

Halbjahresbericht  
zum 31. Januar 2019.  
**Deka-BasisStrategie Aktien**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

31. Januar 2019

## Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deko-BasisStrategie Aktien für den Zeitraum vom 1. August 2018 bis zum 31. Januar 2019.

Die internationalen Kapitalmärkte präsentierten sich im abgelaufenen Berichtshalbjahr in überwiegend schwacher Verfassung: Besonders kräftig fielen die Rückgänge in Europa aus. Hier hinterließen vor allem die zähen Brexit-Verhandlungen sowie der Disput zwischen der EU-Kommission und der italienischen Regierung über die zukünftige Haushaltspolitik deutliche Spuren. Daneben sorgten zum Jahresende 2018 Bedenken über ein Abflauen der Konjunktur zunehmend für Nervosität an den globalen Märkten. Im Laufe des Januar konnten einige Indizes jedoch einen Teil der Verluste wieder aufholen.

An den Rentenmärkten prägten anfangs weiter steigende Renditen das Bild, bevor Ende November Aussagen des Präsidenten der US-amerikanischen Zentralbank, Jerome Powell, für Zweifel am weiteren Verlauf des Zinserhöhungskurses der Fed sorgten. Dies führte im Anschluss zu Kursgewinnen an den Rentenmärkten. Die EZB unterließ es bisher, an der Zinsschraube zu drehen, beschloss jedoch ihr Anleihen-Ankaufprogramm zum Ende des Jahres 2018 auslaufen zu lassen. Die Zinsdifferenz zwischen Euroland-Staatsanleihen und US-Treasuries blieb über den gesamten Berichtszeitraum hinweg signifikant. US-Treasuries mit 10-jähriger Laufzeit rentierten zuletzt bei 2,6 Prozent gegenüber einer Rendite von 0,1 Prozent bei laufzeitgleichen deutschen Bundesanleihen.

Die internationalen Aktienmärkte entwickelten sich in den zurückliegenden sechs Monaten enttäuschend und beendeten den Berichtszeitraum mit merklichen Abschlägen. In Europa wies der EURO STOXX 50 sowie der DAX kräftige Rückgänge auf. Die US-Aktienbörsen wie auch ihre Pendants in Hongkong und Tokio schlugen sich etwas besser, wenngleich auch sie per saldo auf negativem Terrain landeten.

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.

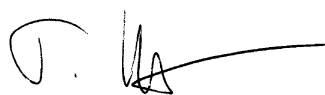
Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilhaber im Internet unter [www.deka.de](http://www.deka.de) bekannt werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informationsangebot rund um das Thema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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



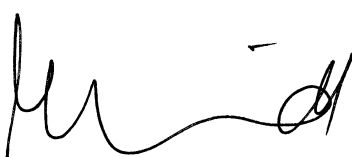
Stefan Keitel (Vorsitzender)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 31. Januar 2019	6
Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2019	7
Anhang	12
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	14

**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-BasisStrategie Aktien Anlagepolitik.

Der Fonds Deka-BasisStrategie Aktien verfolgt das Ziel eines mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachses durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Mit diesem verfolgt das Fondsmanagement die Strategie, weltweit in Aktien von Unternehmen zu investieren. Der Aktienanteil wird aktiv gesteuert und kann bis auf 61 Prozent des Fondsvermögens reduziert werden. Bei der Titelauswahl wird neben der Einzeltitelanalyse auch berücksichtigt, welcher Anlagestil im herrschenden Marktumfeld besonders aussichtsreich ist. Um den Erfolg des Aktienauswahlprozesses zu bewerten, wird der Index 80 Prozent MSCI World, 20 Prozent EONIA verwendet.<sup>1)</sup> Weiterhin können in von einem Basiswert abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) getätigt werden. In Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland dürfen mehr als 35 Prozent des Sondervermögens angelegt werden.

In den vergangenen sechs Monaten zeigten sich die Aktienmärkte in deutlich belasteter und volatiler Verfassung. Nach einem schwachen Jahresende 2018 konnten die Börsen im Januar nur einen Teil der Rückgänge aufholen.

Das Fondsmanagement richtete bei der Branchenauswahl den Fokus u.a. auf den Medien-Sektor, dessen Anteil merklich aufgestockt wurde. Daneben lagen weiterhin Schwerpunkte auf den Bereichen Investitionsgüter, Pharma und Energie. Zurückhaltender wurde beispielsweise die Branche Software berücksichtigt, deren Gewichtung im Berichtsverlauf merklich sank. Insgesamt ergab sich die Positionierung vor allem aus Einzeltitelüberlegungen.

Aus Regionensicht blieben die USA mit Abstand am höchsten gewichtet gefolgt von Frankreich, Japan und Deutschland.

Zum Ende des Berichtszeitraums war der Fonds mit 87,3 Prozent des Fondsvermögens in Aktien investiert. Durch den Einsatz von Aktien-Derivaten verringerte sich die Netto-Aktienquote um 5,6 Prozentpunkte. Zur Steuerung der Währungspositionierung kamen zudem Devisenterminkontrakte zum Einsatz. Ziel des Währungsmanagements war es im Fonds eine konstante Mischung von Fremdwährungen abzubilden, unabhängig davon wie einzelne Währungsräume durch Aktien vertreten sind.

In der Berichtsperiode verzeichnete der Deka-BasisStrategie Aktien eine Wertminderung um 6,6 Prozent (Anteilklasse CF (A)).

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-BasisStrategie Aktien

Performance *	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Anteilklasse CF (A)	-6,6%	-3,7%	5,6%

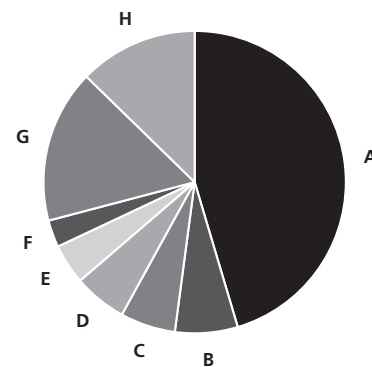
### ISIN

Anteilklasse CF (A)	DE000DK2EAG7
---------------------	--------------

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

## Fondsstruktur

### Deka-BasisStrategie Aktien



<b>A</b> USA	45,4%
<b>B</b> Frankreich	6,7%
<b>C</b> Japan	5,9%
<b>D</b> Deutschland	5,7%
<b>E</b> Großbritannien	4,3%
<b>F</b> Kanada	2,9%
<b>G</b> Sonstige Länder	16,4%
<b>H</b> Barreserve, Sonstiges	12,7%

Geringfügige Abweichungen zur Vermögensaufstellung des Berichts resultieren aus der Zuordnung von Zins- und Dividendenansprüchen zu den jeweiligen Wertpapieren sowie aus rundungsbedingten Differenzen.

1) Referenzindex: 80% MSCI World, 20% EONIA: Der oben genannte Index ist eine eingetragene Marke. Der Fonds wird vom Lizenzgeber nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt. Die Berechnung und Lizenzierung des Index bzw. der Index-Marke stellt keine Empfehlung der Kapitalanlage dar. Der Lizenzgeber haftet gegenüber Dritten nicht für etwaige Fehler im Index.

# Deka-BasisStrategie Aktien

## Vermögensübersicht zum 31. Januar 2019.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>16.855.389,64</b>	<b>86,14</b>
Australien	186.047,78	0,95
Bermuda	178.281,97	0,91
China	488.439,43	2,50
Dänemark	90.407,93	0,46
Deutschland	1.121.028,00	5,72
Finnland	115.560,00	0,59
Frankreich	1.304.241,50	6,65
Großbritannien	836.336,66	4,28
Irland	345.634,90	1,77
Israel	193.064,44	0,99
Italien	280.890,00	1,44
Japan	1.150.974,79	5,87
Kaiman-Inseln	206.474,48	1,05
Kanada	558.079,61	2,86
Malta	100.870,81	0,52
Niederlande	491.100,87	2,51
Österreich	92.235,00	0,47
Portugal	149.380,00	0,76
Schweiz	86.404,17	0,44
USA	8.879.937,30	45,40
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>207.243,33</b>	<b>1,06</b>
Schweiz	207.243,33	1,06
<b>3. Derivate</b>	<b>26.462,96</b>	<b>0,13</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>2.655.423,29</b>	<b>13,56</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>90.091,81</b>	<b>0,46</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-263.907,93</b>	<b>-1,35</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>19.570.703,10</b>	<b>100,00</b>

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>16.855.389,64</b>	<b>86,14</b>
AUD	186.047,78	0,95
CAD	558.079,61	2,86
CHF	86.404,17	0,44
DKK	90.407,93	0,46
EUR	3.506.919,50	17,90
GBP	981.109,42	5,02
HKD	762.675,06	3,90
JPY	1.150.974,79	5,87
SEK	100.870,81	0,52
USD	9.431.900,57	48,22
<b>2. Sonstige Wertpapiere</b>	<b>207.243,33</b>	<b>1,06</b>
CHF	207.243,33	1,06
<b>3. Derivate</b>	<b>26.462,96</b>	<b>0,13</b>
<b>4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>2.655.423,29</b>	<b>13,56</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>90.091,81</b>	<b>0,46</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-263.907,93</b>	<b>-1,35</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>19.570.703,10</b>	<b>100,00</b>

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





# Deka-BasisStrategie Aktien

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
	DJ Stoxx 600 Future (FXXP) März 19	XEUR	EUR	Anzahl -55				-25.225,00	-0,13	
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>-25.225,00</b>	<b>-0,13</b>
<b>Devisen-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>										
<b>Offene Positionen</b>								<b>16.541,18</b>	<b>0,09</b>	
	AUD/EUR 309.000,00		OTC					755,92	0,00	
	CAD/EUR 434.047,00		OTC					1.988,38	0,01	
	CHF/EUR 295.517,00		OTC					-2.134,71	-0,01	
	DKK/EUR 221.665,00		OTC					6,33	0,00	
	GBP/EUR 171.054,00		OTC					1.869,25	0,01	
	HKD/EUR 611.000,00		OTC					-215,57	0,00	
	ILS/EUR 54.495,00		OTC					217,44	0,00	
	JPY/EUR 99.274.712,00		OTC					15.274,42	0,08	
	NOK/EUR 361.136,00		OTC					358,20	0,00	
	SEK/EUR 1.002.432,00		OTC					-680,14	0,00	
	SGD/EUR 132.318,00		OTC					1.436,67	0,01	
	USD/EUR 662.100,00		OTC					-2.335,01	-0,01	
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>36.279,98</b>	<b>0,18</b>	
<b>Offene Positionen</b>										
	CAD/EUR 482.520,00		OTC					-1.850,34	-0,01	
	CHF/EUR 186.000,00		OTC					1.322,01	0,01	
	CHF/USD 428.010,03		OTC					34.853,17	0,18	
	DKK/EUR 234.755,00		OTC					26,18	0,00	
	GBP/EUR 85.075,00		OTC					-324,07	0,00	
	HKD/EUR 5.488.892,00		OTC					3.882,81	0,02	
	JPY/EUR 26.250.000,00		OTC					-5.592,81	-0,03	
	SEK/EUR 682.000,00		OTC					385,98	0,00	
	USD/EUR 804.500,00		OTC					3.577,05	0,01	
<b>Summe Devisen-Derivate</b>								<b>EUR</b>	<b>52.821,16</b>	<b>0,27</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.903.279,27			%	100,000	1.903.279,27	9,72
<b>EUR-Guthaben bei</b>										
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	585.810,09			%	100,000	585.810,09	2,99
	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-		EUR	0,29			%	100,000	0,29	0,00
	Sparkasse KölnBonn		EUR	100.000,02			%	100,000	100.000,02	0,51
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	0,31			%	100,000	0,04	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	1.458,00			%	100,000	1.665,32	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	0,05			%	100,000	0,01	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	6.307,73			%	100,000	3.988,89	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	64.916,41			%	100,000	56.891,82	0,29
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	4.352,45			%	100,000	3.787,54	0,02
<b>Summe Bankguthaben</b>								<b>EUR</b>	<b>2.655.423,29</b>	<b>13,56</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR</b>	<b>2.655.423,29</b>	<b>13,56</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
	Dividendenansprüche		EUR	11.610,72				11.610,72	0,06	
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	64.253,30				64.253,30	0,33	
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	21,22				21,22	0,00	
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	2.854,80				2.854,80	0,01	
	Forderungen aus Quellensteuerrückstattung		EUR	11.351,77				11.351,77	0,06	
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR</b>	<b>90.091,81</b>	<b>0,46</b>
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>										
<b>Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	-0,74			%	100,000	-0,07	0,00
<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>								<b>EUR</b>	<b>-0,07</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-4,56				-4,56	0,00	
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-237.849,42				-237.849,42	-1,22	
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-26.053,88				-26.053,88	-0,13	
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR</b>	<b>-263.907,86</b>	<b>-1,35</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>19.570.703,10</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile Klasse CF (A)</b>								<b>STK</b>	<b>163.470.000</b>	
<b>Anteilwert Klasse CF (A)</b>								<b>EUR</b>	<b>119,72</b>	

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



# Deka-BasisStrategie Aktien

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
------	---------------------	-------	------------------------------	--------------------	------------------------------------	-------------------	------	-----------------	-------------------------

- 1) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.  
 2) Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
<b>Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)</b>				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
Newmont Mining Corp. Reg.Shares	STK 3.000		88.004,18	
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>	<b>EUR</b>		<b>88.004,18</b>	<b>88.004,18</b>

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.01.2019

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87551 = 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,46450 = 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,66835 = 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	10,36965 = 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,14105 = 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,14915 = 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,50948 = 1 Euro (EUR)
Israel, Schechel	(ILS)	4,19095 = 1 Euro (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,54690 = 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	124,95000 = 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	9,01555 = 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,58133 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

XEUR Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

### OTC

Over-the-Counter

## 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>Aktien</b>				
<b>AUD</b>				
PG0008579883	Oil Search Ltd. Reg.Shares	STK	0	25.000
<b>CAD</b>				
CA05534B7604	BCE Inc. Reg.Shares new	STK	0	4.500
CA3809564097	Goldcorp Inc. Reg.Shares	STK	0	4.000
<b>CHF</b>				
AT0000A18XM4	ams AG Inhaber-Aktien	STK	1.200	2.500
CH0435377954	SIG Combibloc Services AG Namens-Aktien	STK	7.875	7.875
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien	STK	0	2.000
<b>DKK</b>				
DK0060252690	Pandora A/S Navne-Aktier	STK	0	1.500
<b>EUR</b>				
FR0000051732	Atos SE Actions au Porteur	STK	0	1.000
DE000BAY0017	Bayer AG Namens-Aktien	STK	0	1.220
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien	STK	0	2.800
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK	0	9.000
ES0118900010	Ferrovial S.A. Acciones Port.	STK	275	12.111
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien	STK	0	1.500
DE000A13SX22	HELLA GmbH & Co. KGaA Inhaber-Aktien	STK	0	3.000
FR0010411983	SCOR SE Actions au Porteur	STK	0	6.000
NL0011821392	Signify N.V. Reg.Shares	STK	0	5.510
<b>GBP</b>				
GB0000566504	BHP Group PLC Reg.Shares	STK	0	800
IE0002424939	DCC PLC Reg.Shares	STK	1.530	1.530
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC Reg.Shares	STK	0	70.000
<b>HKD</b>				
HK0941009539	China Mobile Ltd. Reg.Shares	STK	0	15.000
<b>JPY</b>				
JP3167430002	MTG Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	300
JP3732000009	SoftBank Corp. Reg.Shares	STK	18.000	18.000
<b>USD</b>				
US90130A2006	21st Century Fox Inc. Reg.Shares B	STK	5.000	5.000
US00434H1086	Accelaron Pharma Inc. Reg.Shares	STK	0	3.000
US1255091092	CIGNA Corp. Reg.Shares	STK	1.250	1.250

# Deka-BasisStrategie Aktien

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US2566771059	Dollar General Corp. (New) Reg.Shares	STK	0	1.700
US30219G1085	Express Scripts Holding Inc. Reg.Shares	STK	0	2.600
US45866F1049	Intercontinental Exchange Inc. Reg.Shares	STK	0	2.000
US68389X1054	Oracle Corp. Reg.Shares	STK	0	5.000
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares	STK	0	2.500
US8485771021	Spirit Airlines Inc. Reg.Shares	STK	0	3.200
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares	STK	0	2.000
<b>Andere Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
ES06189009C8	Ferrovial S.A. Anrechte	STK	11.836	11.836
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>GBP</b>				
JE00B2QKY057	Shire PLC Reg.Shares	STK	0	3.000

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>	<b>EUR</b>	<b>471</b>
(Basiswert(e): STXE 600 Index (Price) (EUR))		
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	EUR	160
CAD/EUR	EUR	399
CHF/EUR	EUR	1.061
CHF/JPY	EUR	410
DKK/EUR	EUR	33
GBP/EUR	EUR	258
HKD/EUR	EUR	566
ILS/EUR	EUR	26
JPY/EUR	EUR	1.503
NOK/EUR	EUR	74
SEK/EUR	EUR	201
SGD/EUR	EUR	168
USD/EUR	EUR	855
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
AUD/EUR	EUR	78
CAD/EUR	EUR	569
CHF/EUR	EUR	984
DKK/EUR	EUR	63
GBP/EUR	EUR	4
HKD/EUR	EUR	1.048
ILS/EUR	EUR	13
JPY/EUR	EUR	1.346
NOK/EUR	EUR	37
SEK/EUR	EUR	133
SGD/EUR	EUR	83
USD/EUR	EUR	444
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
<b>unbefristet</b>	<b>EUR</b>	<b>1.291</b>
(Basiswert(e): ams AG Inhaber-Aktien, AT & T Inc. Reg.Shares, Facebook Inc. Reg.Shares Cl.A, Johnson & Johnson Reg.Shares, Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine, The Home Depot Inc. Reg.Shares)		

# Deka-BasisStrategie Aktien

## Anhang.

Umlaufende Anteile Klasse CF (A)	STK	163.470,000
Anteilwert Klasse CF (A)	EUR	119,72

### 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 / Investmentanteile

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzumina 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, z.B. Broker-Quotes, zugrunde gelegt, welche sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Investmentanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs bewertet.

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

Verzinsliche Wertpapiere, rentenähnliche Genussscheine, Zertifikate und Schuldscheindarlehen, 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 mittels externer Modellkurse, z.B. Broker-Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.

#### Bankguthaben

Der Wert von Bankguthaben, Einlagezertifikaten und ausstehenden Forderungen, Bardividenden und Zinsansprüchen entspricht grundsätzlich dem jeweiligen nominalen Betrag.

#### 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. Die Bewertung von 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, erfolgt anhand von Fair Values, 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.

#### 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)

#### Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Aktien	88.004,18	0,45

#### 10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	88.004,18	Deutschland

#### Art(en) von Abwicklung/Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)

Die Abwicklung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erfolgt über einen zentralen Kontrahenten (Organisiertes Wertpapier-Darlehenssystem), per bilateralem Geschäft (Principal-Geschäfte) oder trilateral (Agency-Geschäfte). Total Return Swaps werden als bilaterales OTC-Geschäft abgeschlossen.

#### Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	88.004,18

#### Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen an einem geregelten Markt in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder an einer Börse in einem Mitgliedstaat der OECD notiert sein oder gehandelt werden und in einem wichtigen Index enthalten sein.

Von den Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten sowie ggf. nach Restlaufzeit variieren. Die Haircuts fallen für die aufgeführten Wertpapierkategorien wie folgt aus:

- Bankguthaben 0%
- Aktien 5% - 40%
- Renten 0,5% - 30%

Darüber hinaus kann für Sicherheiten in einer anderen Währung als der Fondswährung ein zusätzlicher Wertabschlag von bis zu 10%-Punkten angewandt werden. In besonderen Marktsituationen (z.B. Marktturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

#### Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen  
EUR

#### Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
unbefristet	201.589,40

#### Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	56,90	100,00
Kostenanteil des Fonds	12,23	21,49
Ertragsanteil der KVG	12,23	21,49

# Deka-BasisStrategie Aktien

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften gerechnet.

Der Ertragsanteil der KVG entspricht maximal dem Kostenanteil des Fonds. Der Kostenanteil der KVG ist auf Ebene des Sondervermögens im Einzelnen nicht bestimmbar.

Geschäftsbedingt gibt es bei Principalgeschäften keine expliziten Kosten durch Dritte. Sofern diese Geschäfte getätigt werden, sind Ertrags- und Kostenanteile Dritter über die in den Wertpapierleiheansätzen enthaltenen Margen abgedeckt und damit bereits im Ertragsanteil des Fonds berücksichtigt. Bei Agencygeschäften werden Erträge und Kosten Dritter über eine Gebührenaufteilung (Fee split) definiert. Hier beträgt der Ertragsanteil des Agenten zwischen 20% und 35% vom Bruttoleiheansatz.

Kosten Dritter als Agent der KVG werden nicht auf Ebene des Sondervermögens offengelegt.

## **Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)**

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

## **Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds**

0,52% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

## **Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps**

<b>Wertpapier-Darlehen</b>	<b>absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR</b>
FMS Wertmanagement	201.589,40

## **Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps**

Eine Wiederanlage von Sicherheiten liegt nicht vor.

## **Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps**

Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer	1
Clearstream Banking Frankfurt	201.589,40 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

Eine Zuordnung der Kontrahenten zu den erhaltenen Sicherheiten ist auf Geschäftsartenebenen durch die Globalbesicherung im Einzelnen bei Total Return Swaps nicht möglich. Der ausgewiesene Wert enthält daher ausdrücklich keine Total Return Swaps, diese sind innerhalb der Globalbesicherung jedoch ausreichend besichert.

## **Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps**

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten/Depots	0,00%
Sammelkonten/Depots	0,00%
andere Konten/Depots	0,00%
Verwahrt bestimmt Empfänger	0,00%

Da eine Zuordnung begebener Sicherheiten bei Total Return Swaps auf Geschäftsartenebene durch die Globalbesicherung im Einzelnen nicht möglich ist, erfolgt der %-Ausweis für die Verwahrarten ohne deren Berücksichtigung.

---

Frankfurt am Main, den 1. Februar 2019

Deka Investment GmbH

Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## **Verwaltungsgesellschaft**

Deka Investment GmbH  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

### **Rechtsform**

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### **Sitz**

Frankfurt am Main

### **Gründungsdatum**

17. Mai 1995; die Gesellschaft übernahm das Investmentgeschäft der am 17. August 1956 gegründeten Deka Deutsche Kapitalanlagegesellschaft mbH.

### **Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2017**

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.

### **Alleingesellschafterin**

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main

## **Aufsichtsrat**

### **Vorsitzender**

Michael Rüdiger  
Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;  
Mitglied des Aufsichtsrates der Deka Immobilien GmbH,  
Frankfurt am Main

### **Stellvertretende Vorsitzende**

Manuela Better  
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;  
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
Deka Immobilien GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main  
und der  
WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf  
und der  
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Verwaltungsrates der  
DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A., Luxemburg;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,  
Wiesbaden

## **Mitglieder**

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der  
Ostsächsischen Sparkasse Desden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der  
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

### **Geschäftsführung**

Stefan Keitel (Vorsitzender)  
Mitglied des Aufsichtsrates der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Thomas Ketter  
Stellvertretender Vorsitzender des Verwaltungsrates der  
Deka International S.A., Luxemburg  
und der  
International Fund Management S.A., Luxemburg

Dr. Ulrich Neugebauer  
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,  
Köln  
und der  
Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln  
und der  
Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

Michael Schmidt

Thomas Schneider  
Mitglied der Geschäftsführung der  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,  
Luxemburg  
Mitglied des Aufsichtsrates der  
International Fund Management S.A., Luxemburg

## **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. Januar 2019

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



**Deka Investment 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)