN (L)- Euro Credit Act. Nom.I CAP	ANT	215	2.786
LU0209860427	Robeco Sust.European Stars Eq. Act. Nom. Cl.I	ANT	2.000	17.983
IE00BG7PPR18	Strate.I.F.U.-Alpine Merg.Arb. Reg.Shares A Acc	ANT	46.500	46.500
IE00BG36TC12	Xtr.(IE)-MSCI Japan ESG UC.ETF Reg.Shares 1C	ANT	0	113.800
	<b>USD</b>			
IE00BMDX0L03	CSIF(IE)ETF-MSCI USA SCELB ETF Reg.Acc.Shs B	ANT	31.000	31.000
IE00B78JSG98	UBS(I)ETF-MSCI USA VALUE U.E. Reg.Shares A Dis.	ANT	3.550	114.950

## Gattungsbezeichnung

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Stück bzw. Anteile bzw. Whg.

Volumen in 1.000



# Deka-BasisAnlage konservativ

<b>Gattungsbezeichnung</b>	<b>Stück bzw. Anteile bzw. Whg.</b>	<b>Volumen in 1.000</b>
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>45.646</b>
(Basiswert(e): DAX Performance-Index, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), MSCI Emerging Markets Index, Nikkei 225 Stock Average Index (JPY), S&P 500 Index)		
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>82.018</b>
(Basiswert(e): Ten-Year US Treasury Note Future (TY))		
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>	<b>EUR</b>	<b>9.575</b>
(Basiswert(e): Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB))		

# Deka-BasisAnlage konservativ

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	6.181.006
Anteilwert	EUR	102,57

### 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 Umsatzzolumina 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 1. April 2022  
Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

16.09.1988

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2020

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 20,7 Mio.

### Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

Dr. Matthias Danne  
Mitglied 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

Serge Demolière, Berlin

Wolfgang Dürr, Trier

Steffen Matthias, Berlin

Victor Moflakhar

Mitglied des Vorstandes der  
Stiftung Fonds zur Finanzierung der kerntechnischen Entsorgung,  
Berlin

### 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;  
Mitglied des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

## Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
The Squaire  
Am Flughafen  
60549 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 2022

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



**Deka Vermögens-  
management GmbH**

Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

Telefon: (0 69) 71 47 - 0  
Telefax: (0 69) 71 47 - 19 39  
[www.deka.de](http://www.deka.de)

 **Finanzgruppe**