

Halbjahresbericht  
zum 31. März 2024.

## **Deka-BasisAnlage moderat**

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 moderat 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.

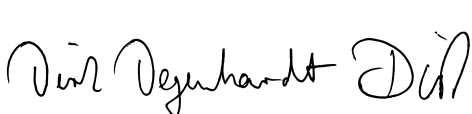
An den Aktienmärkten spiegelten sich ab November die Zinssenkungserwartungen in signifikanten Kursanstiegen wider, sodass die wichtigsten Aktienindizes im Berichtszeitraum mehrheitlich erfreuliche Zuwächse verzeichneten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten auf ein 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

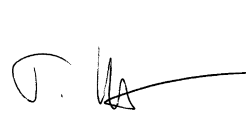
Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung



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 moderat

## 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 40 % 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 moderat

Performance*	6 Monate
	7,5%
ISIN	DE000DK2CFQ9

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

# Deka-BasisAnlage moderat

## Vermögensübersicht zum 31. März 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>12.985.050,00</b>	<b>0,84</b>
Deutschland	12.985.050,00	0,84
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>1.322.575.013,24</b>	<b>85,85</b>
Deutschland	525.083.030,16	34,09
Irland	187.702.176,76	12,18
Luxemburg	581.900.292,84	37,77
Österreich	27.889.513,48	1,81
<b>3. Zertifikate</b>	<b>125.355.387,30</b>	<b>8,15</b>
Irland	125.355.387,30	8,15
<b>4. Derivate</b>	<b>592.479,57</b>	<b>0,03</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>78.991.211,26</b>	<b>5,13</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>1.984.368,46</b>	<b>0,13</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-2.035.477,91</b>	<b>-0,13</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>1.540.448.031,92</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>12.985.050,00</b>	<b>0,84</b>
EUR	12.985.050,00	0,84
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>1.322.575.013,24</b>	<b>85,85</b>
EUR	1.230.519.378,89	79,88
USD	92.055.634,35	5,97
<b>3. Zertifikate</b>	<b>125.355.387,30</b>	<b>8,15</b>
EUR	125.355.387,30	8,15
<b>4. Derivate</b>	<b>592.479,57</b>	<b>0,03</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>78.991.211,26</b>	<b>5,13</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>1.984.368,46</b>	<b>0,13</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-2.035.477,91</b>	<b>-0,13</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>1.540.448.031,92</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-BasisAnlage moderat

## 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>138.340.437,30</b>	<b>8,99</b>	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>12.985.050,00</b>	<b>0,84</b>	
<b>EUR</b>								<b>12.985.050,00</b>	<b>0,84</b>	
DE0001135366	4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 08/40		EUR	10.000.000	2.500.000	7.500.000	%	129,851	12.985.050,00	0,84
<b>Zertifikate</b>								<b>125.355.387,30</b>	<b>8,15</b>	
<b>EUR</b>								<b>125.355.387,30</b>	<b>8,15</b>	
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18		STK	297.000	297.000	0	EUR	80,448	23.893.056,00	1,55
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00		STK	122.900	132.000	9.100	EUR	195,210	23.991.309,00	1,56
XS2183935274	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 20/00		STK	1.471.155	237.800	936.645	EUR	52,660	77.471.022,30	5,04
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>1.322.575.013,24</b>	<b>85,85</b>	
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>577.233.545,98</b>	<b>37,48</b>	
<b>EUR</b>								<b>577.233.545,98</b>	<b>37,48</b>	
DE000DK1CJZ4	Deka Bund + S Finanz: 7-15 I		ANT	891.011	0	0	EUR	88,970	79.273.248,67	5,16
DE000ETFL177	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany UCITS ETF		ANT	311.956	0	34.400	EUR	88,570	27.629.942,92	1,79
DE000ETFL219	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 10+ UCITS ETF		ANT	56.084	1.800	5.000	EUR	111,180	6.235.419,12	0,40
DE000ETFL185	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 1-3 UCITS ETF		ANT	763.866	7.500	39.500	EUR	74,546	56.943.154,84	3,70
DE000ETFL193	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 3-5 UCITS ETF		ANT	130.221	0	11.000	EUR	87,768	11.429.236,73	0,74
DE000ETFL201	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 5-10 UCITS ETF		ANT	451.695	0	25.700	EUR	105,850	47.811.915,75	3,10
DE000ETFL599	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	189.378	27.878	14.500	EUR	88,670	16.792.147,26	1,09
DE000ETFL565	Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	1.383.000	0	272.000	EUR	15,982	22.103.106,00	1,43
DE000ETFL318	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	2.205.500	0	150.000	EUR	9,316	20.546.438,00	1,33
DE000ETFL573	Deka MSCI USA Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	1.267.919	19.000	303.500	EUR	45,190	57.297.259,61	3,72
LU0133819333	Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien		ANT	1.004.725	15.000	125.200	EUR	61,340	61.629.831,50	4,00
DE000ETFL524	Deka US Treasury 7-10 UCITS ETF		ANT	70.210	0	0	EUR	827,660	58.110.008,60	3,77
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial I (A)		ANT	51.332	0	7.300	EUR	224,490	11.523.520,68	0,75
LU0249486092	Deka-FlexZins CF		ANT	3.150	2.300	2.500	EUR	980,890	3.089.803,50	0,20
LU0851807460	Deka-Globale Aktien LowRisk I (A)		ANT	255.480	5.700	33.400	EUR	243,740	62.270.695,20	4,05
DE0007019416	Deka-Institutionell Renten Europa		ANT	111.927	0	0	EUR	62,260	6.968.575,02	0,45
DE0009771824	Deka-VariolInvest TF		ANT	52.310	0	0	EUR	63,610	3.327.439,10	0,22
AT0000A2W9P5	IQAM OptionsprämienStrategie Protect (S)		ANT	11.938	0	0	EUR	1.040,460	12.421.011,48	0,81
DE000A1JSHJ5	Weltzins-INVEST (I)		ANT	562.300	0	226.000	EUR	21,040	11.830.792,00	0,77
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>745.341.467,26</b>	<b>48,37</b>	
<b>EUR</b>								<b>653.285.832,91</b>	<b>42,40</b>	
LU1136108757	AGIF-Allianz Euro Credit SRI Inh. Anteile WT		ANT	16.926	2.010	850	EUR	1.034,020	17.501.822,52	1,14
LU0272941112	Am.Fds-Amundi Fds Volatil.Euro I (C)		ANT	18.294	840	770	EUR	1.230,030	22.502.168,82	1,46
LU1220060260	AXA Wld Fds-Euro Credit Plus Namens-Ant. I Dis.		ANT	173.291	24.400	7.000	EUR	96,370	16.700.053,67	1,08
LU0368229703	BGF - Euro Bond Fund Actions Nominatives I2		ANT	598.486	0	35.000	EUR	13,720	8.211.227,92	0,53
LU1435395980	BLRK STR.FDS-BK Sust.Euro Bd Action Nom.I2 Acc.		ANT	85.697	0	4.800	EUR	94,200	8.072.657,40	0,52
DE000DWS17Z6	Deutsche Extra Bond Tot.Return FD		ANT	262.390	0	15.800	EUR	44,790	11.752.448,10	0,76
LU1432415641	DWS Inv.-Euro High Yield Corp.		ANT	112.700	0	12.300	EUR	94,750	10.678.325,00	0,69
AT0000A1PY56	ERSTE RESPONSIBLE BD EMERG.CO. Inh.-Ant. I A ANT		ANT	179.950	4.700	10.750	EUR	85,960	15.468.502,00	1,00
LU1334564140	Helium Fd-Helium Fund Actions-Nom. I Cap.		ANT	22.721	22.721	0	EUR	1.219,121	27.699.504,38	1,80
LU0404498767	HSBC GIF-Euro High Yield Bond X (Cap.)		ANT	96.221	0	129.000	EUR	52,634	5.064.496,11	0,33
IE000COQKPO9	I.M.II-NASDAQ-100 ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	355.500	365.500	10.000	EUR	48,775	17.339.512,50	1,13
DE0006289499	iShares ebrex <sup>®</sup> Government Germany 5.5-10.Yr UCITS ETF (DE)		ANT	182.900	3.200	13.300	EUR	118,370	21.649.873,00	1,41
DE0006289465	iShares ebrex <sup>®</sup> Government Germany UCITS ETF (DE)		ANT	227.264	0	14.100	EUR	122,565	27.854.612,16	1,81
IE00BJK55C48	iShs II-EH.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.		ANT	1.905.000	0	190.000	EUR	5,195	9.897.046,50	0,64
IE00B3VWN393	iShs VII-\$ Trsy Bd 3-7Yr U.ETF Reg.Shares		ANT	519.800	10.600	21.100	EUR	120,160	62.459.168,00	4,06
IE00BJ5JNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.		ANT	2.385.000	200.000	3.310.000	EUR	7,060	16.838.100,00	1,09
IE00B1FZS798	iShsII-\$ Treas.Bd 7-10Yr U.ETF Reg.Shares		ANT	30.000	0	0	EUR	160,025	4.800.750,00	0,31
IE00BF4G7183	JPM ICAV-EU Res.EI Eq.ETF Reg.Sh.J E.R.E.I.E.O A		ANT	411.000	442.000	31.000	EUR	41,900	17.220.900,00	1,12
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	82.262	0	0	EUR	107,160	8.815.242,32	0,57
LU2051469893	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Dis.		ANT	84.296	0	0	EUR	105,240	8.871.286,83	0,58

# Deka-BasisAnlage moderat

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
LU1529809490	JPM.Fds-Europe Sustainable Eq. Act. Nom. S2(acc)		ANT	175.300	4.700	29.400	EUR 122,760	21.519.828,00	1,40
LU1727352749	JPMorgan Fds-EU Government Bd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	483.300	500.000	16.700	EUR 95,805	46.302.556,50	3,01
LU0986646882	Kempen I.F.-K.(L)EO Sus.Cred. I Acc.		ANT	17.236	2.750	1.500	EUR 982,510	16.934.542,36	1,10
DE000A2QDRK7	LBBW Renten Short Term Nachha. I		ANT	379.218	0	25.700	EUR 98,960	37.527.413,28	2,44
LU0360477631	Mor.St.Inv.-Euro Bond Fund Actions Nom. Z		ANT	214.911	0	13.000	EUR 38,240	8.218.196,64	0,53
LU1781541252	MUL-AMUNDI MSCI Japan U.ETF Nam.-An. Acc		ANT	1.287.500	527.000	190.000	EUR 16,924	21.789.650,00	1,41
IE00BM990G73	Natixis Int.I-LS.sust.EUR Cred Reg.Shs S2 A Acc.		ANT	1.781.689	247.000	66.000	EUR 9,490	16.908.228,61	1,10
IE000S1PE6L2	NBIF-Neu.Ber.Eur.Su.Eq. Reg.Shs I3 Dis.		ANT	1.338.000	0	291.000	EUR 9,830	13.152.540,00	0,85
LU2080996049	SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. IZ Acc.		ANT	162.706	23.400	11.200	EUR 102,041	16.602.682,95	1,08
LU1642485772	T. Rowe Price - US Equity Fd I 10		ANT	193.100	0	47.200	EUR 137,290	26.510.699,00	1,72
LU0569864134	UBAM-Global High Yield Solut. Inhaber-Ant. IH Dis.		ANT	80.628	0	190.800	EUR 97,780	7.883.805,84	0,51
LU1974696418	UBSLF5-JPM DL EM IG ESG D.B.UE A. Nom.(hdg) A-acc.		ANT	1.455.000	0	93.000	EUR 10,636	15.475.380,00	1,00
LU1669794551	UI-Aktia EM Local Ccy Bond+ Namens-Ant. IX Acc.		ANT	64.000	0	118.000	EUR 119,880	7.672.320,00	0,50
LU2145396326	Vontobel F-Sust.Emerg.Mark.De. Act. Nom. HI Acc.		ANT	41.100	41.100	0	EUR 96,730	3.975.603,00	0,26
IE000EESGXZ0	W.M.Fds(I)-W.Euro Hi.Yi.Bd Fd Reg.Shs E Acc.		ANT	444.000	444.000	0	EUR 11,476	5.095.388,40	0,33
IE00BW4NVS37	WMF(I)-W.Emerg.Local Debt Fund Reg.Shs S Acc.Unh.		ANT	657.000	905.000	248.000	EUR 11,572	7.603.001,10	0,49
IE00BG36TC12	Xtr.(IE)-MSCI Japan ESG UC.ETF Reg.Shares 1C		ANT	454.000	408.000	44.000	EUR 20,865	9.472.710,00	0,61
LU0322253906	Xtr.MSCI Europe Small Cap 1C		ANT	549.000	549.000	0	EUR 56,910	31.243.590,00	2,03
<b>USD</b>								<b>92.055.634,35</b>	<b>5,97</b>
LU1955039745	AAF Parnassus US ESG Equities Namens-Ant. X1 Acc.		ANT	149.801	81.000	18.100	USD 189,075	26.247.450,73	1,70
LU1200235437	DPAM L-Bonds Em.Mkts. Sust. Actions au Port.F Acc.		ANT	160.281	0	71.400	USD 131,490	19.530.487,16	1,27
IE00BZ1BLN67	Fr.Tpl.GF-FITGF CB US Eq.Su.Ldr N.-Anteile S Acc.		ANT	35.687	0	6.100	USD 209,090	6.914.831,65	0,45
LU1727362110	JPMorg.I.-US Select Equity Fd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	101.000	110.000	9.000	USD 221,330	20.715.716,80	1,34
LU1727352665	JPMorgan Fds-Emer.Mrkt Opp.Fd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	197.547	0	0	USD 101,860	18.647.148,01	1,21
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>1.460.915.450,54</b>	<b>94,84</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>543.941,60</b>	<b>0,03</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>								<b>543.941,60</b>	<b>0,03</b>
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 24 4600		XEUR		Anzahl 790			EUR 23,800	188.020,00	0,01
S & P 500 Index (S500) Put Juni 24 4900		XCBO		Anzahl 135			USD 28,450	355.921,60	0,02
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>543.941,60</b>	<b>0,03</b>
<b>Zins-Derivate</b>	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>48.537,97</b>	<b>0,00</b>
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Juni 24		XCBT	USD	76.000.000				48.537,97	0,00
<b>Summe Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>48.537,97</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	77.072.431,33			% 100,000	77.072.431,33	5,01
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	107.981.983,00			% 100,000	661.066,96	0,04
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	1.357.198,07			% 100,000	1.257.712,97	0,08
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>78.991.211,26</b>	<b>5,13</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>78.991.211,26</b>	<b>5,13</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche			EUR	349.112,02				349.112,02	0,02
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	1.408.581,23				1.408.581,23	0,09
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	147.774,00				147.774,00	0,01
Sonstige Forderungen			EUR	78.901,21				78.901,21	0,01
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>1.984.368,46</b>	<b>0,13</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-1.093.527,60				-1.093.527,60	-0,07

# Deka-BasisAnlage moderat

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-941.950,31				-941.950,31	-0,06
	<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>						EUR	<b>-2.035.477,91</b>	<b>-0,13</b>
	<b>Fondsvermögen</b>						EUR	<b>1.540.448.031,92</b>	<b>100,00</b>
	<b>Umlaufende Anteile</b>						STK	<b>13.734.673,000</b>	
	<b>Anteilwert</b>						EUR	<b>112,16</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>				
FR0011510023	Candriam Index Arbitrage Act.au Port.V 3 Déc.	ANT	0	31.698
LU2360511021	Eur.Specialist IF-MG Su.Eu.Cr. Act. Nom. EI Acc.	ANT	0	173.350
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.	ANT	0	1800.000
IE00BFYV9M80	Guinness A.M.Fds-G.Sust.Energy Reg.Shs Y Acc.	ANT	120.000	1.669.413
FR0010757831	Helium Opportunités Act. au Porteur A 3 Déc.	ANT	0	18.450
LU1829219390	MUL Amundi Euro Stoxx Banks UCITS ETF Inh.A. Acc.N.	ANT	0	151300
LU2018762653	MUL Amundi US Curve Ste 2-10Y UCITS ETF Inh.A. Acc	ANT	30.000	471.000
LU2196483163	Nordea 1-Emerging Stars Bd Fd Act. Nom. HBI Acc.	ANT	0	48.000
LU2016215001	Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.	ANT	0	1.474.055

## Gattungsbezeichnung

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

### Terminkontrakte

#### Zinsterminkontrakte

##### Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): Ten-Year US Treasury Note Future (TY), US Treasury Long Bond Future (US))

EUR

114.807

##### Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM))

EUR

155.594

### Optionsrechte

#### Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

##### Optionsrechte auf Aktienindices

##### Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)

EUR

134.546

**Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):**

### unbefristet

(Basiswert(e): 4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 08/40)

EUR

50.363



# Deka-BasisAnlage moderat

## Anhang.

Umlaufende Anteile  
Anteilwert

STK  
EUR

13.734.673  
112,16

### 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)

Im Sondervermögen bestehen zum Berichtsstichtag keine offenen Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte. Erläuterungen gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nur für zeitraumbezogene Angaben erforderlich.

#### Ertrags- und Kostenanteile

##### Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	1.290,72	100,00
Kostenanteil des Fonds	425,94	33,00
Ertragsanteil der KVG	425,94	33,00

Der oben ausgewiesene Kostenanteil des Fonds bzw. Ertragsanteil der KVG beinhaltet sowohl den Aufwandsersatz der Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) als auch zusätzliche Kosten Dritter. Damit werden der Infrastrukturaufwand der Kapitalverwaltungsgesellschaft und die Kosten des externen Wertpapierdarlehen-Serviceproviders für die Anbahnung, Durchführung und Abwicklung inklusive der Sicherheitenstellung abgegolten.

---

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**