

Halbjahresbericht
zum 31. März 2018.
Deka-BasisAnlage A60

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

The logo for Deka Investments, featuring the word "Deka" in a large, bold, white sans-serif font, with "Investments" in a smaller, bold, white sans-serif font directly below it. To the left of the word "Deka" are three small white squares of increasing size, arranged diagonally.

„Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

April 2018

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-BasisAnlage A60 für den Zeitraum vom 1. Oktober 2017 bis zum 31. März 2018.

Nach dem Jahreswechsel markierten einige wichtige Aktienmärkte neue historische Höchststände, ehe es im Februar 2018 zu einer ausgeprägten Korrekturbewegung kam, die insbesondere in Europa die vorangegangenen Kurssteigerungen aufzehrte. Trotz des Rücksetzers bestimmte der synchron verlaufende kräftige Aufschwung in den meisten Volkswirtschaften das Bild. Investoren richteten angesichts der starken Konjunkturdaten ihre Aufmerksamkeit verstärkt auf die Signale der großen Notenbanken zur Normalisierung der Geldpolitik. Auch die sich verschärfende Tonlage im US-Handelsstreit hinterließ ebenso wie aufflammende Zinsängste deutliche Spuren an den Kapitalmärkten.

Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen bewegte sich im Berichtszeitraum zunächst unter Schwankungen seitwärts. Nach dem Jahreswechsel stieg das Renditeniveau auf 0,7 Prozent und damit den höchsten Stand seit Dezember 2015. Zum Stichtag lag die Rendite bei 0,5 Prozent. Laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten angesichts der guten US-Wirtschaftsdaten zuletzt bei 2,7 Prozent.

An den internationalen Aktienmärkten hielt bis Ende Januar die kräftige Aufwärtsbewegung des vergangenen Jahres an, ehe in den letzten beiden Berichtsmonaten Befürchtungen über eine frühzeitige Straffung der Geldpolitik durch die großen Notenbanken die Börsen in eine deutliche Korrekturphase abtauchen ließen. Europa bzw. Deutschland verzeichneten erhebliche Verluste, während etwa die Standardindizes in den USA und Japan im Stichtagsvergleich auf positivem Terrain landeten.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Deka-BasisAnlage A60 eine Wertentwicklung von minus 0,2 Prozent.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter 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 Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik. Deka-BasisAnlage A60	5
Vermögensübersicht zum 31. März 2018. Deka-BasisAnlage A60	6
Vermögensaufstellung zum 31. März 2018. Deka-BasisAnlage A60	7
Anhang. Deka-BasisAnlage A60	10
Informationen der Verwaltung.	13
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-BasisAnlage A60

Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Deka-BasisAnlage A60 ist der mittel- bis langfristige Kapitalzuwachs durch ein breit gestreutes Anlageportfolio sowie eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. In Kombination mit einem systematischen Management der Anlagerisiken strebt das Fondsmanagement zudem das Ziel an, das angelegte Kapital täglich rollierend mit einer Wahrscheinlichkeit von 95 Prozent auf Sicht von acht Jahren mindestens zu erhalten (keine Garantie).

Das Fondsmanagement wählt ein Sortiment von Zielfonds und vervielfacht damit die Anzahl der verschiedenen Wertpapiere, in die mittelbar investiert wird. Auf diese Weise soll die Risikostreuung erhöht und das Spezialistenwissen der Zielfondsmanager genutzt werden. Das Fondsmanagement wählt die Vermögenswerte nach einem System zur Steuerung der Anlagerisiken aus. Dabei wird der Anteil der Aktienfonds zwischen 0 Prozent und 60 Prozent festgelegt. Weiterhin können hauptsächlich Anteile an Rentenfonds, Geldmarktfonds und kurzfristigen, liquiden Geldanlagen erworben werden.

Zu Beginn des Berichtszeitraums bildeten im Rentensegment Staatsanleihen aus Euroland den Investitionsschwerpunkt. Beigemischt wurden Unternehmensanleihen von Schuldern unterschiedlicher Bonität und Staatsanleihen von Schwellenländern. Festverzinsliche Wertpapiere rundeten die Portfoliostruktur ab. Der Aktienfondsbereich wurde über europäische, US-amerikanische und japanische Engagements abgebildet.

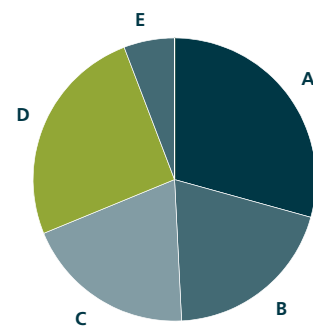
Das Management setzte in einem volatilen Kapitalmarktumfeld auf eine aktive Steuerung des Aktieninvestitionsgrads insbesondere über europäische und US-amerikanische Investitionen. Im Zuge der Aktienmarktkorrektur hat das Fondsmanagement in den letzten beiden Berichtsmonaten die Aktienquote in Summe signifikant zurückgeführt, um den Rücksetzer abzufedern. Im Gegenzug wurde die Rentenseite stark ausgebaut. Zudem erfolgte während der Berichtsperiode eine flexible Steuerung der Währungsrisiken im US-Dollar.

Zum Ende des Berichtshalbjahrs bildeten im Rentensegment Staatsanleihen aus Euroland den Investitionsschwerpunkt, die eine Reduktion erfuhren. Ein weiterer Fokus richtete sich auf Staatsanleihen

Wichtige Kennzahlen Deka-BasisAnlage A60

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Performance*	-0,2%	0,2%	-0,7%
ISIN	DE000DK2CFR7		
* p.a. / Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.			

Fondsstruktur Deka-BasisAnlage A60



A	Rentenfonds	29,3%
B	Aktienfonds	19,9%
C	Festverzinsliche Anleihen	19,6%
D	Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	25,4%
E	Barreserve, Sonstiges	5,8%

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

von Schwellenländern, deren Anteil im Verlauf des Berichtszeitraums aufgestockt wurde und Unternehmensanleihen von Schuldern unterschiedlicher Bonität. Darüber hinaus fanden festverzinsliche Wertpapiere mit höheren Quoten Berücksichtigung. Das Aktiensegment wurde über europäische und US-amerikanische Investitionen abgebildet. Dagegen wurden die Engagements in Japan vollständig abgebaut. Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds dienten der Abmilderung zwischenzeitlicher Schwankungen.

In der Berichtsperiode vom 1. Oktober 2017 bis zum 31. März 2018 verzeichnete der Deka-BasisAnlage A60 eine Wertminderung um 0,2 Prozent.

Deka-BasisAnlage A60

Vermögensübersicht zum 31. März 2018.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	615.352.788,90	19,21
Deutschland	615.352.788,90	19,21
2. Investmentanteile	1.575.629.484,80	49,19
Deutschland	649.799.347,89	20,29
Großbritannien	16.988.581,57	0,53
Luxemburg	908.841.555,34	28,37
3. Derivate	14.684.150,00	0,46
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	998.844.469,66	31,17
5. Sonstige Vermögensgegenstände	24.144.666,69	0,75
II. Verbindlichkeiten	-24.767.791,00	-0,78
III. Fondsvermögen	3.203.887.769,05	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	615.352.788,90	19,21
EUR	615.352.788,90	19,21
2. Investmentanteile	1.575.629.484,80	49,19
EUR	1.485.843.377,10	46,39
USD	89.786.107,70	2,80
3. Derivate	14.684.150,00	0,46
4. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	998.844.469,66	31,17
5. Sonstige Vermögensgegenstände	24.144.666,69	0,75
II. Verbindlichkeiten	-24.767.791,00	-0,78
III. Fondsvermögen	3.203.887.769,05	100,00

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

Deka-BasisAnlage A60

Vermögensaufstellung zum 31. März 2018.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								615.352.788,90	19,21
Verzinsliche Wertpapiere								615.352.788,90	19,21
EUR								615.352.788,90	19,21
DE0001135382	3,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 09/19 ¹⁾	EUR		403.140.000	403.140.000	0	% 105,271	424.389.509,40	13,25
DE0001102325	2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23 ¹⁾	EUR		123.900.000	20.500.000	32.650.000	% 111,175	137.745.205,50	4,30
DE0001102408	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26 ¹⁾	EUR		54.600.000	80.800.000	73.500.000	% 97,469	53.218.074,00	1,66
Wertpapier-Investmentanteile								1.575.629.484,80	49,19
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								649.799.347,89	20,29
EUR								649.799.347,89	20,29
DE000DK1CJZ4	Deka Bund + S Finanz: 7-15 I	ANT		2.506.418	123.392	40.082	EUR 108,210	271.219.491,78	8,47
DE000ETFL177	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany UCITS ETF	ANT		906.574	20.752	59.142	EUR 100,550	91.156.015,70	2,85
DE000ETFL185	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 1-3 UCITS ETF	ANT		1.224.807	192.838	201.980	EUR 83,000	101.658.981,00	3,17
DE000ETFL193	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 3-5 UCITS ETF	ANT		286.473	56.570	4.503	EUR 100,180	28.698.865,14	0,90
DE000ETFL201	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany 5-10 UCITS ETF	ANT		765.293	60.293	0	EUR 124,850	95.546.831,05	2,98
DE000DK2J589	Deka-RentSpezial HighYield 6/2020 CF	ANT		384.135	5.286	196.165	EUR 101,650	39.047.322,75	1,22
DE000DK2J8L6	Deka-RentSpezial HighYield 9/2023 CF	ANT		219.473	136.810	0	EUR 102,390	22.471.840,47	0,70
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								364.687.209,38	11,38
EUR								364.687.209,38	11,38
LU0713853298	Deka-Euroland Aktien LowRisk S (A)	ANT		397.684	62.508	5.783	EUR 176,360	70.135.550,24	2,19
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial I (A)	ANT		1.151.557	368.910	257.050	EUR 165,940	191.089.368,58	5,96
LU1138302986	Deka-USA Aktien Spezial I	ANT		515.646	169.378	7.414	EUR 138,160	71.241.651,36	2,22
LU1012130644	Renten 7-15	ANT		275.720	3.443	61.414	EUR 116,860	32.220.639,20	1,01
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								561.142.927,53	17,52
EUR								471.356.819,83	14,72
LU0359002093	BGF - Em.Ma.Local Curr.Bd.Fd. Act.Nom. A2 Acc. Hdg	ANT		3.717.481	4.231.619	514.138	EUR 8,850	32.899.706,85	1,03
LU0413376566	BGF - Emerging Markets Bond Fd Act.Nom. A2 Acc.Hdg	ANT		2.704.619	1.500.104	0	EUR 16,690	45.140.091,11	1,41
LU0094488615	G.Sachs Fds-GS Glob.High Yld P Reg.Shares	ANT		2.031.679	1.896.758	1.901.192	EUR 6,310	12.819.894,49	0,40
LU0256063883	GAM Multibd-Local Emerging Bd Act.au Port. A dis.	ANT		780.283	821.595	606.720	EUR 71,560	55.837.051,48	1,74
LU0262418394	G5 Fds-GS Emerg.Mkts Debt Ptf Reg.Shares Base	ANT		2.620.890	1.441.349	0	EUR 17,190	45.053.099,10	1,41
LU0011889846	Jan.Hend.Hor.-JHH Euroland Actions Nom. A2 (Acc.)	ANT		601.685	117.451	750.753	EUR 47,520	28.592.071,20	0,89
LU0108415935	JPMorg.I.-Gbl High Yield Bd Fd N.-Ant.A(ac.) (he.)	ANT		58.180	50.873	54.536	EUR 220,360	12.820.544,80	0,40
LU0133807163	Pictet - EUR High Yield P	ANT		33.226	16.054	0	EUR 250,200	8.313.145,20	0,26
LU0106235293	Schroder ISF Euro Equity Namensanteile A Acc	ANT		768.084	134.650	1.006.523	EUR 37,405	28.730.105,21	0,90
LU0849399786	Schroder ISF Euro High Yield Namensant. A Acc	ANT		120.223	54.249	0	EUR 141,320	16.989.854,25	0,53
LU0271483876	Schroder ISF US Large Cap Namensant.A Acc. Hedged	ANT		436.076	823.707	387.631	EUR 183,047	79.822.185,53	2,49
GB00842R2118	Threadn.Inv.Fds-Eur.Hgh Yld RGA	ANT		7.399.208	3.492.430	0	EUR 2,296	16.988.581,57	0,53
LU0086177085	UBS (Lux) BF-EO H. Yield [EUR] P	ANT		42.123	19.786	0	EUR 205,680	8.663.858,64	0,27
LU1157384881	UBS (Lux) Eq.-USA Enhanced Inh.-Ant.(hedg.)	ANT		636.160	1.193.665	557.505	EUR 123,690	78.686.630,40	2,46
USD								89.786.107,70	2,80
LU0590395801	JPM.FDS-US R.E.I.E.CACCDL Act.Nom.C (acc)	ANT		257.870	350.269	531.913	USD 215,590	45.167.317,95	1,41
LU0246276595	UBS (Lux) Eq.-USA Enhanced Inh.-Ant. P-acc	ANT		247.528	427.806	609.947	USD 221,870	44.618.789,75	1,39
Summe Wertpapiervermögen ²⁾								2.190.982.273,70	68,40
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Optionsrechte								17.191.200,00	0,54
Optionsrechte auf Aktienindices								17.191.200,00	0,54
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Mai 18 3.350		XEUR	Anzahl	11.310			EUR 152,000	17.191.200,00	0,54
Summe Aktienindex-Derivate								17.191.200,00	0,54
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								-2.507.050,00	-0,08
EURO Bund Future (FGBL) Juni 18		XEUR	EUR	-402.100.000				-2.507.050,00	-0,08
Summe Zins-Derivate								-2.507.050,00	-0,08
Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR		179.961.468,02			% 100,000	179.961.468,02	5,62
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DekaBank Deutsche Girozentrale		USD		6.076.374,63			% 100,000	4.936.730,41	0,15
Summe Bankguthaben								184.898.198,43	5,77
Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds									
KVG-eigene Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds								349.222.603,99	10,90
DE0007019440	Deka-Liquidität	ANT		7.064.993	4.396.305	0	EUR 49,430	349.222.603,99	10,90

Deka-BasisAnlage A60

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)	
Gruppeneigene Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds										
LU0230155797	Deka-Cash		ANT	9.428.356	2.135.429	0	EUR 49,290	464.723.667,24	14,50	
Summe Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds								464.723.667,24	14,50	
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahen Fonds								813.946.271,23	25,40	
								EUR	998.844.469,66	31,17
Sonstige Vermögensgegenstände										
	Zinsansprüche		EUR	11.939.915,34				11.939.915,34	0,37	
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	9.703.688,50				9.703.688,50	0,30	
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	34.607,81				34.607,81	0,00	
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	2.466.455,04				2.466.455,04	0,08	
Summe Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 24.144.666,69	0,75	
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme										
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	-1.597,00			% 100,000	-12,18	-0,00	
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								EUR -12,18	-0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten										
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-16.957,83				-16.957,83	-0,00	
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-1.193.241,92				-1.193.241,92	-0,04	
	Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften		EUR	-21.414.200,90				-21.414.200,90	-0,67	
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-2.143.378,17				-2.143.378,17	-0,07	
Summe Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -24.767.778,82	-0,78	
Fondsvermögen								EUR 3.203.887.769,05	100,00	
Umlaufende Anteile								STK 26.925.062		
Anteilwert								EUR 118,99		

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

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 Kurswert in EUR	befristet	unbefristet	gesamt
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)					
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:					
3,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 09/19	EUR	150.178.590		158.094.503,48	
2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23	EUR	65.914.000		73.279.559,93	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26	EUR	54.600.000		53.218.073,99	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR			284.592.137,40	284.592.137,40
Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.03.2018					
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,23085	= 1 Euro (EUR)		
Japan, Yen	(JPY)	131,17000	= 1 Euro (EUR)		
Marktschlüssel					
Terminbörsen					
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)				

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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE0001135457	2,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 11/21	EUR	50.500.000	298.600.000
Wertpapier-Investmentanteile				
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
DE000ETFL011	Deka DAX UCITS ETF	ANT	54.025	454.353
DE000ETFL284	Deka MSCI Europe UCITS ETF	ANT	3.283.926	3.283.926
DE000DK2D8U3	Deka-RentSpezial HighYield 6/2019 CF	ANT	0	469.786
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
LU1117993268	DekaLux-Japan Flex Hedged Euro E (A)	ANT	0	678.224

Deka-BasisAnlage A60

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
LU0840619489	AGIF-Allianz German Equity Inhaber Anteile W	ANT	1.602	26.518
LU0234682044	G.Sachs Fds-GS Eur.CORE Equ.P. Reg.Shs I Acc.	ANT	1.713.119	1.713.119
LU0236737465	Schroder ISF Japanese Equity Namens-Ant. A Acc. H.	ANT	0	986.376
USD				
LU0278470058	BGF - Em.Ma.Local Curr.Bd.Fd. Act. Nom. Cl.A2	ANT	795.340	795.340
LU0107851205	GAM Multibd-Local Emerging Bd Actions au Porteur A	ANT	630.420	630.420
LU0106261372	Schroder ISF US Large Cap Namensanteile A Acc	ANT	0	660.106
Gattungsbezeichnung				
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000	
Terminkontrakte				
Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte:		EUR	1.141.094	
(Basiswert(e): Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Euro Schatz (2,0))				
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Gekaufte Kaufoptionen (Call):		EUR	305.352	
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))				
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):				
unbefristet		EUR	965.220	
(Basiswert(e): 0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26, 2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23, 2,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 11/21)				

Deka-BasisAnlage A60

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	26.925.062
Anteilwert	EUR	118,99

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 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, 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, Einlagenzertifikaten 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)

Verzinsliche Wertpapiere

Marktwert in EUR

284.592.137,40

in % des Fondsvermögens

8,88

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

DekaBank Deutsche Girozentrale

Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

277.769.307,40

6.822.830,00

Sitzstaat

Deutschland

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

284.592.137,40

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.

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindex (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX 50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder des GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter www.eurexrepo.com entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag in Höhe von 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

Deka-BasisAnlage A60

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

DKK
EUR
USD

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

Restlaufzeit 1-7 Tage
unbefristet

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

8.866.746,98
309.495.194,76

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds
Kostenanteil des Fonds
Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR in % der Bruttoerträge des Fonds

223.931,34 100,00
109.726,39 49,00
109.726,39 49,00

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihgeschäften 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 Wertpapierleihsätzen 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 Bruttoleihsatz.
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

12,99% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds")

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

Wertpapier-Darlehen

absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR

FMS Wertmanagement 28.747.486,01
DNB Boligkredit A.S. 23.008.350,85
Berlin Hyp AG 21.348.617,33
Philip Morris International Inc. 17.644.789,95
BMW Finance N.V. 15.067.533,12
McDonald's Corp. 13.593.661,44
Nordrhein-Westfalen, Land 13.200.639,36
Brandenburg, Land 12.839.904,53
Imperial Brands Finance PLC 12.777.490,60
Investitionsbank Berlin 11.574.077,57

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 3
Clearstream Banking Frankfurt 152.153.955,80 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus 7.833.526,71 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
J.P.Morgan AG Frankfurt 158.374.459,23 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.

Verwahrart 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%
Verwahrart 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 3. April 2018
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Informationen der Verwaltung.

Das DekaBank Depot – Service rund um Ihre Investmentfonds –

Mit dem DekaBank Depot bieten wir Ihnen die kostengünstige Möglichkeit, verschiedene Investmentfonds Ihrer Wahl in einem einzigen Depot und mit einem Freistellungsauftrag verwahren zu lassen. Hierfür steht Ihnen ein Fondsuniversum von rund 1.000 Fonds der Deka-Gruppe und international renommierter Kooperationspartner zur Verfügung. Das Spektrum eignet sich zur Realisierung der unterschiedlichsten Anlagekonzepte. So können Sie zum Vermögensaufbau aus mehreren Alternativen wählen, unter anderem:

- Für Investmentfonds-Anleger, die regelmäßig sparen möchten, eignet sich der individuell zu gestaltende Deka-FondsSparplan ab einer Mindestanlage von 25,– Euro. Im Rahmen eines auf die eigenen Bedürfnisse abgestimmten Deka-Auszahlplans lässt sich das so aufgebaute Vermögen später gezielt nutzen.
- Für alle, die regelmäßig für ein Kind sparen möchten, ist der Deka-JuniorPlan besonders geeignet. Mit Beträgen ab monatlich 25,– Euro wird für den Vermögensaufbau chancenreich und breit gestreut in Investmentfonds angelegt und dank eines professionellen Anlagemanagements langfristig hohe Ertragsmöglichkeiten genutzt sowie Risiken im Vergleich zu Anlagen in Einzeltiteln spürbar reduziert.

■ Für den systematischen und flexiblen Vermögensaufbau – insbesondere im Rahmen der privaten Altersvorsorge – können Sie zwischen zwei Varianten wählen:

- Deka-ZukunftsPlan: Die individuelle Vorsorgelösung mit intelligentem Anlagekonzept – auch mit Riester-Förderung.
- Deka-BasisRente: Kombiniert als Rürup-Lösung die Vorteile einer staatlich geförderten Investmentanlage mit dem Wachstumspotenzial einer optimierten Vermögensstruktur.

Für die Auftragserteilung können Sie verschiedene Wege nutzen, z.B. Post, Telefon oder Internet über unsere Webpräsenz www.deka.de

Auskünfte rund um das DekaBank Depot und Fondsinformationen erhalten Sie über unser Service-Telefon unter der Nummer (0 69) 7147-652. Sie erreichen uns montags bis freitags von 8.00 Uhr bis 18.00 Uhr.

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

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

gezeichnetes und
eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.
(Stand: 31. Dezember 2016)

Alleingesellschafterin

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Rüdiger

Vorsitzender des Vorstandes der
DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;

Mitglied des Aufsichtsrates der
Deka Immobilien GmbH,
Frankfurt am Main

und der

Deka Vermögensmanagement GmbH,
Berlin

Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better

Mitglied des Vorstandes der
DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;

Stellvertretende Vorsitzende des
Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH,
Berlin

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 Dresden,
Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse,
Münster

Peter Scherkamp, München

(Stand 10. April 2018)

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)

Vorsitzender des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH,
Berlin

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

Vorsitzender des Aufsichtsrats der
Deka International S.A.,
Luxemburg

und der

International Fund Management S.A.,
Luxemburg

(Stand 10. April 2018)

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sonder- vermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squire
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Eigenkapital

gezeichnetes und eingezahltes

Kapital: EUR 447,9 Mio.

Eigenmittel: EUR 5.366 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2016)

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft
sowie Wertpapiergeschäft

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt

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