

Halbjahresbericht  
zum 31. März 2024.

## **Deka-BasisAnlage ausgewogen**

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 ausgewogen 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	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 ausgewogen

## 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 60 % 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 ausgewogen

Performance*	6 Monate
	9,5%
ISIN	DE000DK2CFR7

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

# Deka-BasisAnlage ausgewogen

## Vermögensübersicht zum 31. März 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>138.033.030,00</b>	<b>5,84</b>
Deutschland	138.033.030,00	5,84
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>1.961.630.685,37</b>	<b>82,97</b>
Deutschland	634.486.744,89	26,81
Irland	323.445.667,59	13,69
Luxemburg	985.698.248,89	41,71
Österreich	18.000.024,00	0,76
<b>3. Zertifikate</b>	<b>251.516.858,34</b>	<b>10,62</b>
Irland	251.516.858,34	10,62
<b>4. Derivate</b>	<b>1.306.603,43</b>	<b>0,05</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>11.472.306,61</b>	<b>0,48</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>4.898.200,31</b>	<b>0,21</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-4.011.175,83</b>	<b>-0,17</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>2.364.846.508,23</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen</b>	<b>138.033.030,00</b>	<b>5,84</b>
EUR	138.033.030,00	5,84
<b>2. Investmentanteile</b>	<b>1.961.630.685,37</b>	<b>82,97</b>
EUR	1.741.853.459,67	73,68
USD	219.777.225,70	9,29
<b>3. Zertifikate</b>	<b>251.516.858,34</b>	<b>10,62</b>
EUR	251.516.858,34	10,62
<b>4. Derivate</b>	<b>1.306.603,43</b>	<b>0,05</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>11.472.306,61</b>	<b>0,48</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>4.898.200,31</b>	<b>0,21</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-4.011.175,83</b>	<b>-0,17</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>2.364.846.508,23</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-BasisAnlage ausgewogen

## 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>389.549.888,34</b>	<b>16,46</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>138.033.030,00</b>	<b>5,84</b>
<b>EUR</b>								<b>138.033.030,00</b>	<b>5,84</b>
DE0001135366	4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 08/40		EUR	53.500.000	3.500.000	8.000.000	% 129,851	69.470.017,50	2,94
DE0001102382	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25 <sup>1)</sup>		EUR	70.500.000	2.000.000	2.500.000	% 97,253	68.563.012,50	2,90
<b>Zertifikate</b>								<b>251.516.858,34</b>	<b>10,62</b>
<b>EUR</b>								<b>251.516.858,34</b>	<b>10,62</b>
FR0013416716	Amundi Physical Metals PLC Rohst.-Zert. XAU 19/18		STK	606.000	606.000	0	EUR 80,448	48.751.488,00	2,06
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00		STK	188.000	198.000	10.000	EUR 195,210	36.699.480,00	1,55
XS2183935274	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 20/00		STK	3.153.549	493.700	1.590.151	EUR 52,660	166.065.890,34	7,01
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>1.961.630.685,37</b>	<b>82,97</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>928.012.042,30</b>	<b>39,23</b>
<b>EUR</b>								<b>928.012.042,30</b>	<b>39,23</b>
DE000DK1CJZ4	Deka Bund + S Finanz: 7-15 I		ANT	856.403	0	0	EUR 88,970	76.194.174,91	3,22
DE000ETFL177	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany UCITS ETF		ANT	312.489	0	8.600	EUR 88,570	27.677.150,73	1,17
DE000ETFL219	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 10+ UCITS ETF		ANT	65.741	0	4.300	EUR 111,180	7.309.084,38	0,31
DE000ETFL185	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 1-3 UCITS ETF		ANT	973.335	10.000	28.000	EUR 74,546	72.558.230,91	3,07
DE000ETFL193	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 3-5 UCITS ETF		ANT	113.487	0	8.200	EUR 87,768	9.960.527,02	0,42
DE000ETFL201	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 5-10 UCITS ETF		ANT	490.910	0	0	EUR 105,850	51.962.823,50	2,20
DE000ETFL599	Deka MSCI EUR Corporates Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	219.750	37.750	16.000	EUR 88,670	19.485.232,50	0,82
DE000ETFL565	Deka MSCI Europe Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	3.607.500	46.500	589.000	EUR 15,982	57.655.065,00	2,44
DE000ETFL318	Deka MSCI Japan Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	2.624.000	0	160.000	EUR 9,316	24.445.184,00	1,03
DE000ETFL573	Deka MSCI USA Climate Change ESG UCITS ETF		ANT	3.015.761	50.000	605.000	EUR 45,190	136.282.239,59	5,76
LU0133819333	Deka Portfolio Nachhaltigkeit Globale Aktien		ANT	2.317.046	50.000	202.000	EUR 61,340	142.127.601,64	6,01
DE000ETFL524	Deka US Treasury 7-10 UCITS ETF		ANT	99.600	0	0	EUR 827,660	82.434.936,00	3,49
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial I (A)		ANT	192.285	6.600	22.300	EUR 224,490	43.166.059,65	1,83
LU0249486092	Deka-FlexZins CF		ANT	4.792	0	4.600	EUR 980,890	4.700.424,88	0,20
LU0851807460	Deka-Globale Aktien LowRisk I (A)		ANT	583.531	14.000	53.000	EUR 243,740	142.229.845,94	6,01
DE0007019416	Deka-Institutionell Renten Europa		ANT	115.668	0	6.700	EUR 62,260	7.201.489,68	0,30
DE0009771824	Deka-Variolinvest TF		ANT	75.477	0	20.000	EUR 63,610	4.801.091,97	0,20
DE000A1JSHJ5	Weltzins-INVEST (I)		ANT	847.000	0	355.000	EUR 21,040	17.820.880,00	0,75
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>1.033.618.643,07</b>	<b>43,74</b>
<b>EUR</b>								<b>813.841.417,37</b>	<b>34,45</b>
LU1136108757	AGIF-Allianz Euro Credit SRI Inh. Anteile WT		ANT	19.109	2.280	550	EUR 1.034,020	19.759.088,18	0,84
LU1220060260	AXA Wld Fds-Euro Credit Plus Namens-Ant. I Dis.		ANT	199.051	32.500	7.000	EUR 96,370	19.182.544,87	0,81
LU0368229703	BGF - Euro Bond Fund Actions Nominatives I2		ANT	681.908	0	60.000	EUR 13,720	9.355.777,76	0,40
LU1435395980	BLRK STR.FDS-BK Sust.Euro Bd Action Nom.I2 Acc.		ANT	101.822	0	8.700	EUR 94,200	9.591.632,40	0,41
DE000DWS17Z6	Deutsche Extra Bond Tot.Return FD		ANT	266.342	0	0	EUR 44,790	11.929.458,18	0,50
LU1432415641	DWS Inv.-Euro High Yield Corp.		ANT	136.600	0	10.000	EUR 94,750	12.942.850,00	0,55
AT0000A1PY56	ERSTE RESPONSIBLE BD EMERG.CO. Inh.-Ant. I A ANT		ANT	209.400	7.800	7.900	EUR 85,960	18.000.024,00	0,76
LU0404498767	HSBC GIF-Euro High Yield Bond X (Cap)		ANT	122.570	0	100.000	EUR 52,634	6.451.349,38	0,27
IE000COQKPO9	I.M.II-NASDAQ-100 ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	805.000	825.000	20.000	EUR 48,775	39.263.875,00	1,66
DE0006289465	iShares ebrex <sup>®</sup> Government Germany UCITS ETF (DE)		ANT	218.408	5.000	6.300	EUR 122,565	26.769.176,52	1,13
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shs Acc.		ANT	2.240.000	0	250.000	EUR 5,195	11.637.472,00	0,49
IE00B3VWN393	iShs VII-Š Trsy Bd 3-7yr U.ETF Reg.Shares		ANT	749.177	39.000	18.300	EUR 120,160	90.021.108,32	3,81
IE00BF4G7183	JPM ICAV-EU Res.EI Eq.ETF Reg.ShJ E.R.E.I.E.O A		ANT	924.500	998.000	73.500	EUR 41,900	38.736.550,00	1,64
LU2051469620	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	189.550	8.800	0	EUR 107,160	20.312.198,47	0,86
LU2051469893	JPM.Fds-Em. Mkts Sust. Equ. Fd Act. Nom. I Dis.		ANT	188.359	0	0	EUR 105,240	19.822.871,06	0,84
LU1529809490	JPM.Fds-Europe Sustainable Eq. Act. Nom. S2(acc)		ANT	295.312	0	38.200	EUR 122,760	36.252.501,12	1,53
LU1727352749	JPMorgan Fds-EU Government Bd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	562.300	568.500	6.200	EUR 95,805	53.871.151,50	2,28
LU0986646882	Kempen I.F.-K.(L.)EO Sus.Cred. I Acc.		ANT	19.497	2.700	650	EUR 982,510	19.155.997,47	0,81
LU0360477631	Mor.St.Inv.-Euro Bond Fund Actions Nom. Z		ANT	251.024	0	18.500	EUR 38,240	9.599.157,76	0,41
LU1781541252	MUL-AMUNDI MSCI Japan U.ETF Nam.-An. Acc		ANT	3.367.000	1.235.000	350.000	EUR 16,924	56.983.108,00	2,41

# Deka-BasisAnlage ausgewogen

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
IE00BM990G73	Natixis Int.I-LS.sust.EUR Cred Reg.Shs S2 A Acc.		ANT	2.010.817	282.000	65.000	EUR 9,490	19.082.653,33	0,81
IE000S1PE6L2	NBIF-Neu.Ber.Eur.Su.Eq. Reg.Shs I3 Dis.		ANT	2.014.500	0	376.000	EUR 9,830	19.802.535,00	0,84
LU2080996049	SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. IZ Acc.		ANT	188.913	26.600	4.700	EUR 102,041	19.276.871,43	0,82
LU1642485772	T. Rowe Price - US Equity Fd I 10		ANT	452.700	0	83.300	EUR 137,290	62.151.183,00	2,63
LU0569864134	UBAM-Global High Yield Solut. Inhaber-Ant. IH Dis.		ANT	92.384	0	205.800	EUR 97,780	9.033.307,52	0,38
LU1974696418	UBSLFS-JPM DL EM IG ESG D.B.UE A. Nom.(hdg) A-acc.		ANT	1.687.000	0	60.000	EUR 10,636	17.942.932,00	0,76
LU1669794551	UI-Aktia EM Local Ccy Bond+ Namens-Ant. IX Acc.		ANT	67.700	0	114.800	EUR 119,880	8.115.876,00	0,34
LU2145396326	Vontobel F-Sust.Emerg.Mark.De. Act. Nom. HI Acc.		ANT	62.500	62.500	0	EUR 96,730	6.045.625,00	0,26
IE000EESGXZ0	W.M.Fds(I)-W.Euro Hi.Yi.Bd Fd Reg.Shs E Acc.		ANT	477.000	477.000	0	EUR 11,476	5.474.099,70	0,23
IE00BW4NVS37	WMF(I)-W.Emerg.Local Debt Fund Reg.Shs S Acc.Unh.		ANT	688.000	931.000	243.000	EUR 11,572	7.961.742,40	0,34
IE00BG36TC12	Xtr.(IE)-MSCI Japan ESG UC.ETF Reg.Shares 1C		ANT	1.808.000	957.000	169.000	EUR 20,865	37.723.920,00	1,60
LU0322253906	Xtr.MSCI Europe Small Cap 1C		ANT	1.258.000	1.258.000	0	EUR 56,910	71.592.780,00	3,03
<b>USD</b>								<b>219.777.225,70</b>	<b>9,29</b>
LU1955039745	AAF Parnassus US ESG Equities Namens-Ant. X1 Acc.		ANT	345.616	204.000	32.800	USD 189,075	60.557.265,50	2,56
LU1200235437	DPAM L-Bonds Em.Mkts. Sust. Actions au Port.F Acc.		ANT	161.159	0	67.400	USD 131,490	19.637.472,81	0,83
IE00BZ1BLN67	Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr N-Anteile S Acc.		ANT	74.915	0	7.500	USD 209,090	14.515.779,21	0,61
IE00BJ5JNZ06	iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg.Shs Dis.		ANT	5.537.000	470.000	7.050.000	USD 7,645	39.225.932,63	1,66
LU1727362110	JPMorg.I-US Select Equity Fd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	213.600	233.000	19.400	USD 221,330	43.810.664,44	1,85
LU1727352665	JPMorgan Fds-Emer.Mrkt Opp.Fd Act. Nom. I2 Acc.		ANT	445.265	0	0	USD 101,860	42.030.111,11	1,78
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>2.351.180.573,71</b>	<b>99,43</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>1.232.519,17</b>	<b>0,05</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>								<b>1.232.519,17</b>	<b>0,05</b>
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juni 24 4600		XEUR		Anzahl 1.800			EUR 23,800	428.400,00	0,02
S & P 500 Index (S500) Put Juni 24 4900		XCBO		Anzahl 305			USD 28,450	804.119,17	0,03
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>1.232.519,17</b>	<b>0,05</b>
<b>Zins-Derivate</b>	Forderungen/ Verbindlichkeiten								
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>74.084,26</b>	<b>0,00</b>
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Juni 24		XCBT	USD	116.000.000				74.084,26	0,00
<b>Summe Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>74.084,26</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	6.479.379,60			% 100,000	6.479.379,60	0,27
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	93.080.640,00			% 100,000	569.840,77	0,02
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	4.772.952,36			% 100,000	4.423.086,24	0,19
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>11.472.306,61</b>	<b>0,48</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>11.472.306,61</b>	<b>0,48</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche			EUR	2.305.003,42				2.305.003,42	0,10
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	2.149.939,76				2.149.939,76	0,09
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	11,41				11,41	0,00
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	266.230,22				266.230,22	0,01
Sonstige Forderungen			EUR	177.015,50				177.015,50	0,01
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>4.898.200,31</b>	<b>0,21</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen			EUR	-3,77				-3,77	0,00
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-2.298.205,80				-2.298.205,80	-0,10
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-1.712.966,26				-1.712.966,26	-0,07
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-4.011.175,83</b>	<b>-0,17</b>

# Deka-BasisAnlage ausgewogen

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>Fondsvermögen</b>								2.364.846.508,23	100,00
<b>Umlaufende Anteile</b>								19.313.769,000	
<b>Anteilwert</b>								122,44	

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

<sup>1)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

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: 1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25				
	EUR	2.000.000	1945.050,00	
<b>Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:</b>	<b>EUR</b>		<b>1.945.050,00</b>	<b>1.945.050,00</b>

## 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>				
LU2360511021	Eur.Specialist IF-MG Su.Eu.Cr. Act. Nom. EI Acc.	ANT	0	190.400
LU2608816398	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Act.Nom. R Acc.	ANT	200.000	4.167.000
IE00BFYV9M80	Guinness A.M.Fds-G.Sust.Energy Reg.Shs Y Acc.	ANT	300.000	3.734.586
LU1829219390	MUL Amundi Euro Stoxx Banks UCITS ETF Inh.A. Acc.N.	ANT	0	330.400
LU2196483163	Nordea 1-Emerging Stars Bd Fd Act. Nom. HBI Acc.	ANT	0	78.000
LU2016215001	Schroder ISF-Euro Governm. Bd Act. Nom. IZ Acc.	ANT	0	1.628.154

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))	<b>EUR</b>	<b>173.982</b>
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM))	<b>EUR</b>	<b>233.512</b>
<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)	<b>EUR</b>	<b>301.240</b>
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
<b>unbefristet</b>	<b>EUR</b>	<b>209.124</b>
(Basiswert(e): 4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 08/40)		



# Deka-BasisAnlage ausgewogen

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	19.313.769
Anteilwert	EUR	122,44

### 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)

#### Verwendete Vermögensgegenstände

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR

1.945.050,00

in % des Fondsvermögens

0,08

#### 10 größte Gegenparteien

##### Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

1.945.050,00

Sitzstaat

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)

unbefristet

absolute Beträge in EUR

1.945.050,00

#### 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. Gibt es kein Anleiherating, so ist das Emittentenrating zu nutzen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen in einem wichtigen Index enthalten sein.

#### Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

##### Wertpapier-Darlehen

EUR

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

##### Wertpapier-Darlehen

unbefristet

absolute Beträge in EUR

42.759.085,10

#### Ertrags- und Kostenanteile

##### Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds

Kostenanteil des Fonds

Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

in % der Bruttoerträge des Fonds

5.166,86 100,00

1.705,07 33,00

1.705,07 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.

# Deka-BasisAnlage ausgewogen

## 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.

## Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

0,08% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

## Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps Wertpapier-Darlehen

Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München

absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR

42.759.085,10

## 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

42.759.085,10 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.

Die Summenangabe der Sicherheiten nach Instrumentenart, Restlaufzeit, Sicherheitenaussteller und Verwahrer kann rundungsbedingt von der Summe der angegebenen Einzelwerte abweichen.

---

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**