

Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2024.

## **Deka-PB Multi Asset Quant**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



**.Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2024

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Dekap-B Multi Asset Quant für den Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024.

Der Trend rückläufiger Inflationsraten in den vergangenen sechs Monaten stabilisierte die Finanzmärkte und verlieh den Aktienbörsen weiterhin kräftigen Auftrieb. Gleichwohl findet die europäische Wirtschaft nur langsam zurück auf den Aufwärtspfad. Die deutsche Volkswirtschaft wies im ersten Quartal 2024 wieder Erholungstendenzen auf, nachdem das größte EWU-Mitglied 2023 noch als Wachstumsstütze ausgefallen war. Während sich in Europa ein moderates Anziehen der wirtschaftlichen Aktivität abzeichnet, präsentierte sich die Wirtschaftslage in den USA hingegen sehr robust, auch die Schwellenländer wachsen solide. Jedoch sorgten die anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren wie der Ukraine-Krieg oder der Nahost-Konflikt im Berichtszeitraum wiederholt für Verunsicherung.

Die Geld- und Fiskalpolitik der bedeutenden Notenbanken konzentrierte sich weiterhin auf die Inflationsbekämpfung, wobei sich die Hinweise für eine Senkung der Leitzinsen zur Jahresmitte verdichteten. Im ersten Quartal 2024 sorgten allerdings die Daten zur Preisentwicklung in den USA für Ernüchterung und wieder steigende Renditen. Die Fed behielt das Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bei. Die EZB senkte hingegen den Hauptrefinanzierungssatz im Juni von 4,50 Prozent um 25 Basispunkte auf 4,25 Prozent. Die Verzinsung 10-jähriger deutscher Bundesanleihen lag Ende Juni bei 2,5 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten mit 4,4 Prozent. Damit legten die Renditen auf Halbjahressicht zu.

Die globalen Zinssenkungserwartungen waren ein Antriebsfaktor für die Kurse der weltweiten Aktienmärkte, die sich in der Breite in einer freundlichen Verfassung zeigten. Der DAX in Deutschland und der Dow Jones Industrial in den USA kletterten zwischenzeitlich jeweils auf ein Rekordhoch und in Japan überwand der Nikkei 225 die Rekordmarke aus dem Jahr 1989. Die großen US-Technologiewerte mit Bezug zum Trendthema Künstliche Intelligenz verzeichneten dabei die stärksten Zuwächse.

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 Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024	7
Anhang	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-PB Multi Asset Quant Anlagepolitik.

Anlageziel des Fonds ist die Erwirtschaftung eines angemessenen Ertrages durch das weltweite Ausnutzen von Renditepotentialen an den bedeutendsten Aktien- und Rentenmärkten. Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Fonds weltweit in verzinsliche Wertpapiere sowie Aktien an. Sollte zu einem Zeitpunkt keine der Investitionsmöglichkeiten den Erwartungen des Fondsmanagements entsprechen, kann zu einem beträchtlichen Teil in kurzfristige liquide Geldanlagen angelegt werden. Die maximale Aktienquote des Fonds beträgt 35%.

Dem Fonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess erfolgt maßgeblich im Rahmen der quantitativen Anlagestrategie „Sigma Plus“. Bei dieser werden auf monatlicher Basis die erwarteten Erträge aller relevanten Anlageklassen und Märkte prognostiziert sowie die aktuelle Prognosegüte bewertet. Beides fließt anschließend in ein robustes Optimierungsverfahren ein, worüber die optimale Zusammensetzung des Portfolios auf Ebene der verschiedenen Kategorien von Vermögensgegenständen bestimmt wird. Für die Kategorien Aktien und Unternehmensanleihen folgt danach üblicherweise eine auf einer großen Anzahl von Faktoren basierende Einzeltitelauswahl sowie im Rentenportfolio eine aktive Durationssteuerung. Das Konzept strebt dabei die Erzielung einer stabilen Wertentwicklung mit kontrolliertem Risiko bei gleichzeitigem Fokus auf absoluten Ertrag an. Zudem generiert die Strategie lediglich Signale zur Entscheidungsunterstützung. Die Umsetzung der Signale erfolgt im Ermessen des Fondsmanagements. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Fondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist. Ergänzend wird ein Machine Learning Modell zur Identifikation kurzfristiger Renditechancen eingesetzt. Das Machine Learning basierte Modell nutzt u.a. technische Indikatoren und wird darauf trainiert, Märkte/Wertpapiere mit hoher kurzfristiger Outperformance-Wahrscheinlichkeit zu identifizieren. Es erfolgen Investitionen in die Märkte/Wertpapiere mit den höchsten Outperformance-Wahrscheinlichkeiten, um so systematisch Renditeverbesserungen für den Fonds zu ermöglichen. Das Machine Learning Modell generiert lediglich Signale zur Entscheidungsunterstützung. Die Umsetzung der Signale erfolgt im Ermessen des Fondsmanagements. Des Weiteren wird die Anlageklasse „Volatilität“ genutzt um einen marktphasenunabhängigen Wertzuwachs zu generieren. Wiederkehrende und persistente Eigenschaften der Volatilität diverser Aktienmärkte sind die Hauptrenditequellen. Investiert wird in mehrere Volatilitätsstrategien im Sinne eines Relative- Value Ansatzes (Long/Short Strategien), um durch die Vielzahl der Strategien und die Marktneutralität der Relative-Value Trades eine hohe Diversifikationswirkung im Fonds sowie eine geringe Korrelation mit klassischen Anlageklassen zu erzielen. Die Umsetzung der Strategien erfolgt über hochliquide Optionen und Futures.

## Wichtige Kennzahlen

### Deka-PB Multi Asset Quant

Performance*	6 Monate
	3,1%
ISIN	DE000DK2CCQ6

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

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.

# Deka-PB Multi Asset Quant

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024.

### Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>16.332.621,44</b>	<b>22,46</b>
Australien	167.940,27	0,24
Dänemark	235.668,15	0,33
Deutschland	229.863,58	0,32
Finnland	55.835,52	0,08
Frankreich	294.531,53	0,40
Großbritannien	603.793,93	0,82
Irland	446.793,43	0,62
Italien	260.309,53	0,37
Japan	827.758,97	1,14
Kanada	391.035,97	0,54
Niederlande	151.422,88	0,21
Schweden	155.088,29	0,21
Schweiz	494.698,71	0,68
Spanien	186.178,42	0,25
USA	11.831.702,26	16,25
<b>2. Anleihen</b>	<b>9.131.947,09</b>	<b>12,59</b>
Deutschland	1.303.657,50	1,79
Frankreich	1.933.070,00	2,67
Großbritannien	961.776,28	1,33
Italien	618.003,00	0,85
Schweden	298.020,00	0,41
Spanien	893.703,00	1,23
USA	3.123.717,31	4,31
<b>3. Investmentanteile</b>	<b>43.041.101,37</b>	<b>59,45</b>
Deutschland	21.271.098,74	29,36
Irland	13.754.452,24	19,01
Luxemburg	8.015.550,39	11,08
<b>4. Derivate</b>	<b>-307.395,97</b>	<b>-0,43</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>3.336.303,82</b>	<b>4,61</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>1.008.852,76</b>	<b>1,39</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-51.786,07</b>	<b>-0,07</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>72.491.644,44</b>	<b>100,00</b>

### Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien</b>	<b>16.332.621,44</b>	<b>22,46</b>
AUD	167.940,27	0,24
CAD	391.035,97	0,54
CHF	494.698,71	0,68
DKK	235.668,15	0,33
EUR	1.178.141,46	1,63
GBP	684.011,56	0,93
JPY	827.758,97	1,14
SEK	155.088,29	0,21
USD	12.198.278,06	16,76
<b>2. Anleihen</b>	<b>9.131.947,09</b>	<b>12,59</b>
EUR	5.842.806,00	8,05
USD	3.289.141,09	4,54
<b>3. Investmentanteile</b>	<b>43.041.101,37</b>	<b>59,45</b>
EUR	31.333.971,13	43,27
USD	11.707.130,24	16,18
<b>4. Derivate</b>	<b>-307.395,97</b>	<b>-0,43</b>
<b>5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>3.336.303,82</b>	<b>4,61</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>1.008.852,76</b>	<b>1,39</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-51.786,07</b>	<b>-0,07</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>72.491.644,44</b>	<b>100,00</b>

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

# Deka-PB Multi Asset Quant

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>22.175.427,44</b>	<b>30,51</b>
<b>Aktien</b>								<b>16.332.621,44</b>	<b>22,46</b>
<b>EUR</b>								<b>1.178.141,46</b>	<b>1,63</b>
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		2.435	0	0	EUR 27,750	67.571,25	0,09
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK		2.366	0	0	EUR 23,500	55.601,00	0,08
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		2.569	0	0	EUR 30,570	78.534,33	0,11
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		8.831	0	0	EUR 9,340	82.481,54	0,11
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.	STK		985	985	0	EUR 59,800	58.903,00	0,08
IT0000066123	BPER Banca S.p.A. Azioni nom.	STK		9.243	9.243	0	EUR 4,759	43.987,44	0,06
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur	STK		1.236	0	0	EUR 73,200	90.475,20	0,12
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		7.076	0	0	EUR 12,410	87.813,16	0,12
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur	STK		31	0	20	EUR 2.149,000	66.619,00	0,09
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK		2.231	0	0	EUR 46,480	103.696,88	0,14
DE0006231004	Infinion Technologies AG Namens-Aktien	STK		2.007	0	0	EUR 34,660	69.562,62	0,10
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK		23.988	0	0	EUR 3,508	84.149,90	0,12
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK		23.455	0	0	EUR 3,575	83.851,63	0,12
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		154	0	0	EUR 470,700	72.487,80	0,10
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK		4.992	4.992	0	EUR 11,185	55.835,52	0,08
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom.	STK		2.214	0	1.407	EUR 34,585	76.571,19	0,11
<b>AUD</b>								<b>167.940,27</b>	<b>0,24</b>
AU000000ALL7	Aristocrat Leisure Ltd. Reg.Shares	STK		1.425	1.425	0	AUD 49,760	43.971,09	0,06
AU000000FMG4	Fortescue Ltd. Reg.Shares	STK		5.191	5.191	0	AUD 21,410	68.919,12	0,10
AU000000RIO1	Rio Tinto Ltd. Reg.Shares	STK		746	0	0	AUD 119,000	55.050,06	0,08
<b>CAD</b>								<b>391.035,97</b>	<b>0,54</b>
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs ClA (Sub.Vtg)	STK		700	0	0	CAD 137,440	65.600,02	0,09
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK		20	20	0	CAD 3.927,500	53.559,80	0,07
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK		3.400	0	0	CAD 36,290	84.131,50	0,12
CA67077M1086	Nutrien Ltd Reg.Shares	STK		1.200	1.200	0	CAD 71,160	58.225,06	0,08
CA8849038085	Thomson Reuters Corp. Reg.Shares	STK		501	501	0	CAD 233,480	79.759,09	0,11
CA8911021050	Toromont Industries Ltd. Reg.Shares	STK		600	600	0	CAD 121,630	49.760,50	0,07
<b>CHF</b>								<b>494.698,71</b>	<b>0,68</b>
CH0012221716	ABB Ltd. Namens-Aktien	STK		2.135	1.075	0	CHF 50,060	111.066,99	0,15
CH0012214059	Holcim Ltd. Namens-Aktien	STK		1.026	0	0	CHF 79,620	84.891,81	0,12
CH0025751329	Logitech International S.A. Namens-Aktien	STK		668	668	0	CHF 87,500	60.740,84	0,08
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		1.464	0	0	CHF 96,120	146.234,93	0,20
CH2044767585	UBS Group AG Namens-Aktien	STK		3.306	0	0	CHF 26,710	91.764,14	0,13
<b>DKK</b>								<b>235.668,15</b>	<b>0,33</b>
DK0062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		1.758	0	0	DKK 999,800	235.668,15	0,33
<b>GBP</b>								<b>684.011,56</b>	<b>0,93</b>
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares	STK		2.303	0	0	GBP 31,080	84.604,17	0,12
GB00B033F229	Centrica PLC Reg.Shares	STK		43.558	0	0	GBP 1,371	70.560,85	0,10
IE0001827041	CRH PLC Reg.Shares	STK		1.146	1.146	0	GBP 59,220	80.217,63	0,11
GB00BN75WP63	GSK PLC Reg.Shares	STK		5.408	0	0	GBP 15,305	97.833,33	0,13
GB0004544929	Imperial Brands PLC Reg.Shares	STK		3.119	0	0	GBP 20,290	74.802,17	0,10
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC Reg.Shares	STK		13.653	13.653	0	GBP 4,614	74.459,90	0,10
GB00BLGZ9862	Tesco PLC Reg.Shs	STK		20.746	0	0	GBP 3,092	75.821,20	0,10
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK		2.436	0	0	GBP 43,660	125.712,31	0,17
<b>JPY</b>								<b>827.758,97</b>	<b>1,14</b>
JP3429800000	ANA Holdings Inc. Reg.Shares	STK		3.300	0	0	JPY 2.969,500	56.915,06	0,08
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK		9.000	0	0	JPY 1.720,000	89.908,52	0,12
JP3143600009	ITOCHU Corp. Reg.Shares	STK		2.300	0	0	JPY 7.854,000	104.917,67	0,14
JP3726800000	Japan Tobacco Inc. Reg.Shares	STK		3.000	0	0	JPY 4.348,000	75.760,13	0,10
JP3386030005	JFE Holdings Inc. Reg.Shares	STK		4.297	4.297	0	JPY 2.315,500	57.788,32	0,08
JP3304200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares	STK		2.900	0	0	JPY 4.671,000	78.675,19	0,11
JP3381000003	Nippon Steel Corp. Reg.Shares	STK		3.200	0	0	JPY 3.401,000	63.210,11	0,09
JP3762600009	Nomura Holdings Inc. Reg.Shares	STK		14.302	14.302	0	JPY 922,000	76.587,45	0,11
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares	STK		3.000	0	2.200	JPY 3.552,000	61.890,52	0,09
JP3180400008	Osaka Gas Co. Ltd. Reg.Shares	STK		2.793	2.793	0	JPY 3.543,000	57.474,08	0,08
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares	STK		3.000	0	0	JPY 6.005,000	104.631,92	0,14
<b>SEK</b>								<b>155.088,29</b>	<b>0,21</b>
SE0015811963	Investor AB Namn-Aktier B (fria)	STK		2.066	2.066	0	SEK 290,750	52.722,82	0,07
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria)	STK		3.804	3.804	0	SEK 156,300	52.185,28	0,07
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A	STK		5.655	0	4.185	SEK 101,100	50.180,19	0,07
<b>USD</b>								<b>12.198.278,06</b>	<b>16,76</b>
US88579Y1010	3M Co. Reg.Shares	STK		921	0	0	USD 103,170	88.819,94	0,12
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares	STK		1.243	0	0	USD 104,650	121.592,77	0,17
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares	STK		832	0	0	USD 168,990	131.426,14	0,18
US0028962076	Abercrombie & Fitch Co. Reg.Shares Cl.A	STK		324	324	0	USD 172,530	52.252,50	0,07
US00402L1070	Academy Sports & Outdoors Inc Reg.Shares	STK		1.292	0	0	USD 53,290	64.358,46	0,09
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A	STK		400	0	0	USD 303,190	113.363,25	0,16
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares	STK		284	0	0	USD 546,760	145.148,48	0,20
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK		602	0	0	USD 130,800	73.604,04	0,10

# Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US01973R1014	Allison Transmission Hldg.Inc. Reg.Shares		STK	1.210	0	0	USD 74,290	84.025,89	0,12
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C		STK	1.094	0	0	USD 186,860	191.086,97	0,26
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	1.825	736	121	USD 185,410	316.295,80	0,44
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares		STK	2.018	0	302	USD 197,850	373.211,16	0,51
US02553E1064	Amer. Eagle Outfitters Inc. Reg.Shares		STK	3.429	3.429	0	USD 20,100	64.425,97	0,09
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	3.608	0	460	USD 214,100	722.072,16	1,00
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares		STK	532	310	204	USD 232,530	115.634,66	0,16
US0394831020	Archer Daniels Midland Co. Reg.Shares		STK	1.230	0	0	USD 60,610	69.686,20	0,10
US0476491081	Atkore Inc. Reg.Shares		STK	347	0	288	USD 132,530	42.987,39	0,06
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	500	0	0	USD 237,300	110.908,58	0,15
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New		STK	191	0	0	USD 407,950	72.834,60	0,10
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares		STK	1.197	0	0	USD 84,320	94.345,71	0,13
US09857L1089	Booking Holdings Inc. Reg.Shares		STK	31	0	9	USD 4.009,400	116.181,90	0,16
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares		STK	114	66	0	USD 1.586,660	169.077,62	0,23
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)		STK	743	0	0	USD 87,730	60.930,44	0,08
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	245	0	156	USD 307,920	70.518,23	0,10
US1475281036	Casey's General Stores Inc. Reg.Shares		STK	206	0	0	USD 382,870	73.725,20	0,10
US1491231015	Caterpillar Inc. Reg.Shares		STK	294	294	0	USD 327,460	89.991,81	0,12
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares		STK	375	0	0	USD 170,220	59.667,69	0,08
US03073E1055	Cencora Inc. Reg.Shares		STK	383	383	0	USD 227,960	81.612,15	0,11
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares		STK	958	0	0	USD 156,320	139.983,70	0,19
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	2.479	0	0	USD 47,450	109.953,78	0,15
US12572Q1058	CME Group Inc. Reg.Shares		STK	490	490	0	USD 195,530	89.558,52	0,12
US1999081045	Comfort Systems USA Inc. Reg.Shares		STK	231	382	151	USD 315,930	68.218,20	0,09
US20825C1045	ConocoPhillips Reg.Shares		STK	979	0	0	USD 113,970	104.296,72	0,14
US2435371073	Deckers Outdoor Corp. Reg.Shares		STK	101	0	42	USD 999,910	94.401,67	0,13
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	2.584	0	624	USD 22,420	54.153,37	0,07
US26856L1035	E.L.F. Beauty Inc. Reg.Shares		STK	261	0	254	USD 218,000	53.185,64	0,07
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	253	0	0	USD 535,770	126.705,75	0,17
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares		STK	170	58	0	USD 909,040	144.453,92	0,20
US2925621052	Encore Wire Corp. Reg.Shares		STK	346	0	135	USD 289,750	93.712,38	0,13
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares		STK	957	0	603	USD 114,900	102.784,91	0,14
US3647601083	Gap Inc. Reg.Shares		STK	2.587	2.587	0	USD 24,030	58.109,56	0,08
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	177	0	0	USD 444,770	73.587,86	0,10
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	1.293	0	0	USD 68,830	83.190,49	0,11
US3802371076	GoDaddy Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	475	475	0	USD 140,240	62.267,71	0,09
US4039491000	HF Sinclair Corp. Reg.Shares		STK	1.346	0	0	USD 52,730	66.343,78	0,09
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	1.333	0	0	USD 74,210	92.467,69	0,13
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares		STK	193	0	0	USD 362,980	65.484,33	0,09
US45867G1013	InterDigital Inc. (Pa) Reg.Shares		STK	871	871	0	USD 116,040	94.476,39	0,13
US4612021034	Intuit Inc. Reg.Shares		STK	175	0	60	USD 651,440	106.563,84	0,15
US4663131039	Jabil Inc. Reg.Shares		STK	472	0	0	USD 107,920	47.614,73	0,07
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	1.061	0	0	USD 145,800	144.600,67	0,20
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	437	0	0	USD 199,170	81.358,47	0,11
US48666K1097	KB Home Reg.Shares		STK	1.007	0	0	USD 69,510	65.429,58	0,09
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares		STK	122	122	0	USD 1.055,830	120.406,86	0,17
US5165441032	Lantheus Holdings Inc. Reg.Shares		STK	746	746	0	USD 81,310	56.699,63	0,08
US5627501092	Manhattan Associates Inc. Reg.Shares		STK	350	0	0	USD 251,210	82.186,86	0,11
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	378	0	0	USD 210,940	74.532,92	0,10
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares		STK	1.084	0	0	USD 66,400	67.281,36	0,09
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A		STK	252	0	0	USD 442,750	104.293,33	0,14
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	133	0	0	USD 593,200	73.747,99	0,10
US58506Q1094	Medpace Holdings Inc. Reg.Shares		STK	188	0	0	USD 424,340	74.570,87	0,10
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	804	0	0	USD 129,820	97.565,23	0,13
US30303M1027	Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	479	0	0	USD 519,560	232.631,56	0,32
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	2.093	161	287	USD 452,850	885.974,06	1,22
US6078281002	Modine Manufacturing Co. Reg.Shares		STK	703	703	0	USD 98,000	64.398,95	0,09
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	237	237	0	USD 302,830	67.087,97	0,09
US6267551025	Murphy USA Inc. Reg.Shares		STK	188	0	0	USD 474,090	83.313,63	0,11
US65336K1034	Nextstar Media Group Inc. Reg.Shares		STK	511	0	0	USD 159,800	76.329,97	0,11
US65341B1061	NextEra Energy Part.L.P. Reg.Uts rep.Ltd.Part.Int.		STK	2.582	0	0	USD 28,480	68.737,48	0,09
US6703461052	Nucor Corp. Reg.Shares		STK	421	0	0	USD 154,710	60.883,26	0,08
IE00BDVJQ556	nVent Electric PLC Reg.Shares		STK	1.237	0	0	USD 76,140	88.039,99	0,12
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares		STK	7.260	6.563	134	USD 123,990	841.435,22	1,16
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	256	0	382	USD 171,870	41.127,99	0,06
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares		STK	959	0	316	USD 103,970	93.201,75	0,13
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares		STK	870	0	0	USD 117,840	95.831,74	0,13
US69318G1067	PBF Energy Inc. Reg.Shs Cl.A		STK	1.667	0	0	USD 45,100	70.276,41	0,10
IE00BLS09M33	Pentair PLC Reg.Shares		STK	1.117	1.117	0	USD 76,050	79.405,36	0,11
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares		STK	657	0	425	USD 109,750	67.401,15	0,09
US74758T3032	Qualys Inc. Reg.Shares		STK	481	481	0	USD 142,280	63.971,47	0,09
US7595091023	Reliance Inc. Reg.Shares		STK	203	0	0	USD 280,640	53.252,87	0,07
US7703231032	Robert Half Inc. Reg.Shares		STK	1.134	0	0	USD 63,480	67.289,51	0,09
US7766961061	Roper Technologies Inc. Reg.Shares		STK	199	0	0	USD 562,060	104.552,20	0,14
US79466L3024	Salesforce Inc. Reg.Shares		STK	586	0	0	USD 252,850	138.502,62	0,19
US81762P1021	ServiceNow Inc. Reg.Shares		STK	156	156	0	USD 774,130	112.884,91	0,16
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares		STK	279	0	0	USD 258,910	67.522,80	0,09
US85208M1027	Sprouts Farmers Market Inc. Reg.Shares		STK	914	0	742	USD 81,680	69.784,56	0,10
US858191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares		STK	647	0	0	USD 125,050	75.628,48	0,10

# Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares		STK	1.276	0	0	USD 44,230	52.755,17	0,07
US8716071076	Synopsys Inc. Reg.Shares		STK	157	0	65	USD 595,000	87.320,06	0,12
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares		STK	455	0	249	USD 197,420	83.965,32	0,12
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	562	0	0	USD 166,620	87.530,79	0,12
US8894781033	Toll Brothers Inc. Reg.Shares		STK	519	0	404	USD 115,170	55.873,28	0,08
IE00BK9ZQ967	Trane Technologies PLC Reg.Shares		STK	275	275	0	USD 333,650	85.767,20	0,12
US90384S3031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares		STK	177	0	0	USD 385,950	63.856,00	0,09
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares		STK	151	151	182	USD 623,040	87.940,77	0,12
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	411	63	0	USD 486,440	186.882,45	0,26
US92343E1029	Verisign Inc. Reg.Shares		STK	402	0	0	USD 178,230	66.973,70	0,09
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	2.978	0	0	USD 40,820	113.630,55	0,16
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	148	0	0	USD 472,510	65.368,74	0,09
US9256521090	Vici Properties Inc. Reg.Shares		STK	3.024	0	0	USD 28,430	80.362,98	0,11
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares CIA		STK	779	0	0	USD 266,590	194.123,77	0,27
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	115	0	0	USD 903,740	97.149,09	0,13
US9553061055	West Pharmaceutical Services Inc Reg.Shares		STK	236	111	164	USD 328,760	72.525,11	0,10
US9598021098	Western Union Co. Reg.Shares		STK	6.203	0	0	USD 12,000	69.579,36	0,10
US9699041011	Williams-Sonoma Inc. Reg.Shares		STK	274	0	196	USD 287,300	73.584,03	0,10
US98138H1014	Workday Inc. Reg.Shares A		STK	357	165	206	USD 223,360	74.536,85	0,10
US98978V1035	Zoetis Inc. Reg.Shares CIA		STK	516	0	0	USD 176,460	85.112,51	0,12
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>5.842.806,00</b>	<b>8,05</b>
<b>EUR</b>								<b>5.842.806,00</b>	<b>8,05</b>
ES0205032008	2,5000 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 14/24		EUR	300.000	0	0	% 99,937	299.811,00	0,41
XS2051397961	0,6250 % Glencore Finance (Europe) Ltd. MTN 19/24		EUR	500.000	0	0	% 99,358	496.787,50	0,69
XS2030530450	1,0000 % Jefferies Financial Group Inc. MTN 19/24		EUR	300.000	0	0	% 99,855	299.565,00	0,41
ES0000012L52	3,1500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33		EUR	600.000	0	0	% 98,982	593.892,00	0,82
DE000A289NQ8	0,0500 % Land Brandenburg Schatzanw. 21/31		EUR	1.000.000	0	2.000.000	% 82,237	822.370,00	1,13
DE000RLP0728	0,7500 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 16/26		EUR	500.000	0	0	% 96,258	481.287,50	0,66
FR0011461037	3,2500 % Rep. Frankreich OAT 13/45		EUR	1.000.000	1.000.000	0	% 94,875	948.750,00	1,31
FR001400H7V7	3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33		EUR	1.000.000	0	400.000	% 98,432	984.320,00	1,36
IT0005544082	4,3500 % Republik Italien B.T.P. 23/33		EUR	600.000	0	0	% 103,001	618.003,00	0,85
XS1493333717	0,8750 % Swedish Match AB MTN 16/24		EUR	300.000	0	0	% 99,340	298.020,00	0,41
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>3.289.141,09</b>	<b>4,54</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>3.289.141,09</b>	<b>4,54</b>
<b>USD</b>								<b>3.289.141,09</b>	<b>4,54</b>
US034863AS94	3,6250 % Anglo American Capital PLC Notes 17/24 144A		USD	500.000	0	0	% 99,489	464.988,78	0,64
US695156AR08	3,6500 % Packaging Corp. of America Notes 14/24		USD	300.000	0	0	% 99,463	278.918,96	0,38
US912810QC53	4,5000 % U.S. Treasury Notes 09/39		USD	500.000	0	1.000.000	% 101,555	474.643,34	0,65
US912810SH23	2,8750 % U.S. Treasury Notes 19/49		USD	1.800.000	1.800.000	0	% 75,234	1.265.861,61	1,76
US912828Z948	1,5000 % U.S. Treasury Notes 20/30		USD	1.000.000	0	0	% 86,090	804.728,40	1,11
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>43.041.101,37</b>	<b>59,45</b>
<b>KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>21.271.098,74</b>	<b>29,36</b>
<b>EUR</b>								<b>21.271.098,74</b>	<b>29,36</b>
DE000ETF375	Deka iBoxx EUR Liquid Corporates Diversified UCITS ETF		ANT	100.010	6.000	23.000	EUR 99,874	9.988.398,74	13,79
DE0005424568	Deka-Vega Plus I (A)		ANT	165.000	0	0	EUR 68,380	11.282.700,00	15,57
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>4.955.300,19</b>	<b>6,85</b>
<b>EUR</b>								<b>4.955.300,19</b>	<b>6,85</b>
LU1685587914	Deka-MultiFactor Emerging Markets Corporates I		ANT	28.428	0	0	EUR 80,920	2.300.393,76	3,18
LU1685588219	Deka-MultiFactor Global Corporates I		ANT	5.197	0	0	EUR 83,440	433.637,68	0,60
LU1685587591	Deka-MultiFactor Global Corporates HY I		ANT	25.929	0	0	EUR 85,580	2.219.003,82	3,07
LU0297135294	Deka-OptiRent CF		ANT	10	0	0	EUR 121,580	1.215,80	0,00
LU0332479749	Deka-OptiRent TF		ANT	9	0	0	EUR 116,570	1.049,13	0,00
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>16.814.702,44</b>	<b>23,24</b>
<b>EUR</b>								<b>5.107.572,20</b>	<b>7,06</b>
IE00BKLC5874	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	460.000	80.000	80.000	EUR 4,451	2.047.322,00	2,83
LU1829218749	MUL-Am.Bi.E.-W.Comm.xAgr.U.ETF Namens-Ant. Acc.		ANT	127.830	124.670	74.980	EUR 23,940	3.060.250,20	4,23
<b>USD</b>								<b>11.707.130,24</b>	<b>16,18</b>
IE0032895942	iShs DL Corp Bond UCITS ETF Reg.Shares		ANT	65.010	9.000	15.000	USD 101,050	6.140.643,58	8,48
IE00BKFO9C98	iShs II-\$ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	411.700	198.600	170.000	USD 4,478	1.723.267,37	2,39
IE00B2NPKV68	iShsII-J.P.M.USD EM Bond U.ETF Reg.Shares		ANT	47.400	15.600	14.800	USD 86,740	3.843.219,29	5,31
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>68.505.669,90</b>	<b>94,50</b>
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									



# Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
								<b>-11.262,01</b>	<b>-0,03</b>	
AEX Future (AEX) Juli 24		XAMS	EUR	Anzahl 26				11.933,30	0,02	
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) Sep. 24		XIOM	USD	Anzahl 1				3.267,90	0,00	
E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) Sep. 24		XCME	USD	Anzahl 4				2.787,54	0,00	
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 24		XCME	USD	Anzahl 1				2.012,81	0,00	
ESTX Mid Index Future (FMCE) Sep. 24		XEUR	EUR	Anzahl 13				-4.095,00	-0,01	
MDAX Mini Future (FSMX) Sep. 24		XEUR	EUR	Anzahl 11				-4.702,39	-0,01	
MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) Sep. 24		IFUS	USD	Anzahl 41				29.893,44	0,04	
MSCI World Index Future (FMWO) Sep. 24		XEUR	USD	Anzahl -46				-60.198,17	-0,08	
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 24		XMOD	CAD	Anzahl 1				2.739,96	0,00	
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 24		XSFE	AUD	Anzahl 1				1.131,71	0,00	
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (ITI) Sep. 24		XOSE	JPY	Anzahl 1				3.966,89	0,01	
								<b>-20.061,07</b>	<b>-0,02</b>	
<b>Optionsrechte</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktienindizes</b>										
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juli 24 4900		XEUR		Anzahl -42			EUR	77,000	-32.340,00	-0,04
S & P 500 Index (S500) Put Juli 24 5450		XCBO		Anzahl 4			USD	32,840	12.278,93	0,02
								<b>EUR</b>	<b>-31.323,08</b>	<b>-0,05</b>
<b>Zins-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Zinsterminkontrakte</b>										
								<b>-58.085,61</b>	<b>-0,08</b>	
10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 24		XEUR	EUR	600.000				-5.558,00	-0,01	
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 24		XEUR	EUR	-1.000.000				-19.229,80	-0,03	
EURO Buxl Future (FGBX) Sep. 24		XEUR	EUR	300.000				1.440,00	0,00	
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 24		XEUR	EUR	400.000				-7.560,00	-0,01	
Long Gilt Future (FLG) Sep. 24		IFEU	GBP	700.000				5.129,87	0,01	
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 24		XEUR	EUR	-1.900.000				14.809,77	0,02	
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 24		XCBT	USD	-4.800.000				-44.167,13	-0,06	
Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB) Sep. 24		XCBT	USD	-400.000				-7.302,77	-0,01	
Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) Sep. 24		XCBT	USD	400.000				5.374,84	0,01	
US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 24		XCBT	USD	-100.000				-1.022,39	0,00	
								<b>EUR</b>	<b>-58.085,61</b>	<b>-0,08</b>
<b>Devisen-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>										
<b>Offene Positionen</b>										
GBP/EUR 100.000,00		OTC						-869,10	0,00	
SEK/EUR 4.850.000,00		OTC						2.846,27	0,00	
USD/EUR 13.700.000,00		OTC						-219.964,45	-0,30	
								<b>EUR</b>	<b>-217.987,28</b>	<b>-0,30</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>										
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	1.078.795,32			%	100,000	1.078.795,32	1,50
<b>EUR-Guthaben bei</b>										
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	62.458,48			%	100,000	62.458,48	0,09
Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-			EUR	1.470,98			%	100,000	1.470,98	0,00
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	541.094,65			%	100,000	72.550,79	0,10
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	548.140,19			%	100,000	47.973,06	0,07
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	5.384.043,24			%	100,000	472.560,15	0,65
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	200.997,21			%	100,000	124.641,32	0,17
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	429.241,80			%	100,000	292.681,16	0,40
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	26.834,22			%	100,000	27.885,94	0,04
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	202.223,34			%	100,000	239.027,62	0,33
DekaBank Deutsche Girozentrale			HKD	11.447,34			%	100,000	1.370,33	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	51.354.271,00			%	100,000	298.267,87	0,41
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	659.660,93			%	100,000	616.620,80	0,85
								<b>EUR</b>	<b>3.336.303,82</b>	<b>4,61</b>
								<b>EUR</b>	<b>3.336.303,82</b>	<b>4,61</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
Zinsansprüche			EUR	56.910,36				56.910,36	0,08	
Dividendenansprüche			EUR	11.165,21				11.165,21	0,02	
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	906.368,17				906.368,17	1,25	
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	24.577,90				24.577,90	0,03	
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	9.831,12				9.831,12	0,01	
								<b>EUR</b>	<b>1.008.852,76</b>	<b>1,39</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-51.786,07				-51.786,07	-0,07	
								<b>EUR</b>	<b>-51.786,07</b>	<b>-0,07</b>

# Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Fondsvermögen</b>							EUR	72.491.644,44	100,00	
<b>Umlaufende Anteile</b>							STK	630.562,000		
<b>Anteilwert</b>							EUR	114,96		

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

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2024

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,84603	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45815	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,42600	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,39335	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,96229	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06980	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46659	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	172,17500	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,35370	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,61261	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XAMS	Amsterdam - Euronext Amsterdam - Derivatives
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XIOM	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Option Market (IOM)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
IFUS	New York/N.Y. - ICE Futures U.S.
XCME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options

### OTC

Over-the-Counter

## Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>AUD</b>				
AU000000PLS0	Pilbara Minerals Ltd. Reg.Shares	STK	0	20.978
<b>CAD</b>				
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares	STK	0	900
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK	0	1.100
<b>EUR</b>				
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien	STK	0	795
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK	0	203
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK	0	5.805
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK	0	422
<b>GBP</b>				
GB0006731235	Associated British Foods PLC Reg.Shares	STK	0	1.320
<b>JPY</b>				
JP3294460005	Inpex Corp. Reg.Shares	STK	0	2.100
JP3877600001	Marubeni Corp. Reg.Shares	STK	0	3.300
JP3893600001	Mitsui & Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.700
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.500
JP3635000007	Toyota Tsusho Corp. Reg.Shares	STK	0	1.700
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	6.900
<b>SEK</b>				
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK	0	4.992
<b>USD</b>				
IE00BFRT3W74	Allegion PLC Reg.Shares	STK	0	789
US0017441017	AMN Healthcare Services Inc. Reg.Shares	STK	0	735
US12008R1077	Builders Firstsource Inc. Reg.Shares	STK	0	326
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares	STK	0	1.693
US3032501047	Fair Isaac Corp. Reg.Shares	STK	0	16
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares	STK	0	2.976
US53115L1044	Liberty Energy Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	1.847	1.847
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK	0	74
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK	0	2.894
US8175651046	Service Corp. International Reg.Shares	STK	0	1.305
US83444M1018	Solventum Corp. Reg.Shares	STK	230	230
US88076W1036	Teradata Corp. Reg.Shares	STK	0	1.183
US14316J1088	The Carlyle Group Inc. Reg.Shares	STK	986	986

# Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares	STK	0	2.101
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares	STK	0	110
US87256C1018	TKO Group Holdings Inc. Reg.Shares Class A	STK	0	800
US9746371007	Winnbago Industries Inc. Reg.Shares	STK	0	989
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares	STK	0	691
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>EUR</b>				
XS1515173315	0,7500 % Fonterra Co-Operative Grp Ltd. MTN 16/24	EUR	0	400.000
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
<b>USD</b>				
US28370TAG40	4,3000 % Kinder Morgan Energy Partn. LP Notes 14/24	USD	0	900.000
US912828U246	2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26	USD	0	2.500.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): Amsterdam EXchanges (AEX) Index, CAC 40 INDEX, DAX Performance-Index, ESTX Mid Index (Price) (EUR), EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, FTSE MIB Index, IBEX 35 Index, MDAX Performance-Index, MSCI Emerging Markets Index (USD), Nasdaq-100 Index, Nikkei 225 Stock Average Index (JPY), OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), OMX Stockholm 30 Index, Russell 2000 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))	EUR	344.404
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): MSCI World (Price weighted) Index (Net Ret.) (USD))	EUR	4.497
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Buxl Future (FGBX), EURO-BTP Future (FBTP), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY))	EUR	10.348
<b>Verkaufte Kontrakte:</b>		
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ultra Long Term US Treas. Bond Future (UB), US Treasury Long Bond Future (US))	EUR	2.661
<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)	EUR	14.148
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>		
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):</b>		
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))	EUR	11.802
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>		
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>		
GBP/EUR	EUR	644
SEK/EUR	EUR	1.018
USD/EUR	EUR	12.123
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>		
<b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>		
GBP/EUR	EUR	820
JPY/EUR	EUR	155
SEK/EUR	EUR	1.025
USD/EUR	EUR	26.257
<b>Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
<b>unbefristet</b>		
(Basiswert(e): 3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33)	EUR	2.947

# Deka-PB Multi Asset Quant

## Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	630,562
Anteilwert	EUR	114,96

### 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	367,98	100,00
Kostenanteil des Fonds	121,45	33,00
Ertragsanteil der KVG	121,45	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 1. Juli 2024  
Deka Investment GmbH  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

### Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

### Sitz

Frankfurt am Main

### Gründungsdatum

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

### Eigenkapitalangaben zum 31. Dezember 2023

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.  
Eigenmittel: EUR 112,7 Mio.

### Alleingeschafterin

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 Vermögensmanagement 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 Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main und der S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;  
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG, Wiesbaden

### Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof  
Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsische Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning  
Vorsitzender des Vorstandes der LBS Landesbausparkasse NordWest, Münster

Peter Scherkamp, München

### Geschäftsführung

Dr. Ulrich Neugebauer (Sprecher)  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Jörg Boysen

Thomas Ketter  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;  
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der IQAM Invest GmbH, Salzburg

Thomas Schneider  
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A., Luxemburg;  
Mitglied der Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

## 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: 30. Juni 2024

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



**Deka Investment GmbH**

Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main

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

