

Jahresbericht
zum 31. Dezember 2023.

**Deka-PB Multi Asset Quant
(bis zum 31.10.2023 Deka-PB
Defensiv)**

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

31. Dezember 2023

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Deka-PB Multi Asset Quant (bis zum 31.10.2023 Deka-PB Defensiv) für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023.

Sowohl die im gesamten Berichtszeitraum anhaltenden geopolitischen Belastungsfaktoren (Ukraine-Krieg, Nahost-Konflikt) als auch die teilweise drastischen Preissteigerungen, welche die wirtschaftliche Stimmung eintrübten, waren zentrale Themen des Jahres 2023. Vor dem Hintergrund hoher Lebenshaltungskosten, einer schwachen Auslandsnachfrage und einer strafferen Geldpolitik verlor die europäische Wirtschaftsentwicklung spürbar an Schwung. In Deutschland muss für das Jahr 2023 sogar mit einem leichten Rückgang des Bruttoinlandsprodukts gerechnet werden. Im Laufe des Jahres zeigte die Inflation jedoch Anzeichen einer Normalisierung, was in den letzten Monaten zu einer aufgehellten Stimmung an den Finanzmärkten führte.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtsjahr die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu restriktiven Maßnahmen veranlasste. Während sich die Fed zuletzt in einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent bewegte, erhöhte die EZB den Hauptrefinanzierungssatz bis auf 4,50 Prozent. An den Rentenmärkten zogen die Renditen in diesem Umfeld bis in das dritte Quartal hinein signifikant an. Angesichts von Anzeichen eines Endes des Zinserhöhungs-Zyklus entfernten sich jedoch die Verzinsungen zuletzt merklich von ihren zuvor erreichten mehrjährigen Höchstständen. Die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen ging auf Jahressicht von 2,6 Prozent auf 2,0 Prozent zurück. Laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten Ende 2023 bei 3,9 Prozent und damit exakt auf dem Niveau des Vorjahres.

Angesichts der verschiedenen wirtschaftlichen und geopolitischen Belastungsfaktoren wiesen die internationalen Aktienindizes in der Betrachtungsperiode einige Schwankungen auf, konnten jedoch auf Jahressicht überwiegend deutlich zulegen. Lediglich China litt unter einem schwachen Wirtschaftswachstum und einer scheinbar nicht enden wollenden Immobilienkrise. Am Devisenmarkt notierte der Euro Ende Dezember mit 1,10 US-Dollar etwas höher als zu Jahresbeginn, während bei den Rohstoffen Rohöl den Berichtszeitraum bei rund 77 US-Dollar pro Barrel (Brent Future) beendete. Die Feinunze Gold kletterte über die Marke von 2.000 US-Dollar und erreichte im Dezember kurzzeitig ein neues Allzeit-Hoch.

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Tätigkeitsbericht. 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 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.

Tätigkeitsbericht	5
Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023	8
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023	9
Anhang	19
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	24
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	26

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.

Jahresbericht 01.01.2023 bis 31.12.2023

Deka-PB Multi Asset Quant

Tätigkeitsbericht.

Der Fonds Deka-PB Defensiv wurde zum 1. November 2023 in Deka-PB Multi Asset Quant umbenannt und das Anlagekonzept angepasst.

Anlageziel des Fonds Deka-PB Multi Asset Quant 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 Prozent.

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.

Wichtige Kennzahlen

Deka-PB Multi Asset Quant

Performance*	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
	7,6%	0,5%	1,5%
ISIN	DE000DK2CCQ6		
* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.			

Veräußerungsergebnisse im Berichtszeitraum

Deka-PB Multi Asset Quant

Realisierte Gewinne aus	in Euro
Renten und Zertifikate	27.460,00
Aktien	1.543.576,66
Zielfonds und Investmentvermögen	66.953,65
Optionen	237.064,16
Futures	2.474.141,71
Swaps	320.718,88
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	845.180,64
Devisenkassageschäften	22.840,03
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	5.537.935,73

Realisierte Verluste aus	in Euro
Renten und Zertifikate	-4.030.857,01
Aktien	-687.877,57
Zielfonds und Investmentvermögen	-25.596,43
Optionen	-368.399,55
Futures	-1.813.879,71
Swaps	0,00
Metallen und Rohstoffen	0,00
Devisentermingeschäften	-737.988,09
Devisenkassageschäften	-47.814,98
sonstigen Wertpapieren	0,00
Summe	-7.712.413,34

Die Umsetzung der Strategien erfolgt über hochliquide Optionen und Futures. 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.

Rentenfondsanteil ausgebaut

Zum Geschäftsjahresende bildete der Rentensektor mit deutlichem Abstand weiterhin die größte Position im Portfolio. Zuletzt umfasste der Rentenanteil 59,0 Prozent des Fondsvermögens. Den Schwerpunkt bildeten dabei zuletzt verschiedene Rentenfondsfonds mit unterschiedlichen Investitionsschwerpunkten (z.B. Unternehmensanleihen, Schwellenländeranleihen). Daneben umfasste das Segment Positionen in Staatsanleihen, Titel halbstaatlicher Emittenten und Unternehmensanleihen, wobei ein Teil mit besonderen Ausstattungsmerkmalen versehen waren. Zudem kamen

Deka-PB Multi Asset Quant

Zinsterminkontrakte zur Steuerung des Rentenengagements zum Einsatz.

Die Position in Aktien erfuhr im Verlauf der Berichtsperiode je nach Marktlage leichte Anpassungen. Ende Dezember 2023 waren 19,8 Prozent des Fondsvermögens direkt in Aktien investiert. Unter regionalen Aspekten bildeten Anlagen in den USA den Schwerpunkt, gefolgt von Europa. Die Branchenzusammensetzung ergab sich implizit aus der Länderallokation und den Einzelaktienüberlegungen. Darüber hinaus kamen im Aktiensegment ebenfalls Derivate (Optionen und Futures auf Aktienindizes) zum Einsatz, die den wirtschaftlichen Investitionsgrad zum Stichtag um 5,8 Prozentpunkte erhöhten.

Ein gemischter Fonds und ein Rohstofffonds ergänzten das Portfolio. Ferner nutzte das Fondsmanagement Devisentermingeschäfte zur Steuerung des Sondervermögens.

Die Wertentwicklung des Fonds Deka-PB Multi Asset Quant betrug im Berichtszeitraum plus 7,6 Prozent. Zuletzt belief sich das Fondsvolumen auf 74,9 Mio. Euro.

Anteile an dem Sondervermögen sind Wertpapiere, deren Preise durch die börsentäglichen Kursschwankungen der im Fonds befindlichen Vermögensgegenstände bestimmt werden und deshalb steigen oder auch fallen können (Marktpreisrisiken).

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen i.d.R. die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere.

Durch die Investition des Fonds in Anleihen können bei Ausfall eines Emittenten Verluste für den Fonds entstehen. Aufgrund der Investitionen in fremde Währungen unterlag der Fonds Fremdwährungsrisiken. Darüber hinaus waren Derivate im Portfolio enthalten, sodass auch hierfür spezifische Risiken wie das Kontrahentenrisiko zu beachten waren.

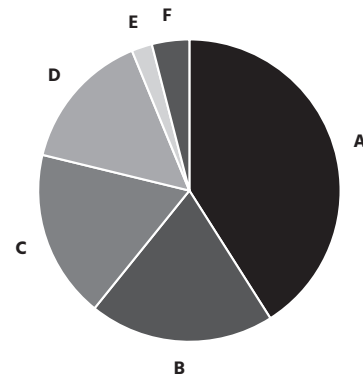
Das Engagement in Investmentanteilen ist marktüblichen und spezifischen Risiken unterworfen. Da die Manager der einzelnen Zielfonds voneinander unabhängig handeln, kann es vorkommen, dass mehrere Zielfonds gleiche Engagements tätigen. Hierdurch können sich bestehende Risiken kumulieren.

Die Einschätzung der im Berichtsjahr eingegangenen Liquiditätsrisiken orientiert sich an der Veräußerbarkeit von Vermögenswerten, die potenziell eingeschränkt sein kann. Der Fonds verzeichnete im Berichtszeitraum keine wesentlichen Liquiditätsrisiken.

Zur Bewertung und Vermeidung operationeller Risiken führt die Gesellschaft detaillierte Risikoüberprüfungen durch. Das Sondervermögen unterlag im Berichtszeitraum keinen besonderen operationellen Risiken.

Fondsstruktur

Deka-PB Multi Asset Quant



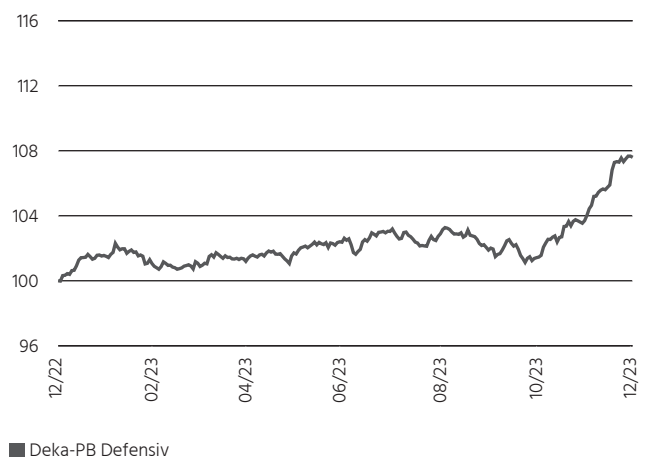
A	Rentenfonds	41,0%
B	Aktien	19,8%
C	Renten	18,0%
D	Gemischte Wertpapierfonds	15,0%
E	Rohstofffonds	2,2%
F	Barreserve, Sonstiges	4,0%

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

Wertentwicklung im Berichtszeitraum

Deka-PB Multi Asset Quant

Index: 31.12.2022 = 100



Berechnung nach BVI-Methode; die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Deka-PB Multi Asset Quant

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten (Angaben gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852).

PAI-Berücksichtigung

Bei den Anlageentscheidungen dieses Finanzproduktes in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (nachfolgend auch Principal Adverse Impacts oder PAI) berücksichtigt. PAI beschreiben die negativen Auswirkungen der (Geschäfts-) Tätigkeiten von Unternehmen und Staaten in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Dazu wurden auch systematische Verfahrensweisen zur Messung und Bewertung, sowie Maßnahmen zum Umgang mit den PAI in den Investitionsprozessen angewendet. Diese beinhalteten einen Steuerungsmechanismus, der bei schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen keine Investition in Emittenten erlaubte, sofern dazu aussagekräftige Daten herangezogen werden konnten. Bei weniger schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen konnten Investitionen nur begründet erfolgen. Im Ergebnis hielt der Fonds keine Anlagen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Unternehmen und Staaten mit schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen. Es wurde somit nicht in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen investiert, die an der Herstellung oder dem Verkauf von kontroversen Waffen beteiligt waren, denen Menschenrechtsverletzungen vorgeworfen wurden oder die einen Schwellenwert bei ihrer Treibhausgasemissionsintensität oder Energieverbrauchsintensität überschritten haben. Darüber hinaus wurde auch nicht in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten investiert, deren Treibhausgasemissionsintensität einen Schwellenwert überschritten hat. Bei Unternehmen und Staaten mit weniger schwerwiegenden negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen erfolgte bei den zuvor genannten Indikatoren eine Investition nur in begründeten Fällen. Zudem erfolgten nur begründete Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Staaten, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen haben und nur begründete Investitionen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen haben. Zielfonds, bei denen festgelegte Schwellenwerte für bestimmte PAI überschritten wurden, konnten seit dem 01.12.2022 nicht mehr für das Sondervermögen erworben werden, vorausgesetzt einer ausreichenden Datenverfügbarkeit bei den PAI-Indikatoren. Bereits vor dem 01.12.2022 gehaltene Zielfonds, bei denen die festgelegten Schwellenwerte überschritten wurden, wurden unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger bis zum 31.12.2022 veräußert. Durch das systematische, abgestufte Vorgehen wurden die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen, die mit den Investitionen des Fonds verbunden waren, begrenzt. Die negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen von Unternehmen wurden auch im Rahmen der Mitwirkungspolitik der Verwaltungsgesellschaft berücksichtigt mit der Absicht auf eine Reduzierung der PAI

der Emittenten im Anlageuniversum hinzuwirken. Die Ergebnisse der Mitwirkungspolitik sind im aktuellen Engagement-Bericht zu finden <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil/corporate-governance>.

Deka-PB Multi Asset Quant

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	14.798.538,08	19,76
Australien	113.524,29	0,15
Dänemark	164.794,81	0,22
Deutschland	299.918,46	0,40
Finnland	56.310,44	0,08
Frankreich	396.093,08	0,52
Großbritannien	502.361,56	0,67
Irland	283.943,83	0,38
Italien	197.839,98	0,26
Japan	997.797,56	1,32
Kanada	269.061,12	0,36
Niederlande	136.340,28	0,18
Schweden	97.242,08	0,13
Schweiz	339.992,47	0,46
Spanien	238.747,95	0,32
USA	10.704.570,17	14,31
2. Anleihen	13.368.832,47	17,85
Deutschland	2.996.942,50	4,00
Frankreich	1.459.647,00	1,95
Großbritannien	933.041,85	1,24
Italien	641.064,00	0,86
Neuseeland	389.604,00	0,52
Schweden	293.580,00	0,39
Spanien	915.702,00	1,23
USA	5.739.251,12	7,66
3. Investmentanteile	43.589.069,07	58,15
Deutschland	23.036.511,00	30,73
Irland	14.055.457,18	18,74
Luxemburg	6.497.100,89	8,68
4. Derivate	533.707,13	0,72
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	2.413.985,57	3,22
6. Sonstige Vermögensgegenstände	614.600,12	0,82
II. Verbindlichkeiten	-387.194,63	-0,52
III. Fondsvermögen	74.931.537,81	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	14.798.538,08	19,76
AUD	113.524,29	0,15
CAD	269.061,12	0,36
CHF	339.992,47	0,46
DKK	164.794,81	0,22
EUR	1.268.939,75	1,68
GBP	502.361,56	0,67
JPY	997.797,56	1,32
SEK	153.552,52	0,21
USD	10.988.514,00	14,69
2. Anleihen	13.368.832,47	17,85
EUR	7.479.252,00	9,99
USD	5.889.580,47	7,86
3. Investmentanteile	43.589.069,07	58,15
EUR	31.614.421,89	42,19
USD	11.974.647,18	15,96
4. Derivate	533.707,13	0,72
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	2.413.985,57	3,22
6. Sonstige Vermögensgegenstände	614.600,12	0,82
II. Verbindlichkeiten	-387.194,63	-0,52
III. Fondsvermögen	74.931.537,81	100,00

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

Deka-PB Multi Asset Quant

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								22.277.790,08	29,75
Aktien								14.798.538,08	19,76
EUR								1.268.939,75	1,68
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		2.435	0	1.307	EUR 26,035	63.395,23	0,08
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK		2.366	2.366	0	EUR 19,140	45.285,24	0,06
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		2.569	0	0	EUR 29,495	75.772,66	0,10
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.	STK		8.831	0	8.920	EUR 8,220	72.590,82	0,10
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien	STK		795	795	0	EUR 101,040	80.326,80	0,11
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur	STK		1.236	0	456	EUR 66,810	82.577,16	0,11
DE000ENAG999	E.ON SE Namens-Aktien	STK		7.076	7.076	0	EUR 12,140	85.902,64	0,11
FR0000052292	Hermes International S.C.A. Actions au Porteur	STK		51	51	0	EUR 1.925,400	98.195,40	0,13
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA Acciones Port.	STK		2.231	2.231	0	EUR 39,480	88.079,88	0,12
DE0006231004	Infinion Technologies AG Namens-Aktien	STK		2.007	0	1.127	EUR 37,745	75.754,22	0,10
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK		23.988	42.691	18.703	EUR 2,647	63.496,24	0,08
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK		23.455	0	0	EUR 3,110	72.945,05	0,10
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		203	0	99	EUR 450,900	91.532,70	0,12
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		154	262	108	EUR 376,200	57.934,80	0,08
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK		5.805	5.805	0	EUR 13,450	78.077,25	0,10
IT0005239360	UniCredit S.p.A. Azioni nom.	STK		3.621	5.555	1.934	EUR 24,595	89.058,50	0,12
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK		422	721	299	EUR 113,780	48.015,16	0,06
AUD								113.524,29	0,15
AU000000PLS0	Pilbara Minerals Ltd. Reg.Shares	STK		20.978	33.832	12.854	AUD 3,950	51.106,68	0,07
AU000000RIO1	Rio Tinto Ltd. Reg.Shares	STK		746	0	579	AUD 135,660	62.417,61	0,08
CAD								269.061,12	0,36
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK		700	0	500	CAD 141,500	67.646,71	0,09
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK		3.400	0	2.100	CAD 29,220	67.850,23	0,09
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares	STK		900	1.100	200	CAD 134,040	82.388,98	0,11
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK		1.100	0	1.100	CAD 68,120	51.175,20	0,07
CHF								339.992,47	0,46
CH0012221716	ABB Ltd. Namens-Aktien	STK		1.060	0	1.877	CHF 37,240	42.413,21	0,06
CH0012214059	Holcim Ltd. Namens-Aktien	STK		1.026	1.026	0	CHF 65,940	72.691,21	0,10
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		1.464	917	0	CHF 84,210	132.461,71	0,18
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien	STK		3.306	0	3.601	CHF 26,020	92.426,34	0,12
DKK								164.794,81	0,22
DK0062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		1.758	2.280	522	DKK 698,700	164.794,81	0,22
GBP								502.361,56	0,67
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares	STK		2.303	2.303	0	GBP 24,210	64.219,06	0,09
GB0006731235	Associated British Foods PLC Reg.Shares	STK		1.320	1.320	0	GBP 23,650	33.956,74	0,05
GB00B033F229	Centrica PLC Reg.Shares	STK		43.558	43.558	0	GBP 1,403	70.388,35	0,09
GB00BN7SWP63	GSK PLC Reg.Shares	STK		5.408	2.715	1.903	GBP 14,584	90.842,39	0,12
GB0004544929	Imperial Brands PLC Reg.Shares	STK		3.119	0	0	GBP 18,105	65.041,29	0,09
GB00BLGZ9862	Tesco PLC Reg.Shs	STK		20.746	20.746	0	GBP 2,897	69.224,22	0,09
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK		2.436	3.091	655	GBP 38,025	106.689,51	0,14
JPY								997.797,56	1,32
JP3429800000	ANA Holdings Inc. Reg.Shares	STK		3.300	3.300	0	JPY 3.060,000	64.511,60	0,09
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK		9.000	9.000	0	JPY 1.466,000	84.290,55	0,11
JP3294460005	Inpex Corp. Reg.Shares	STK		2.100	0	5.800	JPY 1.904,500	25.550,69	0,03
JP3143600009	ITOCHU Corp. Reg.Shares	STK		2.300	1.200	1.100	JPY 5.767,000	84.738,39	0,11
JP3726800000	Japan Tobacco Inc. Reg.Shares	STK		3.000	0	1.700	JPY 3.645,000	69.858,81	0,09
JP3304200003	Komatsu Ltd. Reg.Shares	STK		2.900	2.900	0	JPY 3.688,000	68.326,84	0,09
JP3877600001	Marubeni Corp. Reg.Shares	STK		3.300	6.700	3.400	JPY 2.228,500	46.981,73	0,06
JP3893600001	Mitsui & Co. Ltd. Reg.Shares	STK		2.700	2.700	0	JPY 5.298,000	91.385,68	0,12
JP3381000003	Nippon Steel Corp. Reg.Shares	STK		3.200	1.300	3.600	JPY 3.230,000	66.032,07	0,09
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares	STK		5.200	0	0	JPY 2.656,000	88.233,57	0,12
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK		2.500	3.900	1.400	JPY 5.917,000	94.502,65	0,13
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares	STK		3.000	4.800	1.800	JPY 3.529,000	67.635,60	0,09
JP3635000007	Toyota Tsusho Corp. Reg.Shares	STK		1.700	1.700	0	JPY 8.308,000	90.229,35	0,12
JP3942800008	Yamaha Motor Co. Ltd. Reg.Shares	STK		6.900	8.400	1.500	JPY 1.259,500	55.520,03	0,07
SEK								153.552,52	0,21
FI4000297767	Nordea Bank Abp Reg.Shares	STK		4.992	3.950	3.625	SEK 124,760	56.310,44	0,08
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A	STK		9.840	9.840	0	SEK 109,300	97.242,08	0,13
USD								10.988.514,00	14,69
US88579Y1010	3M Co. Reg.Shares	STK		921	0	0	USD 109,690	91.333,96	0,12
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares	STK		1.243	0	97	USD 110,400	124.064,01	0,17
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares	STK		832	0	404	USD 154,750	116.401,77	0,16
US00402L1070	Academy Sports & Outdoors Inc Reg.Shares	STK		1.292	0	0	USD 66,140	77.256,02	0,10
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A	STK		400	0	31	USD 351,590	127.145,83	0,17
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares	STK		284	284	0	USD 595,520	152.904,51	0,20
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares	STK		602	0	0	USD 139,770	76.070,46	0,10
IE00BFR3W74	Allegion PLC Reg.Shares	STK		789	0	0	USD 126,860	90.491,40	0,12
US01973R1014	Allison Transmission Hldg.Inc. Reg.Shares	STK		1.210	0	785	USD 58,400	63.885,72	0,09
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C	STK		1.094	291	1.897	USD 141,280	139.734,49	0,19

Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares CIA		STK	1.210	338	588	USD 140,230	153.402,31	0,20
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares		STK	2.320	538	1.023	USD 153,380	321.708,34	0,43
US0017441017	AMN Healthcare Services Inc. Reg.Shares		STK	735	0	0	USD 75,120	49.917,01	0,07
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	4.068	449	2.245	USD 193,580	711.945,97	0,95
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares		STK	426	426	0	USD 163,120	62.823,54	0,08
US0394831020	Archer Daniels Midland Co. Reg.Shares		STK	1.230	0	0	USD 72,270	80.365,34	0,11
US0476491081	Atkore Inc. Reg.Shares		STK	635	0	0	USD 162,250	93.145,96	0,12
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	500	0	0	USD 232,490	105.094,48	0,14
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New		STK	191	114	243	USD 357,570	61.744,75	0,08
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares		STK	1.197	0	0	USD 78,460	84.907,89	0,11
US09857L1089	Booking Holdings Inc. Reg.Shares		STK	40	40	0	USD 3.550,470	128.395,99	0,17
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares		STK	48	48	0	USD 1.122,410	48.707,78	0,07
US12008R1077	Builders Firstsource Inc. Reg.Shares		STK	326	326	0	USD 168,660	49.709,03	0,07
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc. Reg.Shs (new)		STK	743	0	0	USD 86,890	58.366,58	0,08
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	401	0	221	USD 273,240	99.059,07	0,13
US1475281036	Casey's General Stores Inc. Reg.Shares		STK	206	206	0	USD 275,010	51.217,85	0,07
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc. Reg.Shares		STK	375	0	229	USD 177,780	60.272,58	0,08
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares		STK	958	526	280	USD 149,770	129.716,72	0,17
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	2.479	2.479	0	USD 50,480	113.136,17	0,15
US20825C1045	ConocoPhillips Reg.Shares		STK	979	0	0	USD 116,500	103.113,19	0,14
US2435371073	Deckers Outdoor Corp. Reg.Shares		STK	143	195	52	USD 675,520	87.333,30	0,12
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares		STK	1.693	0	0	USD 55,230	84.535,20	0,11
US26210C1045	Dropbox Inc. Reg.Shares CIA		STK	3.208	0	658	USD 29,720	86.196,33	0,12
US26856L1035	E.L.F. Beauty Inc. Reg.Shares		STK	515	850	335	USD 145,110	67.563,20	0,09
US0367521038	Elevance Health Inc. Reg.Shares		STK	253	253	0	USD 468,670	107.199,63	0,14
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares		STK	112	112	120	USD 580,850	58.814,94	0,08
US2925621052	Encore Wire Corp. Reg.Shares		STK	481	0	0	USD 214,410	93.238,60	0,12
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares		STK	1.560	0	603	USD 100,190	141.304,04	0,19
US3032501047	Fair Isaac Corp. Reg.Shares		STK	16	0	137	USD 1.169,340	16.914,78	0,02
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	177	271	446	USD 452,270	72.373,01	0,10
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	1.293	0	0	USD 81,140	94.850,39	0,13
US4039491000	HF Sinclair Corp. Reg.Shares		STK	1.346	1.346	0	USD 55,600	67.658,98	0,09
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	1.333	0	0	USD 71,260	85.877,93	0,11
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares		STK	193	193	0	USD 455,610	79.497,99	0,11
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares		STK	2.976	0	1.703	USD 50,390	135.576,02	0,18
US4612021034	Intuit Inc. Reg.Shares		STK	235	235	0	USD 628,020	133.427,99	0,18
US4663131039	Jabil Inc. Reg.Shares		STK	472	472	0	USD 127,980	54.612,21	0,07
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	1.061	0	383	USD 156,580	150.195,62	0,20
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	437	283	339	USD 170,300	67.282,43	0,09
US48666K1097	KB Home Reg.Shares		STK	1.007	1.007	0	USD 62,950	57.310,05	0,08
US5627501092	Manhattan Associates Inc. Reg.Shares		STK	350	350	0	USD 216,580	68.531,78	0,09
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc. Reg.Shares		STK	378	378	0	USD 188,790	64.517,33	0,09
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares		STK	1.084	0	706	USD 67,170	65.827,94	0,09
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A		STK	252	175	250	USD 426,320	97.127,42	0,13
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	133	133	0	USD 457,500	55.010,85	0,07
US58506Q1094	Medpace Holdings Inc. Reg.Shares		STK	188	188	0	USD 310,640	52.798,41	0,07
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	804	0	963	USD 108,770	79.062,54	0,11
US30303M1027	Meta Platforms Inc. Reg.Shares CIA		STK	479	479	0	USD 358,320	155.171,58	0,21
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	74	0	0	USD 1.225,260	81.972,01	0,11
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	2.219	395	632	USD 375,280	752.867,12	1,00
US6267551025	Murphy USA Inc. Reg.Shares		STK	188	188	195	USD 355,800	60.474,10	0,08
US65336K1034	Nexstar Media Group Inc. Reg.Shares		STK	511	0	0	USD 158,870	73.395,33	0,10
US65341B1061	NextEra Energy Part.L.P. Reg.Uts rep.Ltd.Part.Int.		STK	2.582	2.582	0	USD 30,710	71.687,21	0,10
US6703461052	Nucor Corp. Reg.Shares		STK	421	0	242	USD 175,190	66.680,22	0,09
IE00BDVJJQ56	nVent Electric PLC Reg.Shares		STK	1.237	1.237	0	USD 59,290	66.306,60	0,09
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares		STK	831	355	0	USD 495,220	372.053,00	0,50
US6907421019	Owens Corning (New) Reg.Shares		STK	638	0	395	USD 148,750	85.799,20	0,11
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares		STK	1.275	1.275	451	USD 97,830	112.768,51	0,15
US7043261079	Paychex Inc. Reg.Shares		STK	870	0	0	USD 119,500	93.992,41	0,13
US69318G1067	PBF Energy Inc. Reg.Shs CIA		STK	1.667	1.667	0	USD 44,260	66.704,11	0,09
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares		STK	2.894	0	227	USD 28,790	75.326,15	0,10
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares		STK	1.082	1.082	0	USD 103,490	101.235,13	0,14
US7595091023	Reliance Steel & Alumin. Co. Reg.Shares		STK	203	203	0	USD 281,250	51.617,17	0,07
US7703231032	Robert Half Inc. Reg.Shares		STK	1.134	0	0	USD 88,160	90.383,73	0,12
US7766961061	Roper Technologies Inc. Reg.Shares		STK	199	199	0	USD 545,940	98.220,83	0,13
US79466L3024	Salesforce Inc. Reg.Shares		STK	586	667	81	USD 265,580	140.701,46	0,19
US8175651046	Service Corp. International Reg.Shares		STK	1.305	0	0	USD 68,600	80.935,72	0,11
US8330341012	Snap-on Inc. Reg.Shares		STK	279	0	0	USD 289,940	73.133,77	0,10
US85208M1027	Sprouts Farmers Market Inc. Reg.Shares		STK	1.656	0	1.215	USD 47,810	71.578,84	0,10
US858191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares		STK	647	957	310	USD 119,080	69.654,43	0,09
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares		STK	1.276	0	1.774	USD 38,370	44.263,74	0,06
US8716071076	Synopsys Inc. Reg.Shares		STK	222	0	100	USD 517,410	103.846,87	0,14
US88076W1036	Teradata Corp. Reg.Shares		STK	1.183	0	832	USD 43,670	46.706,09	0,06
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares		STK	704	0	55	USD 253,180	161.141,60	0,22
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares		STK	2.101	0	0	USD 45,170	85.798,91	0,11
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	562	305	0	USD 145,730	74.044,17	0,10
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares		STK	110	0	192	USD 532,940	53.000,09	0,07
US87256C1018	TKO Group Holdings Inc. Reg.Shares Class A		STK	800	800	0	USD 81,440	58.902,45	0,08

Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US8894781033	Toll Brothers Inc. Reg.Shares		STK	923	113	190	USD 103,530	86.392,00	0,12
US9038453031	Ulta Beauty Inc. Reg.Shares		STK	177	0	0	USD 486,840	77.904,96	0,10
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares		STK	182	0	120	USD 578,690	95.218,86	0,13
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	348	0	135	USD 524,900	165.143,48	0,22
US92343E1029	Verisign Inc. Reg.Shares		STK	402	402	0	USD 206,280	74.970,22	0,10
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	2.978	0	234	USD 37,490	100.935,92	0,13
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	148	0	228	USD 409,270	54.761,74	0,07
US9256521090	Vici Properties Inc. Reg.Shares		STK	3.024	0	0	USD 32,180	87.977,87	0,12
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	779	0	269	USD 260,400	183.393,54	0,24
US3848021040	W.W. Grainger Inc. Reg.Shares		STK	115	0	62	USD 827,100	85.992,68	0,11
US9553061055	West Pharmaceutical Services Inc. Reg.Shares		STK	289	0	0	USD 354,930	92.735,53	0,12
US9598021098	Western Union Co. Reg.Shares		STK	6.203	6.203	5.326	USD 11,940	66.959,43	0,09
US9699041011	Williams-Sonoma Inc. Reg.Shares		STK	470	0	214	USD 203,310	86.389,75	0,12
US9746371007	Winnebago Industries Inc. Reg.Shares		STK	989	0	777	USD 73,640	65.843,92	0,09
US98138H1014	Workday Inc. Reg.Shares A		STK	398	398	0	USD 276,080	99.339,88	0,13
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	691	0	0	USD 130,520	81.538,12	0,11
US98978V1035	Zoetis Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	516	0	199	USD 197,160	91.975,92	0,12
Verzinsliche Wertpapiere								7.479.252,00	9,99
EUR								7.479.252,00	9,99
ES0205032008	2,5000 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 14/24		EUR	300.000	0	0	% 99,171	297.513,00	0,40
XS1515173315	0,7500 % Fonterra Co-Operative Grp Ltd. MTN 16/24		EUR	400.000	0	0	% 97,401	389.604,00	0,52
XS2051397961	0,6250 % Glencore Finance (Europe) Ltd. MTN 19/24		EUR	500.000	0	0	% 97,602	488.007,50	0,65
XS2030530450	1,0000 % Jefferies Financial Group Inc. MTN 19/24		EUR	300.000	0	0	% 98,235	294.705,00	0,39
ES0000012L52	3,1500 % Koenigreich Spanien Bonos 23/33		EUR	600.000	600.000	0	% 103,032	618.189,00	0,83
DE000A289NQ8	0,0500 % Land Brandenburg Schatzanw. 21/31		EUR	3.000.000	0	1.000.000	% 83,861	2.515.830,00	3,36
DE000RLP0728	0,7500 % Land Rheinland-Pfalz Landessch. 16/26		EUR	500.000	0	5.500.000	% 96,223	481.112,50	0,64
FR001400H7V7	3,0000 % Rep. Frankreich OAT 22/33		EUR	1.400.000	1.400.000	0	% 104,261	1.459.647,00	1,95
IT0005544082	4,3500 % Republik Italien B.T.P. 23/33		EUR	600.000	600.000	0	% 106,844	641.064,00	0,86
XS1493333717	0,8750 % Swedish Match AB MTN 16/24		EUR	300.000	0	0	% 97,860	293.580,00	0,39
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								5.889.580,47	7,86
Verzinsliche Wertpapiere								5.889.580,47	7,86
USD								5.889.580,47	7,86
US034863AS94	3,6250 % Anglo American Capital PLC Notes 17/24 144A		USD	500.000	0	0	% 98,450	445.034,35	0,59
US28370TAG40	4,3000 % Kinder Morgan Energy Partn. LP Notes 14/24		USD	900.000	0	0	% 99,415	808.909,68	1,08
US695156AR08	3,6500 % Packaging Corp. of America Notes 14/24		USD	300.000	0	0	% 98,749	267.830,21	0,36
US912810QC53	4,5000 % U.S. Treasury Notes 09/39		USD	1.500.000	1.500.000	0	% 106,383	1.442.674,44	1,93
US912828U246	2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26 ¹⁾		USD	2.500.000	0	0	% 94,520	2.136.324,27	2,85
US912828Z948	1,5000 % U.S. Treasury Notes 20/30		USD	1.000.000	0	0	% 87,250	788.807,52	1,05
Wertpapier-Investmentanteile								43.589.069,07	58,15
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								23.036.511,00	30,73
EUR								23.036.511,00	30,73
DE000ETF375	Deka iBoxx EUR Liquid Corporates Diversified UCITS ETF		ANT	117.010	134.000	17.000	EUR 101,100	11.829.711,00	15,78
DE0005424568	Deka-Vega Plus I (A)		ANT	165.000	146.200	0	EUR 67,920	11.206.800,00	14,95
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								4.851.159,93	6,48
EUR								4.851.159,93	6,48
LU1685587914	Deka-MultiFactor Emerging Markets Corporates I		ANT	28.428	0	0	EUR 79,330	2.255.193,24	3,01
LU1685588219	Deka-MultiFactor Global Corporates I		ANT	5.197	0	0	EUR 83,080	431.766,76	0,58
LU1685587591	Deka-MultiFactor Global Corporates HY I		ANT	25.929	0	0	EUR 83,380	2.161.960,02	2,89
LU0297135294	Deka-OptiRent 3y CF		ANT	10	0	0	EUR 120,230	1.202,30	0,00
LU0332479749	Deka-OptiRent 3y TF		ANT	9	0	0	EUR 115,290	1.037,61	0,00
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								15.701.398,14	20,94
EUR								3.726.750,96	4,98
IE00BKLC5874	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	460.000	460.000	0	EUR 4,524	2.080.810,00	2,78
LU1829218749	MUL-Am.BI.E.-W.Comm.xAgr.U.ETF Namens-Ant. Acc.		ANT	78.140	109.000	30.860	EUR 21,064	1.645.940,96	2,20
USD								11.974.647,18	15,96
IE0032895942	iShs DL Corp Bond UCITS ETF Reg.Shares		ANT	71.010	77.000	6.000	USD 104,450	6.705.537,02	8,94
IE00BKFO9C98	iShs II-§ H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.		ANT	383.100	383.100	0	USD 4,545	1.574.308,60	2,10
IE00B2NPKV68	iShsII-J.P.M.USD EM Bond U.ETF Reg.Shares		ANT	46.600	46.600	0	USD 87,700	3.694.801,56	4,92
Summe Wertpapiervermögen								71.756.439,62	95,76
Derivate									
(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 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte								45.335,64	0,05	
	DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) März 24	XEUR	EUR	Anzahl 17				-3.825,00	-0,01	
	E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ) März 24	XIOM	USD	Anzahl 2				28.203,34	0,04	
	E-Mini Russell 2000 Index Future (RTY) März 24	XCME	USD	Anzahl 4				32.022,42	0,04	
	E-Mini S&P 500 Index Future (ES) März 24	XCME	USD	Anzahl 11				85.693,76	0,11	
	ESTX Mid Index Future (FMCE) März 24	XEUR	EUR	Anzahl 12				4.020,00	0,01	
	FTSE 100 Index Future (FFI) März 24	IFEU	GBP	Anzahl 1				2.580,02	0,00	
	MDAX Mini Future (FSMX) März 24	XEUR	EUR	Anzahl 10				4.844,18	0,01	
	MSCI Emerg. Mkts. Index Future (MEM) März 24	IFUS	USD	Anzahl 40				39.361,53	0,05	
	MSCI World Index Future (FMWO) März 24	XEUR	USD	Anzahl -46				-154.913,66	-0,21	
	S&P Canada 60 Index Future (SXF) März 24	XMOD	CAD	Anzahl 1				5.286,07	0,01	
	SPI 200 Index Future (YAP) März 24	API	AUD	Anzahl 1				2.359,11	0,00	
	Swiss Market Index Future (S30) März 24	XEUR	CHF	Anzahl 36				1.109,35	0,00	
	Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) März 24	XOSE	JPY	Anzahl -1				-1.405,48	0,00	
Optionsrechte								49.241,71	0,07	
Optionsrechte auf Aktienindices										
	DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Jan. 24 4550	XEUR		Anzahl 50			EUR	53,200	26.600,00	0,04
	S & P 500 Index (S500) Put Jan. 24 4725	XCBO		Anzahl 12			USD	20,870	22.641,71	0,03
Summe Aktienindex-Derivate								EUR	94.577,35	0,12
Zins-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte								161.084,28	0,23	
	10 Year Spanish Bono Futures (FBON) März 24	XEUR	EUR	500.000				18.961,39	0,03	
	EURO Bobl Future (FGBM) März 24	XEUR	EUR	200.000				140,00	0,00	
	EURO Bund Future (FGBL) März 24	XEUR	EUR	-100.000				-3.550,00	0,00	
	EURO-BTP Future (FBTP) März 24	XEUR	EUR	600.000				24.780,00	0,03	
	Five-Year US Treasury Note Future (FV) März 24	XCBT	USD	600.000				12.876,03	0,02	
	Long Gilt Future (FLG) März 24	IFEU	GBP	800.000				56.495,55	0,08	
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) März 24	XEUR	EUR	800.000				31.760,00	0,04	
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) März 24	XCBT	USD	-200.000				-7.260,87	-0,01	
	Two-Year US Treasury Note Future (TU) März 24	XCBT	USD	-400.000				-2.768,73	0,00	
	Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY) März 24	XCBT	USD	400.000				20.652,52	0,03	
	US Treasury Long Bond Future (US) März 24	XCBT	USD	100.000				8.998,39	0,01	
Summe Zins-Derivate								EUR	161.084,28	0,23
Devisen-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								278.045,50	0,37	
Offene Positionen										
	GBP/EUR 150.000,00		OTC					1837,64	0,00	
	JPY/EUR 25.000.000,00		OTC					-2.166,05	0,00	
	USD/EUR 15.400.000,00		OTC					278.373,91	0,37	
Summe Devisen-Derivate								EUR	278.045,50	0,37
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds										
Bankguthaben										
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	907.141,98			%	100,000	907.141,98	1,21
EUR-Guthaben bei										
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	51.789,77			%	100,000	51.789,77	0,07
	Landesbank Saar		EUR	11.727,85			%	100,000	11.727,85	0,02
	Norddeutsche Landesbank -Girozentrale-		EUR	1.445,57			%	100,000	1.445,57	0,00
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	440.309,37			%	100,000	59.073,38	0,08
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	536.633,77			%	100,000	47.652,91	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	611.843,93			%	100,000	55.319,68	0,07
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	127.727,80			%	100,000	78.777,46	0,11
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	234.770,60			%	100,000	160.337,79	0,21
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	110.523,97			%	100,000	118.752,32	0,16
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	67.363,49			%	100,000	77.588,94	0,10
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	11.236,67			%	100,000	1.300,53	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	21.811.590,00			%	100,000	139.344,47	0,19
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	778.398,98			%	100,000	703.732,92	0,94
Summe Bankguthaben								EUR	2.413.985,57	3,22
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds								EUR	2.413.985,57	3,22
Sonstige Vermögensgegenstände										
	Zinsansprüche		EUR	100.049,50				100.049,50	0,13	
	Dividendenansprüche		EUR	13.387,06				13.387,06	0,02	
	Einschüsse (Initial Margins)		EUR	481.495,48				481.495,48	0,64	
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	137,43				137,43	0,00	
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	19.530,65				19.530,65	0,03	
Summe Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	614.600,12	0,82
Sonstige Verbindlichkeiten										
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-45,34				-45,34	0,00	

Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-57.149,29				-57.149,29	-0,08
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-330.000,00				-330.000,00	-0,44
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-387.194,63	-0,52
	Fondsvermögen						EUR	74.931.537,81	100,00
	Umlaufende Anteile						STK	661.314,000	
	Anteilwert						EUR	113,31	

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

*) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: 2,0000 % U.S. Treasury Notes 16/26	USD 2.407.100		2.056.938,46	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		2.056.938,46	2.056.938,46

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.12.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,86821	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45360	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,26130	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,06015	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,93071	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10610	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,46423	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	156,53000	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,64005	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,62138	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
AUD				
AU000000BHP4	BHP Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.153
AU000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK	0	6.234
AU000000DXS1	DEXUS Reg.Stapled Secs (Units)	STK	0	8.718
AU0000224040	Woodside Energy Group Ltd Reg.Shares	STK	0	4.258
CAD				
CA0636711016	Bank of Montreal Reg.Shares	STK	500	500
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK	13	13
CA6665111002	Northland Power Inc. Reg.Shares	STK	1.900	1.900
CA6837151068	Open Text Corp. Reg.Shares	STK	1.600	1.600
CA0641491075	The Bank of Nova Scotia Reg.Shares	STK	0	1.800
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK	0	1.900
CA8849038085	Thomson Reuters Corp. Reg.Shares	STK	289	289
CA89156V1067	Tourmaline Oil Corp. Reg.Shares	STK	2.100	2.100
CHF				
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien	STK	848	848
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien	STK	800	800
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK	745	1.019
CH1243598427	Sandoz Group AG Namens-Aktien	STK	293	293
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK	0	130
DKK				

Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B	STK	0	33
DK0010181759	Carlsberg AS Navne-Aktier B	STK	0	647
EUR				
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK	93	312
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK	4.075	4.075
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK	0	410
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam	STK	0	7.086
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Action Port.(C.R.)	STK	203	203
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien	STK	0	1.597
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK	0	557
FR0000130809	Société Générale S.A. Actions Port.	STK	0	3.186
NL0000226223	STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder	STK	0	2.300
FR0000120271	TotalEnergies SE Actions au Porteur	STK	2.388	2.388
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK	0	1.010
GBP				
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares	STK	778	778
GB0002634946	BAE Systems PLC Reg.Shares	STK	0	7.525
GB0007980591	BP PLC Reg.Shares	STK	22.705	22.705
GB0002875804	British American Tobacco PLC Reg.Shares	STK	0	3.086
GB00BD6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares	STK	3.271	3.271
GB0002374006	Diageo PLC Reg.Shares	STK	0	2.854
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC Reg.Shares	STK	0	738
GB0033195214	Kingfisher PLC Reg.Shares	STK	0	18.830
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC Reg.Shares	STK	107.072	107.072
GB00BDR05C01	National Grid PLC Reg.Shares	STK	2.631	2.631
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC Reg.Shares	STK	0	20.161
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK	1.764	1.764
GB0007188757	Rio Tinto PLC Reg.Shares	STK	1.316	1.316
GB0007908733	SSE PLC Shares	STK	0	4.425
JPY				
JP3486800000	Daito Trust Constr. Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	900
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Reg.Shares	STK	0	700
JP3837800006	Hoya Corp. Reg.Shares	STK	0	600
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares	STK	3.200	3.200
JP3902900004	Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Reg.Shares	STK	0	21.600
JP3362700001	Mitsui O.S.K. Lines Ltd. Reg.Shares	STK	0	3.600
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares	STK	0	3.900
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Reg.Shares	STK	0	3.600
JP3165000005	Sompo Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	2.000
SEK				
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria)	STK	0	5.579
SE0000242455	Swedbank AB Namn-Aktier A	STK	3.402	3.402
USD				
US00123Q1040	AGNC Investment Corp. Reg.Shares	STK	0	6.215
US0207641061	Alpha Metallurgical Res. Inc. Reg.Shares	STK	0	558
US0259321042	American Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	0	640
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK	0	438
US0936711052	Block H. & R. Inc. Reg.Shares	STK	0	1.836
US09739D1000	Boise Cascade Co. Reg.Shares	STK	0	517
US1033041013	Boyd Gaming Corp. Reg.Shares	STK	0	892
US13057Q3056	California Resources Corp. Reg.Shares	STK	0	1.591
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	1.133
US1727551004	Cirrus Logic Inc. Reg.Shares	STK	0	1.254
US1729674242	Citigroup Inc. Reg.Shares	STK	0	2.603
CH0334081137	CRISPR Therapeutics AG Nam.-Aktien	STK	0	843
US25179M1036	Devon Energy Corp. Reg.Shares	STK	0	1.376
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares	STK	0	871
US2333311072	DTE Energy Co. Reg.Shares	STK	0	828
US31620M1062	Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Reg.Shares	STK	0	1.105
SG9999000020	Flex Ltd. Reg.Shares	STK	0	3.072
US6687711084	Gen Digital Inc. Reg.Shares	STK	0	3.971
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	0	491
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares	STK	0	6.440
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares	STK	0	2.699
US4262811015	Jack Henry & Associates Inc. Reg.Shares	STK	0	492
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle Inc. Reg.Shares	STK	0	430
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	572
US4990491049	Knight-Swift Transp. Hldgs Inc Reg.Shs Cl.A	STK	0	1.832
US5012421013	Kulicke & Soffa Inds Inc. Reg.Shares	STK	0	885
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares	STK	0	395
US5184151042	Lattice Semiconductor Corp. Reg.Shares	STK	1.163	1.163
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares	STK	0	396
US5018892084	LKQ Corp. Reg.Shares	STK	0	1.740
US5463471053	Louisiana Pacific Corp. Reg.Shares	STK	0	1.424
US56418H1005	ManpowerGroup Inc. Reg.Shares	STK	0	863
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	0	265
US65473P1057	NISOURCE Inc. Reg.Shares	STK	0	3.320
US6293775085	NRG Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	2.307
US69047Q1022	Ovintiv Inc Reg.Shares	STK	0	1.491
US7234841010	Pinnacle West Capital Corp. Reg.Shares	STK	0	774
US82968B1035	Sirius XM Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	16.524
US78467J1007	SS&C Technologies Holdings Reg.Shares	STK	0	1.544

Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US879011051	TEGNA Inc. Reg.Shares	STK	0	3.018
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK	0	731
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK	0	127
US9026811052	UGI Corp. Reg.Shares	STK	0	2.456
US9418481035	Waters Corp. Reg.Shares	STK	0	300
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS1877540465	2,0000 % AB Sagax MTN 18/24	EUR	0	400.000
FR0013505625	2,1250 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 20/26	EUR	0	500.000
XS1346695437	2,1250 % alstria office REIT-AG Anl. 16/23	EUR	0	300.000
XS1369278764	2,0000 % Amgen Inc. Notes 16/26	EUR	0	400.000
XS1062493934	2,8750 % Aon Global Ltd. Notes 14/26	EUR	0	600.000
XS1851268893	2,2000 % BPP Europe Holdings S.A.R.L. MTN 18/25	EUR	0	500.000
DE0001102382	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25	EUR	0	5.000.000
DE0001102424	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR	0	2.000.000
XS1912654321	2,1250 % Castellum AB MTN 18/23	EUR	0	300.000
XS0502286908	4,8750 % CEZ AS MTN 10/25	EUR	0	1.000.000
XS2188805688	0,8750 % Covestro AG MTN 20/26	EUR	0	500.000
FR0012432912	1,1250 % Danone S.A. MTN 15/25	EUR	0	500.000
XS1395180802	2,6250 % Digital Euro Finco LLC Notes 16/24	EUR	0	200.000
BE0002629104	1,3750 % Elia Transm. Belgium S.A./N.V. MTN 19/26	EUR	0	400.000
XS1981060624	1,8750 % ERG S.p.A. MTN 19/25	EUR	0	400.000
DE000A289NX4	0,6250 % Evonik Industries AG MTN 20/25	EUR	0	500.000
ES0205032024	1,3750 % Ferrovial Emisiones S.A. Notes 17/25	EUR	0	500.000
XS1577951129	1,3750 % Goldman Australia Fin.Pty Ltd. Notes 17/25 Reg.S	EUR	0	400.000
XS1725677543	1,6250 % Inmobiliaria Colonial SOCIMI MTN 17/25	EUR	0	600.000
DE000A2NB9V2	0,1000 % Land Berlin Landessch. Ausg.514 19/30	EUR	0	2.500.000
DE000A3H3D69	0,0000 % Land Sachsen-Anhalt Landessch. 21/31	EUR	0	2.000.000
DE0005HFM675	0,5000 % Land Schleswig-Holstein Landessch. Ausg.1 19/29	EUR	0	3.000.000
XS1440976535	1,2500 % Molson Coors Beverage Co. Notes 16/24	EUR	0	500.000
XS1412417617	1,2500 % National Australia Bank Ltd. MTN 16/26	EUR	0	400.000
XS1231027464	1,3000 % RELX Capital Inc. Notes 15/25	EUR	0	400.000
XS1788605936	1,2500 % Securitas AB MTN S.26 18/25	EUR	300.000	300.000
XS1812887443	1,6250 % Stockland Trust Management Ltd MTN 18/26	EUR	0	400.000
XS1907150350	1,1250 % Tele2 AB MTN 18/24	EUR	0	300.000
XS1509006380	1,2500 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 16/25	EUR	0	500.000
XS1139315581	1,3750 % TotalEnergies Capital Intl SA MTN 14/25	EUR	0	500.000
GBP				
GB00BHFH458	2,7500 % Großbritannien Treasury Stock 14/24	GBP	0	3.500.000
USD				
US36164Q6M56	3,3730 % GE Capital Internat. Funding MTN 16/25	USD	0	800.000
US457187AB87	3,2000 % Ingredion Inc. Notes 16/26	USD	400.000	400.000
US493738AE83	3,0000 % Kia Corp. Notes 17/23 144A	USD	0	300.000
US912810FP85	5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31	USD	0	1.500.000
Zertifikate				
EUR				
DE000PB6R1W7	BNP Paribas Is. B.V. O.E. ETC RIC1 WTI Cr.16/Und.	STK	0	10
Sonstige Beteiligungswertpapiere				
CHF				
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK	262	262
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
BE6286963051	2,3750 % Barry Callebaut Services N.V. Notes 16/24	EUR	0	100.000
XS1996269061	0,6970 % Eaton Capital Unlimited Co. Notes 19/25	EUR	0	500.000
XS2363989273	1,7500 % Lar Espana Real Est.SOCIMI SA Notes 21/26	EUR	0	400.000
XS1719267855	1,1250 % Parker-Hannifin Corp. Notes 17/25	EUR	0	400.000
XS1996441066	0,8750 % Rentokil Initial PLC MTN 19/26	EUR	0	300.000
XS2356076625	1,1250 % Sirius Real Estate Ltd. Bonds 21/26	EUR	0	1.000.000
XS1533928971	2,2500 % WPC Eurobond B.V. Notes 17/24	EUR	0	300.000
USD				
US085770AA31	4,8750 % Berry Global Escrow Corp. Notes 19/26 144A	USD	0	700.000
US09261LAC28	3,6250 % Blackstone Secured Lending Fd. Notes 20/26	USD	0	800.000
US741503AW60	3,6500 % Booking Holdings Inc. Notes 15/25	USD	0	800.000
US00440EAV92	3,3500 % Chubb INA Holdings Inc. Notes 15/26	USD	0	500.000
US12626PAM59	3,8750 % CRH America Inc. Notes 15/25 144A	USD	0	600.000
US23331ABN81	2,6000 % D.R. Horton Inc. Notes 20/25	USD	0	800.000
US29446MAJ18	1,7500 % Equinor ASA Notes 20/26	USD	0	400.000
US302635AG21	3,4000 % FS KKR Capital Corp. Notes 20/26	USD	0	600.000
US41283LBA26	3,0500 % Harley Davidson Finl Serv.Inc. Notes 22/27 144A	USD	400.000	400.000
US404119BQ19	5,2500 % HCA Inc. Notes 14/25	USD	0	700.000
US50540RAQ56	3,6000 % Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Notes 15/25	USD	0	700.000
US571748AX08	3,5000 % Marsh & McLennan Cos. Inc. Notes 14/25	USD	0	500.000
US82620KAE38	3,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV Notes 15/25 144A	USD	0	500.000
US828807CW58	3,3000 % Simon Property Group L.P. Notes 16/26	USD	0	800.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
CAD				
CA8849037095	Thomson Reuters Corp. Reg.Shares	STK	300	300
DKK				

Deka-PB Multi Asset Quant

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK	1.329	1.329
USD				
US69327R1014	PDC Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	1.135
US98156Q1085	World Wrestling Entertain.Inc. Reg.Shares CL.A	STK	0	800
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000A1TNA47	1,6250 % Land Sachsen-Anhalt Landessch. 13/23	EUR	0	2.500.000
USD				
US00973RAG83	2,8750 % Aker BP ASA Notes 20/26 144A	USD	0	600.000

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	81.636
(Basiswert(e): 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), Russell 2000 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, Swiss Market Index (Price) (CHF))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	26.501
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, MSCI World (Mod.ma.C.W.) Index (Net Return) (USD), 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))		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	63.401
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Two-Year US Treasury Note Future (TU), Ultra Ten-Year US Treas.Note Future (UXY), US Treasury Long Bond Future (US))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	96.507
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Bund Future (FGBL), EURO Schatz Future (FGBS), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Ten-Year US Treasury Note Future (TY), Two-Year US Treasury Note Future (TU))		
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	58.017
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nasdaq-100 Index, S&P 500 Index)		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	21.535
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	378
CAD/EUR	EUR	558
CHF/EUR	EUR	475
GBP/EUR	EUR	13.362
JPY/EUR	EUR	1.363
SEK/EUR	EUR	250
USD/EUR	EUR	55.457
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	627
CAD/EUR	EUR	832
CHF/EUR	EUR	785
DKK/EUR	EUR	161
GBP/EUR	EUR	17.775
JPY/EUR	EUR	1.909
SEK/EUR	EUR	403
USD/EUR	EUR	72.535
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
befristet	EUR	1.433
(Basiswert(e): 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27)		
unbefristet	EUR	32.868
(Basiswert(e): 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27, 1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25, 4,8750 % CEZ AS MTN 10/25, ASML Holding N.V. Aandelen op naam, NatWest Group PLC Reg.Shares)		

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 12,42 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 14.600.862 Euro.

Deka-PB Multi Asset Quant

Entwicklung des Sondervermögens

		EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		88.843.930,73
1	Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr	-1.572.328,32
2	Zwischenausschüttung(en)	-,-
3	Mittelzufluss (netto)	-18.214.569,34
	a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 2.058.089,11
	davon aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 2.058.089,11
	davon aus Verschmelzung	EUR 0,00
	b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR -20.272.658,45
4	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-3.094,35
5	Ergebnis des Geschäftsjahres	5.877.599,09
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	788.913,93
	davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	6.774.387,85
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		74.931.537,81

Vergleichende Übersicht der letzten drei Geschäftsjahre

	Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
31.12.2020	107.447.247,01	115,30
31.12.2021	104.106.340,13	117,88
31.12.2022	88.843.930,73	107,21
31.12.2023	74.931.537,81	113,31

Deka-PB Multi Asset Quant

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2023 - 31.12.2023 (einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR insgesamt	EUR je Anteil *)
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)	16.479,59	0,02
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	346.772,67	0,52
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren ¹⁾	-417.654,41	-0,63
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	666.449,60	1,01
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	192.663,35	0,29
davon Negative Einlagezinsen	-131,60	-0,00
davon Positive Einlagezinsen	192.794,95	0,29
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	399.502,83	0,60
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	3.776,30	0,01
davon Erträge aus Wertpapier-Darlehen	3.776,30	0,01
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer	-2.471,80	-0,00
davon inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividenden	-2.471,80	-0,00
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer	-62.298,83	-0,09
davon aus Dividenden ausländischer Aussteller	-62.298,83	-0,09
10. Sonstige Erträge	49.312,24	0,07
davon Kick-Back-Zahlungen	4.049,44	0,01
davon Kompensationszahlungen	40.847,27	0,06
davon Quellensteuerrückvergütung Dividenden	3.845,85	0,01
davon Zinsgutschrift auf Quellensteuerrückvergütung Fokusbank	569,68	0,00
Summe der Erträge	1.192.531,54	1,80
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-9.806,14	-0,01
2. Verwaltungsvergütung	-577.318,76	-0,87
3. Verwahrstellenvergütung	-10.976,45	-0,02
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	0,00	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	-105.655,27	-0,16
davon Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	-1.246,26	-0,00
davon EMIR-Kosten	-5.997,24	-0,01
davon Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	-2.928,73	-0,00
davon Kostenpauschale	-95.483,04	-0,14
Summe der Aufwendungen	-703.756,62	-1,06
III. Ordentlicher Nettoertrag	488.774,92	0,74
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	5.537.935,73	8,37
2. Realisierte Verluste	-7.712.413,34	-11,66
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-2.174.477,61	-3,29
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.685.702,69	-2,55
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	788.913,93	1,19
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	6.774.387,85	10,24
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	7.563.301,78	11,44
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	5.877.599,09	8,89

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich

¹⁾ Die negativen Zinserträge aus Wertpapieren resultieren unter anderem aus dem Veräußerungsergebnis der Wertpapiere, die der Marktrendite zugeordnet sind und berücksichtigen Zinsansprüche (Stückzinsen) verliehener Wertpapiere bis zum Kupon-Termin. Gezahlte Kupons aus verliehenen Wertpapieren sind in den Kompensationszahlungen enthalten.

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung

	EUR insgesamt	EUR je Anteil*)
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	1.007.754,80	1,52
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.685.702,69	-2,55
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹⁾	1.881.539,37	2,85
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung²⁾	1.203.591,48	1,82
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung ³⁾	1.203.591,48	1,82

Umlaufende Anteile: Stück 661.314

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

¹⁾ Betrag, um den die Ausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres und den Vortrag aus den Vorjahren übersteigt.

²⁾ Der Abzug von Kapitalertragsteuer und Solidaritätszuschlag erfolgt gemäß § 44 Abs. 1 Satz 3 EStG über die depotführende Stelle bzw. über die letzte inländische auszahlende Stelle als Entrichtungspflichtete.

³⁾ Ausschüttung am 23. Februar 2024 mit Beschlussfassung vom 13. Februar 2024.

Deka-PB Multi Asset Quant Anhang.

Zusätzliche Angaben zu den Derivaten

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure in EUR 37.187.414,70

Vertragspartner der derivativen Geschäfte

BNP Paribas S.A.
DekaBank Deutsche Girozentrale

Gesamtbetrag der bei Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten:	EUR	330.000,00
davon:		
Bankguthaben	EUR	330.000,00

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial wurde für dieses Sondervermögen gemäß der DerivateV nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt (relativer Value-at-Risk gem. § 8 DerivateV).

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§ 37 Abs. 5 DerivateV i. V. m. § 9 DerivateV)

01.01.2023 - 31.10.2023: 80% JPM Welt (Traded) in EUR, 20% MSCI World NR in EUR
01.11.2023 - 31.12.2023: 50% ICE BofA Global Corporate Index in EUR, 15% ICE BofA World Sovereign Bond Index in EUR, 35% MSCI World NR in EUR

Dem Sondervermögen wird ein derivatereies Vergleichsvermögen gegenübergestellt. Es handelt sich dabei um eine Art virtuelles Sondervermögen, dem keine realen Positionen oder Geschäfte zugrunde liegen. Die Grundidee besteht darin, eine plausible Vorstellung zu entwickeln, wie das Sondervermögen ohne Derivate oder derivative Komponenten zusammengesetzt wäre. Das Vergleichsvermögen muss den Anlagebedingungen, den Angaben im Verkaufsprospekt und den wesentlichen Anlegerinformationen des Sondervermögens im Wesentlichen entsprechen, ein derivatereies Vergleichsmaßstab wird möglichst genau nachgebildet. In Ausnahmefällen kann von der Forderung des derivatereies Vergleichsvermögens abgewichen werden, sofern das Sondervermögen Long/Short-Strategien nutzt oder zur Abbildung von z.B. Rohstoffexposure oder Währungsabsicherungen.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (§ 37 Abs. 4 Satz 1 und 2 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

kleinster potenzieller Risikobetrag 1,49%
größter potenzieller Risikobetrag 2,83%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 2,23%

Der potenzielle Risikobetrag für das Marktrisiko des Sondervermögens wird über die Risikokennzahl Value-at-Risk (VaR) dargestellt. Zum Ausdruck gebracht wird durch diese Kennzahl der potenzielle Verlust des Sondervermögens, der unter normalen Marktbedingungen mit einem Wahrscheinlichkeitsniveau von 99% (Konfidenzniveau) bei einer angenommenen Haltedauer von 10 Arbeitstagen auf Basis eines effektiven historischen Betrachtungszeitraumes von einem Jahr nicht überschritten wird. Wenn zum Beispiel ein Sondervermögen einen VaR-Wert von 2,5% aufwiese, dann würde unter normalen Marktbedingungen der potenzielle Verlust des Sondervermögens mit einer Wahrscheinlichkeit von 99% nicht mehr als 2,5% des Wertes des Sondervermögens innerhalb von 10 Arbeitstagen betragen. Im Bericht wird die maximale, minimale und durchschnittliche Ausprägung dieser Kennzahl auf Basis einer Beobachtungszeitreihe von maximal einem Jahr oder ab Umstellungsdatum veröffentlicht. Der VaR-Wert des Sondervermögens darf das Zweifache des VaR-Werts des derivatereies Vergleichsvermögens nicht übersteigen. Hierdurch wird das Marktrisiko des Sondervermögens klar limitiert.

Risikomodell (§ 37 Abs. 4 Satz 3 DerivateV i. V. m. § 10 DerivateV)

historische Simulation

Im Berichtszeitraum genutzter Umfang des Leverage gemäß der Brutto-Methode (§ 37 Abs. 4 Satz 4 DerivateV i. V. m. § 5 Abs. 2 DerivateV)

187,40%

Emittenten oder Garanten, deren Sicherheiten mehr als 20% des Wertes des Fonds ausgemacht haben (§ 37 Abs. 6 DerivateV):

Im Berichtszeitraum wiesen keine Sicherheiten eine erhöhte Emittentenkonzentration nach § 27 Abs. 7 Satz 4 DerivateV auf.

Zusätzliche Angaben zu den Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäften (besichert)

Instrumentenart	Kontrahent	Exposure in EUR (Angabe nach Marktwerten)
Wertpapier-Darlehen	DekaBank Deutsche Girozentrale	2.056.938,46
Gesamtbetrag der bei Wertpapier-Darlehen von Dritten gewährten Sicherheiten:		EUR 4.572.543,34
davon:		
Schuldverschreibungen		EUR 4.572.543,34
Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR 3.776,30
Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR 1.246,26
Umlaufende Anteile	STK	661.314
Anteilwert	EUR	113,31

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 Umsatzzolumina 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

Deka-PB Multi Asset Quant

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.

Gesamtkostenquote (laufende Kosten) 1,19%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Die anteiligen laufenden Kosten für die Zielfondsbestände sind auf Basis der zum Geschäftsjahresende des Dachfonds verfügbaren Daten ermittelt.

Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen der aus dem Fonds an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen zu.

Die Gesellschaft gewährt an Vermittler, z.B. Kreditinstitute, wiederkehrend - meist jährlich - Vermittlungsentgelte als so genannte "Vermittlungsprovisionen" bzw. "Vermittlungsfolgeprovisionen".

Für den Erwerb und die Veräußerung der Investmentanteile sind keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge berechnet worden.

Für die Investmentanteile wurden von der verwaltenden Gesellschaft auf Basis des Zielfonds folgende Verwaltungsvergütungen in % p.a. erhoben:

Deka iBoxx EUR Liquid Corporates Diversified UCITS ETF	0,20
Deka-MultiFactor Emerging Markets Corporates I	0,30
Deka-MultiFactor Global Corporates HY I	0,30
Deka-MultiFactor Global Corporates I	0,25
Deka-OptiRent 3y CF	0,02
Deka-OptiRent 3y TF	0,02
Deka-Vega Plus I (A)	0,60
iShs DL Corp Bond UCITS ETF RegShares	0,20
iShs II-Š H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	0,25
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg.Shares Dis.	0,25
iShsII-J.P.M.USD EM Bond U.ETF Reg.Shares	0,45
MUL-Am.BI.E.-W.Comm.xAgr.U.ETF Namens-Ant. Acc.	0,30

Wesentliche sonstige Erträge

Kick-Back-Zahlungen	EUR	4.049,44
Kompensationszahlungen	EUR	40.847,27
Quellensteuerrückvergütung Dividenden	EUR	3.845,85
Zinsgutschrift auf Quellensteuerrückvergütung Fokusbank	EUR	569,68

Wesentliche sonstige Aufwendungen

Aufwendungen aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR	1.246,26
EMIR-Kosten	EUR	5.997,24
Kosten für die Bereitstellung von Analysematerial oder -dienstleistungen durch Dritte	EUR	2.928,73
Kostenpauschale	EUR	95.483,04

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt EUR 81.586,29

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Deka Investment GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihrer Vergütungssysteme. Zudem gilt die für alle Unternehmen der Deka-Gruppe verbindliche Vergütungsrichtlinie, die gruppenweite Standards für die Ausgestaltung der Vergütungssysteme definiert. Sie enthält die Grundsätze zur Vergütung und die maßgeblichen Vergütungsparameter.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss, das „Managementkomitee Vergütung“ (MKV) der Deka-Gruppe, auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Vergütung überprüft.

Vergütungskomponenten

Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH umfasst fixe und variable Vergütungselemente sowie Nebenleistungen.

Für die Mitarbeitenden und Geschäftsführung der Deka Investment GmbH findet eine maximale Obergrenze für den Gesamtbetrag der variablen Vergütung in Höhe von 200 Prozent der fixen Vergütung Anwendung.

Weitere sonstige Zuwendungen im Sinne von Vergütung, wie z.B. Anlageerfolgsprämien, werden bei der Deka Investment GmbH nicht gewährt.

Bemessung des Bonuspools

Der Bonuspool leitet sich - unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Deka Investment GmbH - aus dem vom Konzernvorstand der DekaBank Deutsche Girozentrale nach Maßgabe von § 45 Abs. 2 Nr. 5a KWG festgelegten Bonuspool der Deka-Gruppe ab und kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden.

Bei der Bemessung der variablen Vergütung sind grundsätzlich der individuelle Erfolgsbeitrag des Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Organisationseinheit des Mitarbeitenden, der Erfolgsbeitrag der Deka Investment GmbH bzw. die Wertentwicklung der von dieser verwalteten Investmentvermögen sowie der Gesamterfolg der Deka-Gruppe zu berücksichtigen. Zur Bemessung des individuellen Erfolgsbeitrags des Mitarbeitenden werden sowohl quantitative als auch qualitative Kriterien verwendet, wie z.B. Qualifikationen, Kundenzufriedenheit. Negative Erfolgsbeiträge verringern die Höhe der variablen Vergütung. Die Erfolgsbeiträge werden anhand der Erfüllung von Zielvorgaben ermittelt.

Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeitenden erfolgt durch die Geschäftsführung. Die Vergütung der Geschäftsführung wird durch den Aufsichtsrat festgelegt.

Deka-PB Multi Asset Quant

Variable Vergütung bei risikorelevanten Mitarbeitenden

Die variable Vergütung der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und von Mitarbeitenden, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, sowie bestimmten weiteren Mitarbeitenden (zusammen als "risikorelevante Mitarbeitende") unterliegt folgenden Regelungen:

- Die variable Vergütung der risikorelevanten Mitarbeitenden ist grundsätzlich erfolgsabhängig, d.h. ihre Höhe wird nach Maßgabe von individuellen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeitenden sowie den Erfolgsbeiträgen des Geschäftsbereichs und der Deka-Gruppe ermittelt.
- Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird zwingend ein Anteil von 60 Prozent der variablen Vergütung über einen Zeitraum von bis zu fünf Jahren aufgeschoben. Bei risikorelevanten Mitarbeitenden unterhalb der Geschäftsführungs-Ebene beträgt der aufgeschobene Anteil 40 Prozent der variablen Vergütung und wird über einen Zeitraum von mindestens drei Jahren aufgeschoben.
- Jeweils 50 Prozent der sofort zahlbaren und der aufgeschobenen Vergütung werden in Form von Instrumenten gewährt, deren Wertentwicklung von der nachhaltigen Wertentwicklung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der Unternehmenswertentwicklung der Deka-Gruppe abhängt. Diese nachhaltigen Instrumente unterliegen nach Eintritt der Unverfallbarkeit einer Sperrfrist von einem Jahr.
- Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während der Wartezeit risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeitenden, der Kapitalverwaltungsgesellschaft bzw. der von dieser verwalteten Investmentvermögen oder der Deka-Gruppe gekürzt werden oder komplett entfallen. Jeweils am Ende eines Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar. Der unverfallbar gewordene Baranteil wird zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt, die unverfallbar gewordenen nachhaltigen Instrumente werden erst nach Ablauf der Sperrfrist ausgezahlt.
- Risikorelevante Mitarbeitende, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 75 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt.

Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems

Die Überprüfung des Vergütungssystems gemäß den geltenden regulatorischen Vorgaben für das Geschäftsjahr 2022 fand im Rahmen der jährlichen zentralen und unabhängigen internen Angemessenheitsprüfung des MKV statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme von Kapitalverwaltungsgesellschaften eingehalten wurden. Das Vergütungssystem der Deka Investment GmbH war im Geschäftsjahr 2022 angemessen ausgestaltet. Es konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Mitarbeitervergütung

	EUR	57.636.189,51
davon feste Vergütung	EUR	43.854.381,97
davon variable Vergütung	EUR	13.781.807,54

Zahl der Mitarbeiter der KVG

461

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Deka Investment GmbH* gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen**

	EUR	11.962.579,80
Geschäftsführer	EUR	2.094.112,05
weitere Risk Taker	EUR	1.991.350,34
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR	387.352,00
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Geschäftsführer und Risk Taker	EUR	7.489.765,41

* Mitarbeiterwechsel innerhalb der Deka-Gruppe werden einheitlich gemäß gruppenweitem Vergütungsbericht dargestellt.

** weitere Risk Taker: alle sonstigen Risk Taker, die nicht Geschäftsführer oder Risk Taker mit Kontrollfunktionen sind. Mitarbeiter in Kontrollfunktionen: Mitarbeiter in Kontrollfunktionen, die als Risk Taker identifiziert wurden oder sich auf derselben Einkommensstufe wie Risk Taker oder Geschäftsführer befinden.

Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	2.056.938,46	2,75

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	2.056.938,46	Deutschland

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

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

Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen (besichert)	absolute Beträge in EUR
unbefristet	2.056.938,46

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	absolute Beträge in EUR
---------------------	-------------------------

Deka-PB Multi Asset Quant

unbefristet

4.572.543,34

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	4.578,88	100,00
Kostenanteil des Fonds	1.511,04	33,00
Ertragsanteil der KVG	1.511,04	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.

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

2,87% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen

	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Wells Fargo & Co.	2.814.813,29
Bayerische Landesbank	1.757.730,05

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	2
J.P.Morgan AG Frankfurt	2.814.813,29 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
Clearstream Banking Frankfurt	1.757.730,05 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.

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

Basierend auf dem Gesetz zur Umsetzung der zweiten Aktionärsrechterichtlinie (ARUG II) macht die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu § 134c Abs. 4 AktG folgende Angaben:

Wesentliche mittel- bis langfristige Risiken

Informationen zu den wesentlichen allgemeinen mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens sind im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Risikohinweise“ aufgeführt. Für die konkreten wesentlichen Risiken im Geschäftsjahr verweisen wir auf den Tätigkeitsbericht.

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Die Zusammensetzung des Portfolios und die Portfolioumsätze können der Vermögensaufstellung bzw. den Angaben zu den während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäften, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, entnommen werden. Die Portfolioumsatzkosten werden im Anhang des vorliegenden Jahresberichts ausgewiesen (Transaktionskosten).

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Die Anlageziele und Anlagepolitik des Fonds werden im Tätigkeitsbericht dargestellt. Bei den Anlageentscheidungen werden die mittel- bis langfristigen Entwicklungen der Portfoliogesellschaften berücksichtigt. Dabei soll ein Einklang zwischen den Anlagezielen und Risiken sichergestellt werden.

Einsatz von Stimmrechtsberatern

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern informieren der Mitwirkungsbericht sowie der Stewardship Code der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Dokumente stehen auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil> (Corporate Governance).

Handhabung der Wertpapierleihe und Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten

Auf inländischen Hauptversammlungen von börsennotierten Aktiengesellschaften übt die Kapitalverwaltungsgesellschaft das Stimmrecht entweder selbst oder über Stimmrechtsvertreter aus. Verleihte Aktien werden rechtzeitig an die Kapitalverwaltungsgesellschaft zurückübertragen, sodass diese das Stimmrecht auf Hauptversammlungen wahrnehmen kann. Für die in den Sondervermögen befindlichen ausländischen Aktien erfolgt die Ausübung des Stimmrechts insbesondere bei Gesellschaften, die im EURO STOXX 50® oder STOXX Europe 50® vertreten sind, sowie für US-amerikanische und japanische Gesellschaften mit signifikantem Bestand, falls diese Aktien zum Hauptversammlungstermin nicht verliehen sind. Zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften informieren der Stewardship Code und der Mitwirkungsbericht der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die entsprechenden Dokumente stehen Ihnen

Deka-PB Multi Asset Quant

auf folgender Internetseite zur Verfügung: <https://www.deka.de/privatkunden/ueber-uns/deka-investment-im-profil> (Corporate Governance).

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Ermittlung Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste:

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Berichtszeitraum die in den Anteilpreis einfließenden Wertansätze der im Bestand befindlichen Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Berichtszeitraumes mit den Summenpositionen zum Anfang des Berichtszeitraumes die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Bei den unter der Kategorie „Nichtnotierte Wertpapiere“ ausgewiesenen unterjährigen Transaktionen kann es sich um börsengehandelte bzw. in den organisierten Markt einbezogene Wertpapiere handeln, deren Fälligkeit mittlerweile erreicht ist und die aus diesem Grund der Kategorie nichtnotierte Wertpapiere zugeordnet wurden.

Die Klassifizierung von Geldmarktinstrumenten erfolgt gemäß Einstufung des Informationsdienstleisters WM Datenservice und kann in Einzelfällen von der Definition in § 194 KAGB abweichen. Insofern können Vermögensgegenstände, die gemäß § 194 KAGB unter Geldmarktinstrumente fallen, in der Vermögensaufstellung außerhalb der Kategorie „Geldmarktpapiere“ ausgewiesen sein.

Frankfurt am Main, den 19. März 2024
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers.

**An die Deka Investment GmbH,
Frankfurt am Main**

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Deka-PB Multi Asset Quant – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Deka Investment GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die allgemeinen Angaben zum Management und zur Verwaltung des Sondervermögens.

Unser Prüfungsurteil zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und dementsprechend geben wir dies-

bezüglich weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht des Sondervermögens Deka-PB Multi Asset Quant unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Deka Investment GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzu beziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer

(IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Deka Investment GmbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Deka Investment GmbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Deka Investment GmbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Deka Investment GmbH nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 21. März 2024

Deloitte GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Andreas Koch
Wirtschaftsprüfer

Mathias Bunge
Wirtschaftsprüfer

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 2022

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,1 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 Westdeutsche Landesbausparkasse, 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: 31. Dezember 2023

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

