

Genius Strategie

WKN:

A0RA04

ISIN:

DE000A0RA046



Halbjahresbericht

zum 31. Dezember 2015

LB≡BW Asset Management

Fonds in Feinarbeit.

Inhalt

6	Vermögensübersicht zum 31.12.2015
7	Vermögensaufstellung zum 31.12.2015
27	Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen
29	Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Liebe Anlegerin, lieber Anleger,

wir danken Ihnen für das Vertrauen, das Sie uns entgegenbringen.

Seit unserer Gründung legen wir Fonds für private und institutionelle Anleger auf. Dadurch bieten wir Ihnen die Möglichkeit, an den Entwicklungen der Märkte teilzunehmen. Detailinformationen erhalten Sie von Ihrem Berater.

In diesem Halbjahresbericht können Sie sich ein Bild von der Situation Ihres Fonds verschaffen. Sollten Sie weitergehende Auskünfte zu Ihrem Fonds benötigen, sprechen Sie bitte Ihren Berater an.

Tagesaktuelle Informationen zu Fondspreisen finden Sie im Internet unter **www.LBBW-AM.de** und in der überregionalen Tagespresse.

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH
Geschäftsführung



Achim Koch



Andrea Daniela Bauer



Nicolas Themistocli



Jürgen Zirn

Genius Strategie

Halbjahresbericht zum 31.12.2015

Vermögensübersicht zum 31.12.2015

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	210.441.503,82	100,11
1. Aktien	139.412.381,66	66,32
USA	42.734.882,18	20,33
Frankreich	32.995.565,80	15,70
Bundesrep. Deutschland	30.478.670,34	14,50
Spanien	10.019.439,18	4,77
Niederlande	9.105.994,76	4,33
Italien	7.176.341,00	3,41
Belgien	3.943.453,20	1,88
Finnland	1.074.609,09	0,51
Irland	1.049.053,56	0,50
Curaçao	222.400,40	0,11
Schweiz	182.475,81	0,09
Großbritannien	102.101,95	0,05
Singapur	89.002,95	0,04
Jersey	60.976,01	0,03
Bermuda	59.358,33	0,03
Panama	58.776,08	0,03
Liberia	42.020,01	0,02
Brit. Jungfern-Inseln	17.261,01	0,01
2. Investmentanteile	18.272.607,88	8,69
3. Derivate	1.068.298,10	0,51
4. Bankguthaben	51.566.360,36	24,53
5. Sonstige Vermögensgegenstände	121.855,82	0,06
II. Verbindlichkeiten	-237.665,77	-0,11
III. Fondsvermögen	210.203.838,05	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	157.684.989,54	75,02
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	139.412.381,66	66,32
Aktien									
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	850133		STK	15.239		940	EUR 105,000	1.600.095,00	0,76
Airbus Group SE Aandelen op naam EO 1	938914		STK	25.845		1.091	EUR 62,580	1.617.380,10	0,77
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	840400		STK	20.244		1.195	EUR 163,550	3.310.906,20	1,58
Anheuser-Busch InBev N.V./S.A. Actions au Port. o.N.	590932		STK	34.054		2.009	EUR 115,800	3.943.453,20	1,88
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	A1J4U4		STK	16.437		1.167	EUR 84,090	1.382.187,33	0,66
Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. EO 1	850312		STK	59.676		3.683	EUR 16,920	1.009.717,92	0,48
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	855705		STK	92.930		5.396	EUR 25,295	2.350.664,35	1,12
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	875773		STK	279.308		12.717	EUR 6,836	1.909.349,49	0,91
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	858872		STK	634.196	24.262	49.680	EUR 4,611	2.924.277,76	1,39
BASF SE Namens-Aktien o.N.	BASF11		STK	40.687		2.401	EUR 70,720	2.877.384,64	1,37
Bayer AG Namens-Aktien o.N.	BAY001		STK	36.632		2.162	EUR 115,800	4.241.985,60	2,02
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	519000		STK	14.214		838	EUR 97,630	1.387.712,82	0,66
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	887771		STK	49.528		2.914	EUR 52,590	2.604.677,52	1,24
Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5	852362		STK	24.584	3.255	8.024	EUR 27,115	666.595,16	0,32
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	872087		STK	22.397		839	EUR 40,185	900.023,45	0,43
Daimler AG Namens-Aktien o.N.	710000		STK	44.150		2.606	EUR 77,580	3.425.157,00	1,63
Danone S.A. Actions Port.(C.R.) EO -,25	851194		STK	27.040		1.026	EUR 63,040	1.704.601,60	0,81
Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.	514000		STK	57.537		3.396	EUR 22,525	1.296.020,93	0,62
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	555200		STK	42.407		2.503	EUR 25,955	1.100.673,69	0,52
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	555750		STK	140.376		4.949	EUR 16,690	2.342.875,44	1,11
E.ON SE Namens-Aktien o.N.	ENAG99		STK	88.640		5.231	EUR 8,931	791.643,84	0,38
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	928624		STK	310.329	50.759	43.753	EUR 3,892	1.207.800,47	0,57
Engie S.A. Actions Port. EO 1	A0ER6Q		STK	71.965		4.248	EUR 16,430	1.182.384,95	0,56
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	897791		STK	118.534		8.036	EUR 13,800	1.635.769,20	0,78
Essilor Intl -Cie Génle Opt.SA Actions Port. EO 0,18	863195		STK	9.574		554	EUR 116,250	1.112.977,50	0,53
Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	578560		STK	18.048	18.048		EUR 65,970	1.190.626,56	0,57
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	A0M46B		STK	254.351		16.816	EUR 6,583	1.674.392,63	0,80
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	A11873		STK	46.554		2.748	EUR 32,010	1.490.193,54	0,71
ING Groep N.V. Cert.v.Aandelen EO 0,24	881111		STK	171.407		9.596	EUR 12,615	2.162.299,31	1,03
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. EO 0,52	850605		STK	636.562		36.119	EUR 3,088	1.965.703,46	0,94
Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	940602		STK	42.193		1.661	EUR 23,935	1.009.889,46	0,48
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	853292		STK	12.049		703	EUR 147,150	1.773.010,35	0,84
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	843002		STK	6.502		670	EUR 184,550	1.199.944,10	0,57

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Nokia Corp. Registered Shares EO 0,06	870737		STK	162.943		9.607	EUR 6,595	1.074.609,09	0,51
Orange S.A. Actions Port. EO 4	906849		STK	90.305	2.374	2.857	EUR 15,580	1.406.951,90	0,67
Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2	853888		STK	10.818		669	EUR 157,350	1.702.212,30	0,81
SAFRAN Actions Port. EO -,20	924781		STK	15.143	18.000	2.857	EUR 63,750	965.366,25	0,46
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	920657		STK	52.921	778	4.531	EUR 79,710	4.218.332,91	2,01
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	716460		STK	42.801		1.893	EUR 73,380	3.140.737,38	1,49
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	860180		STK	26.029		1.393	EUR 53,680	1.397.236,72	0,66
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	723610		STK	34.378		2.554	EUR 89,880	3.089.894,64	1,47
Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25	873403		STK	35.708		2.065	EUR 42,785	1.527.766,78	0,73
Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1	850775		STK	193.604		10.187	EUR 10,440	2.021.225,76	0,96
Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50	850727		STK	106.951	847	5.469	EUR 41,565	4.445.418,31	2,11
Unibail-Rodamco SE Actions Port. EO 5	863733		STK	4.369		231	EUR 235,750	1.029.991,75	0,49
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	A1JRZM		STK	264.333	3.079		EUR 5,135	1.357.349,95	0,65
Unilever N.V. Cert.v.Aandelen EO-,16	A0JMBZ		STK	69.138		4.128	EUR 40,530	2.802.163,14	1,33
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	867475		STK	23.200		1.358	EUR 59,480	1.379.936,00	0,66
Vivendi S.A. Actions Port. EO 5,5	591068		STK	51.885	2.766	11.092	EUR 19,800	1.027.323,00	0,49
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	766403		STK	8.098	1.274	414	EUR 133,750	1.083.107,50	0,52
21st Century Fox Inc. Registered Shares A DL -,01	A1WZP6		STK	3.274		1.980	USD 27,300	81.788,58	0,04
21st Century Fox Inc. Registered Shares B DL -,01	A1WZPY		STK	1.156	1.156		USD 27,350	28.931,21	0,01
3M Co. Registered Shares DL -,01	851745		STK	1.668			USD 151,910	231.864,24	0,11
Abbott Laboratories Registered Shares o.N.	850103		STK	4.127			USD 45,270	170.960,72	0,08
AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01	A1J84E		STK	4.611			USD 59,800	252.317,67	0,12
Accenture PLC Reg.Shares Class A DL -,000025	A0YAQA		STK	1.693			USD 105,860	163.998,63	0,08
ACE Ltd. Registered Shares SF 24,77	A0Q636		STK	892			USD 118,200	96.479,20	0,05
Activision Blizzard Inc. Registered Shares DL-,000001	A0Q4K4		STK	1.343	1.343		USD 39,430	48.456,74	0,02
Adobe Systems Inc. Registered Shares o.N.	871981		STK	1.311			USD 95,280	114.302,52	0,05
ADT Corp. Registered Shares DL -,01	A1J4DC		STK	579			USD 33,690	17.849,70	0,01
Advance Auto Parts Inc. Registered Shares DL -,0001	982516		STK	196	196		USD 151,400	27.153,97	0,01
AES Corp., The Registered Shares DL -,01	882177		STK	1.626			USD 9,500	14.134,99	0,01
Aetna Inc. Registered Shares DL -,01	602155		STK	999			USD 108,930	99.578,22	0,05
Affiliated Managers Group Inc. Registered Shares o.N.	910682		STK	147			USD 160,740	21.621,84	0,01
AFLAC Inc. Registered Shares DL -,10	853081		STK	1.229			USD 60,520	68.061,60	0,03
Agilent Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	929138		STK	912			USD 42,170	35.192,47	0,02
AGL Resources Inc. Registered Shares DL 5	855231		STK	310			USD 63,820	18.103,80	0,01
Air Products & Chemicals Inc. Registered Shares DL 1	854912		STK	546			USD 132,260	66.080,38	0,03

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Airgas Inc. Registered Shares DL -,01	872942		STK	180			USD 138,540	22.819,13	0,01
Akamai Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	928906		STK	467			USD 52,900	22.606,01	0,01
Alcoa Inc. Registered Shares DL 1	850206		STK	2.810			USD 9,960	25.610,44	0,01
Alexion Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,0001	899527		STK	513			USD 191,310	89.806,22	0,04
Allegion PLC Registered Shares DL 1	A1W869		STK	241			USD 66,610	14.689,53	0,01
Allergan PLC Registered Shares DL-,0001	A14U12		STK	997			USD 315,060	287.435,09	0,14
Alliance Data Systems Corp. Registered Shares DL -,01	934251		STK	128			USD 276,770	32.417,56	0,02
Allstate Corp., The Registered Shares DL -,01	886429		STK	1.255			USD 62,810	72.131,32	0,03
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	A14Y6H		STK	793	793		USD 771,000	559.472,74	0,27
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	A14Y6F		STK	777	777		USD 790,300	561.906,90	0,27
Altria Group Inc. Registered Shares DL -,333	200417		STK	5.281			USD 58,800	284.148,17	0,14
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	906866		STK	1.020			USD 689,070	643.153,86	0,31
Ameren Corp. Registered Shares DL -,01	911535		STK	638			USD 44,000	25.687,67	0,01
American Airlines Group Inc. Registered Shares DL -,01	A1W97M		STK	1.913			USD 42,800	74.922,13	0,04
American Electric Power Co.Inc Registered Shares DL 6,50	850222		STK	1.276			USD 58,900	68.772,90	0,03
American Express Co. Registered Shares DL -,20	850226		STK	2.525			USD 70,160	162.107,21	0,08
American International Grp Inc Registered Shares New DL 2,50	A0X88Z		STK	3.472		407	USD 62,510	198.600,61	0,09
American Tower Corp. Registered Shares DL -,01	A1JRLA		STK	1.038			USD 98,100	93.178,93	0,04
Ameriprise Financial Inc. Registered Shares DL -,01	A0F55S		STK	535			USD 107,290	52.524,80	0,02
AmerisourceBergen Corp. Registered Shares DL -,01	766149		STK	605			USD 105,020	58.140,50	0,03
AMETEK Inc. Registered Shares DL -,01	908668		STK	641			USD 54,180	31.779,60	0,02
Amgen Inc. Registered Shares DL -,0001	867900		STK	1.967			USD 163,290	293.910,64	0,14
Amphenol Corp. New Registered Shares Cl.A DL-,001	882749		STK	840			USD 52,930	40.684,83	0,02
Anadarko Petroleum Corp. Registered Shares DL -,10	871766		STK	1.315			USD 48,380	58.216,08	0,03
Analog Devices Inc. Registered Shares DL -,166	862485		STK	804			USD 56,550	41.604,47	0,02
Anthem Inc. Registered Shares DL -,01	A12FMV		STK	799			USD 140,960	103.060,92	0,05
AON PLC Registered Shares A DL -,01	A1JWHG		STK	819			USD 93,540	70.102,36	0,03
Apache Corp. Registered Shares DL -,625	857530		STK	1.029			USD 44,810	42.193,12	0,02
Apartment Inv. & Managem. Co. Registered Shares Cl.A DL -,01	891759		STK	383			USD 40,360	14.144,95	0,01
Apple Inc. Registered Shares o.N.	865985		STK	15.460		245	USD 107,320	1.518.243,81	0,72
Applied Materials Inc. Registered Shares o.N.	865177		STK	3.153			USD 18,960	54.703,32	0,03

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Archer Daniels Midland Co. Registered Shares o.N.	854161		STK	1.730			USD 36,880	58.383,27	0,03
Assurant Inc. Registered Shares DL -,01	A0BLRP		STK	207			USD 81,370	15.412,96	0,01
AT & T Inc. Registered Shares DL 1	A0HL9Z		STK	16.153	2.346		USD 34,740	513.492,82	0,24
Autodesk Inc. Registered Shares o.N.	869964		STK	590			USD 62,250	33.608,00	0,02
Automatic Data Processing Inc. Registered Shares DL -,10	850347		STK	1.274			USD 86,380	100.701,05	0,05
Autonation Inc. Registered Shares DL -,01	880953		STK	102			USD 60,280	5.626,32	0,00
AutoZone Inc. Registered Shares DL -,01	881531		STK	95			USD 750,170	65.213,07	0,03
Avago Technologies Ltd. Registered Shares o.N.	A0X9TN		STK	660			USD 147,370	89.002,95	0,04
Avalonbay Communities Inc. Registered Shares DL -,01	914867		STK	319			USD 185,320	54.095,90	0,03
Avery Dennison Corp. Registered Shares DL 1	850354		STK	263			USD 63,340	15.243,52	0,01
Baker Hughes Inc. Registered Shares DL 1	872933		STK	1.161			USD 45,760	48.614,92	0,02
Ball Corp. Registered Shares o.N.	860408		STK	393			USD 73,330	26.370,94	0,01
Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01	858388		STK	28.431			USD 17,050	443.575,84	0,21
Bard Inc. C.R. Registered Shares DL -,25	856332		STK	200			USD 190,690	34.898,70	0,02
Baxalta Inc. Registered Shares DL -,01	A14SCR		STK	1.460	2.895	1.435	USD 39,100	52.237,33	0,02
Baxter International Inc. Registered Shares DL 1	853815		STK	1.434			USD 38,050	49.929,27	0,02
BB&T Corp. Registered Shares DL 5	884233		STK	1.839			USD 38,170	64.232,56	0,03
Becton, Dickinson & Co. Registered Shares DL 1	857675		STK	555			USD 155,430	78.936,74	0,04
Bed Bath & Beyond Inc. Registered Shares DL -,01	884304		STK	594			USD 48,610	26.421,86	0,01
Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New DL -,00333	A0YJQ2		STK	5.027	234		USD 133,260	612.999,41	0,29
Best Buy Co. Inc. Registered Shares DL -,10	873629		STK	699			USD 30,460	19.483,12	0,01
Biogen Inc. Registered Shares DL-,0005	789617		STK	621			USD 308,340	175.215,63	0,08
Bk of New York MellonCorp.,The Registered Shares DL -,01	A0MVKA		STK	3.057			USD 41,280	115.474,61	0,05
Blackrock Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	928193		STK	330			USD 342,050	103.289,20	0,05
Block H. & R. Inc. Registered Shares o.N.	859376		STK	713			USD 33,420	21.804,56	0,01
Boeing Co. Registered Shares DL 5	850471		STK	1.788			USD 146,410	239.546,38	0,11
BorgWarner Inc. Registered Shares DL -,01	887320		STK	608			USD 43,920	24.435,28	0,01
Boston Properties Inc. Registered Shares DL -,01	907550		STK	398			USD 128,600	46.835,53	0,02
Boston Scientific Corp. Registered Shares DL -,01	884113		STK	3.567			USD 18,610	60.743,64	0,03
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	850501		STK	4.302			USD 69,520	273.672,74	0,13
Broadcom Corp. Reg. Shares Class A DL -,0001	913684		STK	1.375			USD 58,220	73.253,14	0,03
Brown-Forman Corp. Reg. Shares Class B DL -,15	856693		STK	398			USD 101,420	36.936,70	0,02

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
C.H. Robinson Worldwide Inc. Registered Shs (new) DL -,10	A0HGF5		STK	423			USD 62,360	24.137,81	0,01
CA Inc. Registered Shares DL -,10	A0JC59		STK	875			USD 29,110	23.307,82	0,01
Cablevision Systems Corp. Reg. Shs of N.Y. Grp DL-,01	870536		STK	564			USD 31,860	16.442,82	0,01
Cabot Oil & Gas Corp. Registered Shares DL -,10	881646		STK	1.106			USD 17,010	17.215,15	0,01
Cameron International Corp. Registered Shares DL -,01	A0JMNW		STK	651			USD 63,130	37.606,95	0,02
Campbell Soup Co. Registered Shares DL -,0375	850561		STK	471			USD 53,210	22.933,25	0,01
Capital One Financial Corp. Registered Shares DL -,01	893413		STK	1.530			USD 73,210	102.497,48	0,05
Cardinal Health Inc. Registered Shares o.N.	880206		STK	896			USD 90,540	74.233,49	0,04
Care Capital Properties Inc. Registered Shares DL -,01	A14XWL		STK	191	191		USD 30,730	5.370,90	0,00
Carmax Inc. Registered Shares DL -,50	662604		STK	600			USD 54,560	29.955,53	0,01
Carnival Corp. Paired Ctf(1Sh.Carn.+1SBI P&O)	120100		STK	1.167			USD 55,040	58.776,08	0,03
Caterpillar Inc. Registered Shares DL 1	850598		STK	1.721			USD 68,690	108.174,71	0,05
CBRE Group Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	A1JLYH		STK	799			USD 34,640	25.326,55	0,01
CBS Corp. Reg. Shares Class B DL -,001	A0HM1P		STK	1.537			USD 46,760	65.765,74	0,03
Celgene Corp. Registered Shares DL -,01	881244		STK	2.200			USD 120,680	242.945,77	0,12
CenterPoint Energy Inc. Registered Shares o.N.	854566		STK	1.124			USD 18,300	18.822,13	0,01
CenturyLink Inc. Registered Shares DL 1	866405		STK	1.644			USD 25,380	38.180,78	0,02
Cerner Corp. Registered Shares DL -,01	892807		STK	774			USD 60,630	42.941,77	0,02
CF Industries Holdings Inc. Registered Shares DL -,01	A0ES9N		STK	780			USD 41,160	29.377,94	0,01
Chesapeake Energy Corp. Registered Shares DL -,01	885725		STK	1.368			USD 4,400	5.507,95	0,00
Chevron Corp. Registered Shares DL-,75	852552		STK	5.105			USD 90,090	420.846,48	0,20
Chipotle Mexican Grill Inc. Registered Shares DL -,01	A0ESP5		STK	82			USD 485,790	36.451,36	0,02
Chubb Corp., The Registered Shares DL 1	860118		STK	686			USD 133,670	83.909,17	0,04
Cigna Corp. Registered Shares DL 1	866918		STK	751			USD 146,850	100.917,21	0,05
Cimarex Energy Co. Registered Shares DL -,01	662718		STK	232			USD 89,510	19.002,51	0,01
Cincinnati Financial Corp. Registered Shares DL 2	878440		STK	386			USD 60,100	21.228,20	0,01
Cintas Corp. Registered Shares o.N.	880205		STK	275			USD 92,240	23.211,51	0,01
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	878841		STK	14.010			USD 27,530	352.935,80	0,17
Citigroup Inc. Registered Shares New DL -,01	A1H92V		STK	7.985			USD 52,300	382.144,82	0,18
Citrix Systems Inc. Registered Shares DL -,001	898407		STK	490			USD 76,960	34.507,42	0,02
Clorox Co., The Registered Shares DL 1	856678		STK	344			USD 128,200	40.355,04	0,02

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
CME Group Inc. Registered Shares DL-,01	A0MW32		STK	806			USD 91,520	67.499,79	0,03
CMS Energy Corp. Registered Shares DL -,01	850795		STK	696			USD 36,680	23.360,92	0,01
Coach Inc. Registered Shares DL -,01	566039		STK	738			USD 32,670	22.062,61	0,01
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	850663		STK	10.071			USD 43,570	401.524,01	0,19
Coca-Cola Enterprises Inc. (NEW Registered Shares DL 1	A1C56R		STK	690			USD 49,620	31.329,77	0,01
Cognizant Technology Sol.Corp. Reg. Shs Class A DL -,01	915272		STK	1.586			USD 61,000	88.528,76	0,04
Colgate-Palmolive Co. Registered Shares DL 1	850667		STK	2.310			USD 67,530	142.744,73	0,07
Columbia Pipeline Group Inc. Registered Shares o.N.	A14UH9		STK	818	818		USD 19,490	14.588,70	0,01
Comcast Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	157484		STK	6.659	988	1.264	USD 56,710	345.557,26	0,16
Comerica Inc. Registered Shares DL 5	864861		STK	493			USD 41,980	18.938,29	0,01
Computer Sciences Corp. Registered Shares DL 1	855862		STK	403			USD 33,120	12.213,69	0,01
ConAgra Foods Inc. Registered Shares DL 5	861259		STK	1.087			USD 42,590	42.363,18	0,02
ConocoPhillips Registered Shares DL -,01	575302		STK	3.208			USD 46,600	136.795,45	0,07
CONSOL Energy Inc. Registered Shares DL-,01	922002		STK	599			USD 7,780	4.264,40	0,00
Consolidated Edison Inc. Registered Shares DL -,01	911563		STK	770			USD 65,250	45.975,09	0,02
Constellation Brands Inc. Reg. Shs Cl.A DL -,01	871918		STK	401			USD 144,170	52.901,82	0,03
Corning Inc. Registered Shares DL -,50	850808		STK	3.869			USD 18,490	65.461,66	0,03
Costco Wholesale Corp. Registered Shares DL -,005	888351		STK	1.145			USD 162,710	170.479,08	0,08
Crown Castle Internatl Corp. Reg. Shares new DL -,01	A12GN3		STK	770			USD 87,020	61.314,21	0,03
CSRA Inc. Registered Shares DL-,001	A143T8		STK	403	403		USD 29,850	11.007,81	0,01
CSX Corp. Registered Shares DL 1	865857		STK	2.682			USD 25,900	63.563,81	0,03
Cummins Inc. Registered Shares DL 2,50	853121		STK	464			USD 89,180	37.864,90	0,02
CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01	859034		STK	3.002			USD 98,740	271.240,90	0,13
D.R. Horton Inc. Registered Shares DL -,01	884312		STK	735			USD 32,440	21.818,23	0,01
Danaher Corp. Registered Shares DL -,01	866197		STK	1.523			USD 93,350	130.096,49	0,06
Darden Restaurants Inc. Registered Shares o.N.	895738		STK	340			USD 64,290	20.002,01	0,01
DaVita HealthCare Partners Inc Registered Shares DL -,001	897914		STK	444			USD 70,020	28.448,31	0,01
Deere & Co. Registered Shares DL 1	850866		STK	1.024			USD 77,500	72.619,46	0,03
Delphi Automotive PLC Registered Shares DL -,01	A1JPLB		STK	770			USD 86,540	60.976,01	0,03
Delta Air Lines Inc. Registered Shares DL -,0001	A0MQV8		STK	2.252			USD 51,170	105.447,23	0,05
Dentsply International Inc. Registered Shares DL -,01	884794		STK	375			USD 61,410	21.072,78	0,01

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Devon Energy Corp. Registered Shares DL -,10	925345		STK	992			USD 31,000	28.140,04	0,01
Diamond Offshore Drilling Registered Shares DL -,01	897577		STK	183			USD 20,850	3.491,47	0,00
Discover Financial Services Registered Shares DL -,01	A0MUES		STK	1.302			USD 54,250	64.634,16	0,03
Discovery Communications Inc. Reg. Shares Series A DL-,01	A0Q90G		STK	644			USD 26,560	15.651,84	0,01
Discovery Communications Inc. Reg. Shares Series C DL-,01	A0Q90J		STK	644			USD 25,060	14.767,88	0,01
Disney Co., The Walt Registered Shares DL -,01	855686		STK	4.360			USD 106,340	424.262,37	0,20
Dollar General Corp. (New) Registered Shares DL -,875	A0YEES		STK	795			USD 72,100	52.451,00	0,02
Dollar Tree Inc. Registered Shares DL -,01	A0NFQC		STK	659	62		USD 77,620	46.806,96	0,02
Dominion Resources Inc.(New) Registered Shares o.N.	932798		STK	1.514			USD 68,680	95.149,72	0,05
Dover Corp. Registered Shares DL 1	853707		STK	459			USD 61,680	25.906,48	0,01
Dow Chemical Co., The Registered Shares DL 2,50	850917		STK	3.165			USD 51,660	149.616,50	0,07
Dr. Pepper Snapple Group Inc. Registered Shares DL -,01	A0MV07		STK	535			USD 94,650	46.336,77	0,02
DTE Energy Co. Registered Shares o.N.	853943		STK	453			USD 81,540	33.800,28	0,02
Du Pont Nemours & Co., E.I. Registered Shares DL -,30	852046		STK	2.455			USD 67,330	151.255,60	0,07
Duke Energy Corp. (New) Registered Shares New DL -,001	A1J0EV		STK	1.852			USD 72,190	122.340,26	0,06
Dun & Bradstreet Corp. (Del.) Registered Shares DL 1	578481		STK	107			USD 105,800	10.359,07	0,00
E*TRADE Financial Corp. Registered Shares New DL -,01	A1CZ84		STK	750			USD 29,900	20.520,31	0,01
Eastman Chemical Co. Registered Shares DL -,01	889082		STK	405			USD 67,800	25.126,74	0,01
Eaton Corporation PLC Registered Shares DL -,01	A1J88N		STK	1.238			USD 52,590	59.576,53	0,03
eBay Inc. Registered Shares DL -,001	916529		STK	3.066			USD 27,750	77.855,00	0,04
Ecolab Inc. Registered Shares DL 1	854545		STK	698			USD 115,430	73.726,82	0,04
Edison International Registered Shares o.N.	887629		STK	856			USD 60,300	47.232,66	0,02
Edwards Lifesciences Corp. Registered Shares DL 1	936853		STK	600	600	300	USD 79,210	43.489,32	0,02
Electronic Arts Inc. Registered Shares DL -,01	878372		STK	788			USD 69,650	50.222,54	0,02
EMC Corp. (Mass.) Registered Shares DL -,01	872526		STK	5.530			USD 25,720	130.150,99	0,06
Emerson Electric Co. Registered Shares DL -,50	850981		STK	1.897			USD 48,530	84.242,06	0,04
Endo International PLC Registered Shares DL -,0001	A1XE6M		STK	444			USD 62,420	25.360,52	0,01
Ensco PLC Registered Shares Cl. A DL-,10	A1JYNN		STK	611			USD 14,890	8.325,06	0,00
Entergy Corp. Registered Shares DL -,01	889290		STK	468			USD 69,250	29.656,30	0,01
EOG Resources Inc. Registered Shares DL -,01	877961		STK	1.428			USD 70,610	92.266,87	0,04
EQT Corp. Registered Shares o.N.	A0RFZL		STK	396			USD 51,410	18.629,20	0,01

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Equifax Inc. Registered Shares DL 1,25	854618		STK	316			USD 112,770	32.608,59	0,02
Equinix Inc. Registered Shares DL -,001	A14M21		STK	155	4		USD 302,690	42.932,00	0,02
Equity Residential Reg.Shs of Benef. Int. DL -,01	985334		STK	842			USD 81,890	63.094,91	0,03
Essex Property Trust Inc. Registered Shares DL -,0001	891315		STK	163			USD 243,270	36.285,03	0,02
Estée Lauder Compan. Inc., The Reg. Shares Class A DL -,01	897933		STK	630			USD 89,030	51.324,92	0,02
Eversource Energy Registered Shares DL 5	A14NE5		STK	826			USD 51,850	39.190,44	0,02
Exelon Corp. Registered Shares o.N.	852011		STK	2.247			USD 27,690	56.934,75	0,03
Expedia Inc. Registered Shares DL-,0001	A1JRLJ		STK	245			USD 126,270	28.308,55	0,01
Expeditors Intl of Wash. Inc. Registered Shares DL -,01	875272		STK	543			USD 45,580	22.647,77	0,01
Express Scripts Holding Inc. Registered Shares DL -,01	A1JWJL		STK	1.812		339	USD 87,870	145.696,86	0,07
Exxon Mobil Corp. Registered Shares o.N.	852549		STK	11.449			USD 78,110	818.324,51	0,39
F5 Networks Inc. Registered Shares o.N.	922977		STK	207			USD 98,060	18.574,35	0,01
Facebook Inc. Reg.Shares Cl.A DL-,000006	A1JWVX		STK	6.060	528		USD 106,220	589.020,33	0,28
Fastenal Co. Registered Shares DL -,01	887891		STK	709			USD 41,510	26.930,87	0,01
Fedex Corp. Registered Shares DL -,10	912029		STK	768			USD 149,180	104.839,08	0,05
Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. Registered Shares DL -,01	A0H1FP		STK	770			USD 60,990	42.973,50	0,02
Fifth Third Bancorp Registered Shares o.N.	875029		STK	2.300			USD 20,250	42.619,10	0,02
First Solar Inc. Registered Shares DL -,001	A0LEKM		STK	158			USD 66,990	9.685,42	0,00
FirstEnergy Corp. Registered Shares DL 10	910509		STK	1.099			USD 32,290	32.472,60	0,02
Fiserv Inc. Registered Shares DL -,01	881793		STK	702			USD 92,960	59.715,16	0,03
Flir Systems Inc. Registered Shares DL -,01	917029		STK	381			USD 28,335	9.878,69	0,00
Flowserve Corp. Registered Shares DL 1,25	864999		STK	378			USD 42,560	14.721,25	0,01
Fluor Corp. (New) Registered Shares DL -,01	591332		STK	427			USD 47,770	18.665,28	0,01
FMC Corp. Registered Shares DL -,10	871138		STK	362			USD 39,690	13.147,44	0,01
FMC Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	634793		STK	625			USD 29,160	16.677,04	0,01
Ford Motor Co. Registered Shares DL -,01	502391		STK	10.306			USD 14,170	133.632,27	0,06
Fossil Group Inc. Registered Shares DL -,01	A1W0DE		STK	140			USD 37,130	4.756,68	0,00
Four Corners Pty Trust Inc. Registered Shares DL -,0001	A142WX		STK	113	113		USD 23,990	2.480,62	0,00
Franklin Resources Inc. Registered Shares DL -,10	870315		STK	1.089			USD 37,030	36.900,56	0,02
Freeport-McMoRan Inc. Reg. Shares DL-,10	896476		STK	2.727			USD 6,770	16.893,72	0,01

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Frontier Communications Corp. Registered Shares DL -,25	A0Q7PU		STK	2.623			USD 4,660	11.184,99	0,01
Gamestop Corp. (new) Reg. Shares Class A DL -,001	A0HGDX		STK	318			USD 28,480	8.287,40	0,00
Gap Inc. Registered Shares DL -,05	863533		STK	781			USD 25,240	18.038,14	0,01
Garmin Ltd. Namens-Aktien SF 10	A1C06B		STK	288			USD 37,310	9.832,62	0,00
General Electric Co. Registered Shares DL -,06	851144		STK	25.370		1.146	USD 31,050	720.830,97	0,34
General Growth Prop.Inc.(New) Registered Shares DL -,01	A1C8LU		STK	1.409			USD 27,410	35.340,39	0,02
General Mills Inc. Registered Shares DL -,10	853862		STK	1.699			USD 58,560	91.042,84	0,04
General Motors Co. Registered Shares DL -,01	A1C9CM		STK	3.865	880		USD 34,330	121.415,65	0,06
Genuine Parts Co. Registered Shares DL 1	858406		STK	407			USD 86,870	32.353,08	0,02
Genworth Financial Inc. Reg. Shares Class A DL -,001	A0CA8M		STK	1.295			USD 3,750	4.443,78	0,00
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	885823		STK	4.000			USD 102,160	373.931,66	0,18
Goldman Sachs Group Inc., The Registered Shares DL -,01	920332		STK	1.150			USD 182,010	191.533,37	0,09
Goodyear Tire & Rubber Co.,The Registered Shares o.N.	851204		STK	645			USD 33,305	19.657,15	0,01
Grainger Inc., W.W. Registered Shares DL 1	857498		STK	157			USD 204,700	29.408,23	0,01
Halliburton Co. Registered Shares DL 2,50	853986		STK	2.448			USD 34,130	76.453,80	0,04
Hanesbrands Inc. Registered Shares DL -,01	A0KEQF		STK	1.069			USD 29,080	28.446,15	0,01
Harley-Davidson Inc. Registered Shares DL -,01	871394		STK	594			USD 45,560	24.764,04	0,01
Harman Intl Industries Inc. Registered Shares DL -,01	872136		STK	179			USD 94,770	15.522,99	0,01
Harris Corp. Registered Shares DL 1	851270		STK	297			USD 87,430	23.761,20	0,01
Hartford Finl SvcsGrp Inc.,The Registered Shares DL -,01	898521		STK	1.147			USD 43,840	46.013,51	0,02
Hasbro Inc. Registered Shares DL -,50	859888		STK	301			USD 67,500	18.591,81	0,01
HCA Holdings Inc. Registered Shares DL -,01	A1JFMW		STK	811			USD 68,440	50.790,47	0,02
HCP Inc. Registered Shares DL 1	A0M2ZX		STK	1.191			USD 38,650	42.122,35	0,02
Helmerich & Payne Inc. Registered Shares DL -,10	851292		STK	279			USD 52,760	13.469,78	0,01
Henry Schein Inc. Registered Shares DL -,01	897961		STK	224			USD 159,910	32.777,44	0,02
Hershey Co., The Registered Shares DL 1,-	851297		STK	395			USD 90,600	32.747,39	0,02
Hess Corp. Registered Shares DL 1	A0JMQJ		STK	781			USD 48,170	34.425,40	0,02
Hewlett Packard Enterprise Co. Registered Shares DL -,01	A140KD		STK	4.862	9.978	5.116	USD 15,280	67.981,33	0,03
Home Depot Inc., The Registered Shares DL -,05	866953		STK	3.456		185	USD 133,350	421.714,10	0,20
Honeywell International Inc. Registered Shares DL 1	870153		STK	2.059			USD 104,460	196.814,79	0,09
Hormel Foods Corp. Registered Shares DL 0,0586	850875		STK	353			USD 79,660	25.731,58	0,01
Host Hotels & Resorts Inc. Registered Shares DL 0,01	918239		STK	1.909			USD 15,760	27.530,46	0,01
HP Inc. Registered Shares DL -,01	A142VP		STK	5.131	5.131		USD 11,840	55.591,08	0,03

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Humana Inc. Registered Shares DL -,166	856584		STK	416			USD 179,000	68.139,31	0,03
Hunt (J.B.) Transport Svcs Inc Registered Shares DL -,01	885365		STK	247	247		USD 73,030	16.506,30	0,01
Huntington Bancshares Inc. Registered Shares DL-,01	867622		STK	2.212			USD 11,170	22.609,43	0,01
Illinois Tool Works Inc. Registered Shares o.N.	861219		STK	1.091			USD 93,190	93.034,80	0,04
Illumina Inc. Registered Shares DL -,01	927079		STK	389	389		USD 191,070	68.013,24	0,03
Ingersoll-Rand PLC Registered Shares DL 1	A0NEQZ		STK	724			USD 55,830	36.987,72	0,02
Intel Corp. Registered Shares DL -,001	855681		STK	12.996			USD 34,990	416.106,99	0,20
Intercontinental Exchange Inc. Registered Shares DL -,01	A1W5H0		STK	300			USD 256,930	70.532,20	0,03
International Paper Co. Registered Shares DL 1	851413		STK	1.159			USD 38,200	40.513,35	0,02
Interpublic Group of Comp.Inc. Registered Shares DL -,10	851781		STK	1.088			USD 23,550	23.446,13	0,01
Intl Business Machines Corp. Registered Shares DL -,20	851399		STK	2.459			USD 139,340	313.534,76	0,15
Intl Flavors & Fragrances Inc. Registered Shares DL -,125	853881		STK	214			USD 120,620	23.620,25	0,01
Intuit Inc. Registered Shares DL -,01	886053		STK	732			USD 98,280	65.830,57	0,03
Intuitive Surgical Inc. Registered Shares DL -,001	888024		STK	105			USD 552,510	53.086,10	0,03
Invesco Ltd. Registered Shares DL -,10	A0M6U7		STK	1.159			USD 33,380	35.401,46	0,02
Iron Mountain Inc. Registered Shares DL -,01	A14MS9		STK	471			USD 27,580	11.886,84	0,01
J.M. Smucker Co. Registered Shares o.N.	633835		STK	282			USD 123,950	31.985,05	0,02
Jacobs Engineering Group Inc. Registered Shares DL 1	864215		STK	343			USD 42,420	13.314,23	0,01
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	853260		STK	7.345			USD 103,780	697.520,27	0,33
Johnson Controls Inc. Registered Shares DL -,0139	857069		STK	1.798			USD 40,230	66.189,80	0,03
Joy Global Inc. Registered Shares DL 1,-	779633		STK	279			USD 12,800	3.267,88	0,00
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	850628		STK	10.057			USD 66,590	612.814,21	0,29
Juniper Networks Inc. Registered Shares DL -,01	923889		STK	1.355			USD 27,710	34.357,95	0,02
Kansas City Southern Registered Shares o.N.	502665		STK	289			USD 74,270	19.640,96	0,01
Kellogg Co. Registered Shares DL -,25	853265		STK	656			USD 73,190	43.934,63	0,02
Keurig Green Mountain Inc. Registered Shares DL -,10	A1XFME		STK	342			USD 90,110	28.200,09	0,01
Keycorp Registered Shares DL 1	869353		STK	2.428			USD 13,250	29.438,52	0,01
Kimberly-Clark Corp. Registered Shares DL 1,25	855178		STK	1.019			USD 129,430	120.687,00	0,06
Kimco Realty Corp. Registered Shares DL -,01	883111		STK	1.072			USD 26,690	26.181,51	0,01
Kinder Morgan Inc. (Del.) Registered Shares P DL -,01	A1H6GK		STK	4.511			USD 14,540	60.018,98	0,03
KLA-Tencor Corp. Registered Shares DL 0,001	865884		STK	437			USD 69,690	27.867,84	0,01

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Kohl's Corp. Registered Shares DL -,01	884195		STK	556			USD 48,390	24.619,64	0,01
Kraft Heinz Co., The Registered Shares DL -,01	A14TU4		STK	1.557	1.557		USD 73,750	105.075,63	0,05
Kroger Co., The Registered Shares DL 1	851544		STK	2.724	2.724	1.362	USD 42,310	105.463,33	0,05
L Brands Inc. Registered Shares DL -,50	A1T7NF		STK	629			USD 96,670	55.640,85	0,03
L-3 Communications Hldgs Inc. Registered Shares DL -,01	914398		STK	236			USD 120,940	26.117,60	0,01
Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Registered Shares DL -,10	895308		STK	245			USD 124,190	27.842,23	0,01
Lam Research Corp. Registered Shares DL -,001	869686		STK	427			USD 80,170	31.325,00	0,01
Legg Mason Inc. Registered Shares DL -,10	868079		STK	302			USD 39,350	10.874,34	0,01
Leggett & Platt Inc. Registered Shares DL -,01	883524		STK	375			USD 42,540	14.597,55	0,01
Lennar Corp. Reg. Shares Cl. A DL -,10	851022		STK	434			USD 49,360	19.602,72	0,01
Leucadia National Corp. Registered Shares DL 1	857094		STK	771			USD 17,100	12.064,29	0,01
Level 3 Communications Inc. Registered Shares New DL -,01	A1JL12		STK	738			USD 54,200	36.602,19	0,02
Lilly & Co., Eli Registered Shares o.N.	858560		STK	2.623			USD 86,200	206.898,30	0,10
Lincoln National Corp. Registered Shares o.N.	859406		STK	713			USD 50,830	33.163,55	0,02
Linear Technology Corp. Registered Shares DL-,001	872629		STK	611			USD 43,350	24.237,16	0,01
Loew's Corp. Registered Shares DL 1	851615		STK	813			USD 38,510	28.649,39	0,01
Lowe's Companies Inc. Registered Shares DL -,50	859545		STK	2.503		414	USD 76,860	176.040,50	0,08
Lyondellbasell Industries NV Registered Shares A EO -,04	A1CWRM		STK	998			USD 87,760	80.145,39	0,04
M and T Bank Corp. Registered Shares DL -,50	863582		STK	414	93		USD 122,640	46.460,50	0,02
Macerich Co., The Registered Shares DL -,01	888353		STK	361			USD 81,650	26.972,10	0,01
Macy's, Inc. Registered Shares DL -,01	A0MS7Y		STK	1.039			USD 35,380	33.637,58	0,02
Mallinckrodt PLC Registered Shares DL-,20	A1W0TN		STK	300			USD 75,880	20.830,51	0,01
Marathon Oil Corp. Registered Shares DL 1	852789		STK	1.860			USD 12,380	21.070,99	0,01
Marathon Petroleum Corp. Registered Shares DL -,01	A1JEXK		STK	1.742			USD 52,300	83.368,35	0,04
Marriott International Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	913070		STK	640			USD 68,020	39.835,29	0,02
Marsh & McLennan Cos. Inc. Registered Shares DL 1	858415		STK	1.441			USD 56,100	73.973,85	0,04
Martin Marietta Materials Inc. Registered Shares DL -,01	889585		STK	161			USD 137,290	20.226,29	0,01
Masco Corp. Registered Shares DL 1	856632		STK	937			USD 28,410	24.359,15	0,01
MasterCard Inc. Registered Shares A DL -,0001	A0F602		STK	2.770			USD 98,870	250.608,43	0,12
Mattel Inc. Registered Shares DL 1	851704		STK	905			USD 27,440	22.723,96	0,01
McCormick & Co. Inc. Reg. Shares (Non Voting) o.N.	858250		STK	349			USD 86,600	27.656,34	0,01

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
McDonald's Corp. Registered Shares DL-,01	856958		STK	2.635			USD 119,430	287.968,79	0,14
McGraw Hill Financial Inc. Registered Shares DL 1	851710		STK	738			USD 99,860	67.437,16	0,03
McKesson Corp. Registered Shares DL -,01	893953		STK	612			USD 198,740	111.298,18	0,05
Mead Johnson Nutrition Co. Registered Shares DL-,01	A0RFXZ		STK	532			USD 79,330	38.618,95	0,02
Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001	A14M2J		STK	3.842			USD 77,530	272.570,29	0,13
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	A0YD8Q		STK	7.941			USD 53,250	386.942,27	0,18
MetLife Inc. Registered Shares DL -,01	934623		STK	2.873			USD 48,730	128.110,11	0,06
Michael Kors Holdings Ltd Registered Shares o.N.	A1JQXP		STK	469			USD 40,220	17.261,01	0,01
Microchip Technology Inc. Registered Shares DL -,001	886105		STK	513			USD 47,740	22.410,48	0,01
Micron Technology Inc. Registered Shares DL -,10	869020		STK	2.685			USD 14,160	34.790,36	0,02
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	870747		STK	21.841			USD 56,310	1.125.406,48	0,54
Mohawk Industries Inc. Registered Shares DL -,01	885067		STK	160			USD 189,890	27.801,83	0,01
Molson Coors Brewing Co. Registered Shares B DL 0,01	A0DPTB		STK	410			USD 94,540	35.469,15	0,02
Mondelez International Inc. Registered Shares Class A o.N.	A1J4U0		STK	4.673			USD 45,510	194.604,99	0,09
Monsanto Co. Registered Shares DL -,01	578919		STK	1.408			USD 98,890	127.410,85	0,06
Monster Beverage Corp. (NEW) Registered Shares DL -,005	A14USZ		STK	378			USD 150,240	51.967,13	0,02
Moody's Corp. Registered Shares DL-,01	915246		STK	509			USD 101,110	47.093,75	0,02
Morgan Stanley Registered Shares DL -,01	885836		STK	3.607			USD 32,230	106.379,47	0,05
Mosaic Co. (New) Registered Shares DL -,01	A1JFWK		STK	727			USD 28,350	18.859,88	0,01
Motorola Solutions Inc. Registered Shares DL -,01	A0YHMA		STK	725			USD 69,300	45.975,09	0,02
Murphy Oil Corp. Registered Shares DL 1	856127		STK	476			USD 21,950	9.560,77	0,00
Mylan N.V. Aandelen aan toonder EO -,01	A14NYH		STK	1.039			USD 54,620	51.930,03	0,02
Nasdaq Inc. Registered Shares DL -,01	813516		STK	309			USD 59,020	16.688,18	0,01
National Oilwell Varco Inc. Registered Shares DL -,01	903541		STK	1.121			USD 33,740	34.610,04	0,02
Navient Corp. Registered Shares DL -,01	A11132		STK	1.191			USD 11,330	12.347,90	0,01
NetApp Inc. Registered Shares o. N.	A0NHKR		STK	947			USD 26,870	23.284,61	0,01
Netflix Inc. Registered Shares DL -,001	552484		STK	1.029	1.029	147	USD 116,710	109.894,21	0,05
Newell Rubbermaid Inc. Registered Shares DL 1	860036		STK	753			USD 43,750	30.145,63	0,01
Newfield Exploration Co. Registered Shares DL -,01	898661		STK	355			USD 31,850	10.346,40	0,00
Newmont Mining Corp. Registered Shares DL 1,60	853823		STK	1.305			USD 17,770	21.220,19	0,01

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
News Corp. NEW Registered Shares A DL -,01	A1W03Z		STK	1.313			USD 13,520	16.243,99	0,01
Nextera Energy Inc. Registered Shares DL -,01	A1CZ4H		STK	1.114			USD 104,910	106.943,27	0,05
Nielsen Holdings PLC Registered Shares EO-,07	A14ZR0		STK	550	550		USD 47,040	23.674,53	0,01
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	866993		STK	3.812	3.812	1.906	USD 63,250	220.630,11	0,10
NISOURCE Inc. Registered Shares o.N.	876731		STK	818			USD 19,820	14.835,71	0,01
Noble Energy Inc. Registered Shares DL 0,01	860720		STK	944			USD 32,220	27.832,29	0,01
Nordstrom Inc. Registered Shares o.N.	867804		STK	393			USD 50,310	18.092,49	0,01
Norfolk Southern Corp. Registered Shares DL 1	867028		STK	826			USD 84,860	64.140,81	0,03
Northern Trust Corp. Registered Shares DL 1,666	854009		STK	572			USD 72,830	38.120,42	0,02
Northrop Grumman Corp. Registered Shares DL 1	851915		STK	623			USD 190,080	108.361,71	0,05
NRG Energy Inc. Registered Shares DL -,01	A0BLR4		STK	849			USD 11,090	8.615,70	0,00
Nucor Corp. Registered Shares DL -,40	851918		STK	835			USD 40,340	30.822,92	0,01
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	918422		STK	1.519			USD 33,390	46.411,50	0,02
Occidental Petroleum Corp. Registered Shares DL -,20	851921		STK	2.117			USD 67,020	129.830,48	0,06
Omnicom Group Inc. Registered Shares DL -,15	871706		STK	687			USD 76,630	48.173,36	0,02
Oneok Inc. (New) Registered Shares DL-,01	911060		STK	538			USD 23,440	11.539,61	0,01
Oracle Corp. Registered Shares DL -,01	871460		STK	8.662			USD 36,920	292.638,35	0,14
Owens-Illinois Inc. Registered Shares DL -,01	883100		STK	431			USD 17,520	6.909,76	0,00
O'Reilly Automotive Inc.[New] Registered Shares DL -,01	A1H5JY		STK	292			USD 257,660	68.846,40	0,03
Paccar Inc. Registered Shares DL 1	861114		STK	929			USD 48,020	40.821,53	0,02
Parker-Hannifin Corp. Registered Shares DL-,50	855950		STK	392			USD 98,340	35.275,05	0,02
Patterson Companies Inc. Registered Shares DL -,01	A0B6VB		STK	220			USD 45,450	9.149,72	0,00
Paychex Inc. Registered Shares DL -,01	868284		STK	851			USD 53,780	41.879,52	0,02
PayPal Holdings Inc. Reg. Shares DL -,0001	A14R7U		STK	3.066	3.066		USD 36,480	102.347,76	0,05
Pentair PLC Registered Shares DL -,01	A115FG		STK	542			USD 50,000	24.798,23	0,01
People's United Financial Inc. Registered Shares DL -,01	A0MP68		STK	890			USD 16,350	13.315,55	0,01
Pepco Holdings Inc. Registered Shares DL -,01	723036		STK	652			USD 26,170	15.613,59	0,01
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	851995		STK	4.054			USD 101,150	375.232,98	0,18
PerkinElmer Inc. Registered Shares DL 1	850943		STK	299			USD 53,930	14.755,47	0,01
Perrigo Co. PLC Registered Shares EO -,001	A1XAEY		STK	377			USD 145,240	50.104,76	0,02
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	852009		STK	16.350			USD 32,750	489.982,34	0,23

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
PG & E Corp. Registered Shares o.N.	851962		STK	1.153			USD 53,920	56.889,30	0,03
Philip Morris Internat. Inc. Registered Shares o.N.	A0NDBJ		STK	4.330			USD 88,980	352.558,88	0,17
Phillips 66 Registered Shares DL -,01	A1JWQU		STK	1.285		348	USD 82,010	96.432,03	0,05
Pinnacle West Capital Corp. Registered Shares o.N.	853915		STK	288			USD 65,230	17.190,61	0,01
Pioneer Natural Resources Co. Registered Shares DL -,01	908678		STK	348			USD 124,470	39.636,50	0,02
Pitney-Bowes Inc. Registered Shares DL 1	852025		STK	529			USD 20,820	10.078,31	0,00
Plum Creek Timber Co. Inc. Registered Shares DL -,01	924269		STK	427			USD 48,230	18.845,02	0,01
PNC Financial Services Group Registered Shares DL 5	867679		STK	1.388			USD 96,100	122.057,43	0,06
PPG Industries Inc. Registered Shares DL 1,666	852026		STK	750			USD 99,770	68.471,93	0,03
PPL Corp. Registered Shares DL-,01	895250		STK	1.531			USD 34,340	48.109,06	0,02
Praxair Inc. Registered Shares DL -,01	884364		STK	778			USD 103,180	73.455,87	0,03
Precision Castparts Corp. Registered Shares o.N.	865685		STK	385			USD 231,960	81.719,40	0,04
Priceline Group Inc., The Registered Shares DL-,008	766054		STK	136			USD 1.289,160	160.434,25	0,08
Principal Financial Group Inc. Registered Shares DL -,01	694660		STK	725			USD 45,470	30.165,76	0,01
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	852062		STK	7.178			USD 80,070	525.926,01	0,25
Progressive Corp. Registered Shares DL 1	865496		STK	1.460			USD 32,320	43.179,30	0,02
ProLogis Inc. Registered Shares DL -,01	A1JBD1		STK	1.298			USD 43,240	51.358,43	0,02
Prudential Financial Inc. Registered Shares DL -,01	764959		STK	1.222			USD 82,170	91.883,15	0,04
Public Service Ent. Group Inc. Registered Shares o.N.	852070		STK	1.329			USD 38,990	47.416,51	0,02
Public Storage Registered Shares DL -,10	867609		STK	379			USD 250,460	86.861,83	0,04
Pulte Group Inc. Registered Shares DL -,01	854435		STK	894			USD 17,980	14.708,85	0,01
PVH Corp. Registered Shares DL 1	A1JHA5		STK	205			USD 73,150	13.722,07	0,01
Qorvo Inc. Registered Shares DL -,0001	A12CY9		STK	401	401		USD 51,660	18.956,15	0,01
QUALCOMM Inc. Registered Shares DL -,0001	883121		STK	4.515			USD 50,410	208.269,57	0,10
Quanta Services Inc. Registered Shares DL -,00001	912294		STK	560			USD 20,520	10.515,18	0,01
Quest Diagnostics Inc. Registered Shares DL -,01	904533		STK	416			USD 71,740	27.309,02	0,01
Ralph Lauren Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	A1JD3A		STK	160			USD 112,660	16.494,57	0,01
Range Resources Corp. Registered Shares DL -,01	867939		STK	428			USD 22,940	8.984,39	0,00
Raytheon Co. Registered Shares DL -,01	785159		STK	855			USD 125,740	98.376,40	0,05
Realty Income Corp. Registered Shares DL 1	899744		STK	603			USD 51,920	28.648,60	0,01
Red Hat Inc. Registered Shares DL -,0001	923989		STK	508			USD 83,650	38.884,90	0,02

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Regeneron Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,001	881535		STK	201			USD 548,190	100.827,39	0,05
Regions Financial Corp. (New) Registered Shares DL -,01	A0B6XA		STK	3.714			USD 9,650	32.795,98	0,02
Republic Services Inc. Registered Shares DL -,01	915201		STK	781			USD 44,540	31.831,17	0,02
Reynolds American Inc. Registered Shares o.N.	A0B7KR		STK	2.270	2.270	1.135	USD 46,670	96.942,68	0,05
Robert Half International Inc. Registered Shares DL -,001	856701		STK	367			USD 47,520	15.958,57	0,01
Rockwell Automation Inc. Registered Shares DL 1	903978		STK	367			USD 103,980	34.919,44	0,02
Rockwell Collins Inc. Registered Shares DL -,01	694062		STK	359			USD 93,270	30.639,93	0,01
Roper Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	883563		STK	260			USD 190,580	45.342,14	0,02
Ross Stores Inc. Registered Shares DL -,01	870053		STK	1.168			USD 54,550	58.302,74	0,03
Royal Caribbean Cruises Ltd. Registered Shares DL-,01	886286		STK	447			USD 102,730	42.020,01	0,02
Ryder System Inc. Registered Shares DL -,50	855369		STK	135			USD 56,560	6.987,06	0,00
salesforce.com Inc. Registered Shares DL -,001	A0B87V		STK	1.416			USD 79,140	102.544,10	0,05
SanDisk Corp. Registered Shares DL -,001	897826		STK	635			USD 76,070	44.201,65	0,02
SCANA Corp. Registered Shares o.N.	935232		STK	365			USD 61,300	20.474,09	0,01
Schlumberger N.V. (Ltd.) Reg. Shares DL -,01	853390		STK	3.490			USD 69,640	222.400,40	0,11
Schwab Corp., Charles Registered Shares DL -,01	874171		STK	2.888			USD 33,250	87.869,91	0,04
Scripps Networks Interact.Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	A0Q3YG		STK	226			USD 54,650	11.301,86	0,01
Seagate Technology PLC Registered Shares DL -,00001	A1C08F		STK	839			USD 37,180	28.544,52	0,01
Sealed Air Corp. Registered Shares DL -,10	913368		STK	511			USD 44,930	21.009,16	0,01
Sempra Energy Registered Shares o.N.	915266		STK	595			USD 94,850	51.642,31	0,02
Sherwin-Williams Co. Registered Shares DL 1	856050		STK	226			USD 262,450	54.275,82	0,03
Signet Jewelers Ltd. Registered Shares DL-,18	A0Q9SE		STK	215	215		USD 121,770	23.956,87	0,01
Simon Property Group Inc. Reg. Paired Shares DL-,0001	916647		STK	824			USD 195,160	147.153,09	0,07
Skyworks Solutions Inc. Registered Shares DL -,25	857760		STK	509			USD 79,190	36.884,13	0,02
SL Green Realty Corp. Registered Shares DL -,01	908769		STK	263			USD 114,030	27.442,66	0,01
Snap-on Inc. Registered Shares DL 1	853887		STK	153			USD 172,420	24.139,62	0,01
Southern Co., The Registered Shares DL 5	852523		STK	2.283			USD 47,270	98.751,31	0,05
Southwest Airlines Co. Registered Shares DL 1	862837		STK	1.913			USD 43,350	75.884,91	0,04
Southwestern Energy Co. Registered Shares DL -,01	887333		STK	922			USD 6,300	5.315,24	0,00
Spectra Energy Corp. Registered Shares DL -,001	A0LHDG		STK	1.756			USD 23,730	38.130,60	0,02

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
St. Jude Medical Inc. Registered Shares DL -,10	864096		STK	743			USD 62,220	42.302,90	0,02
Stanley Black & Decker Inc. Registered Shares DL 2,50	A1CTQA		STK	421			USD 107,230	41.309,48	0,02
Staples Inc. Registered Shares DL-,0006	876951		STK	1.771			USD 9,530	15.444,11	0,01
Starbucks Corp. Reg. Shares DL -,001	884437		STK	3.938			USD 60,820	219.166,16	0,10
Starwood Hotels&Res.Worldw.Inc Registered Shares DL -,01	A0JKQB		STK	509			USD 70,120	32.659,61	0,02
State Street Corp. Registered Shares DL 1	864777		STK	1.200			USD 66,570	73.098,95	0,03
Stericycle Inc. Registered Shares DL -,01	902518		STK	226			USD 121,780	25.184,64	0,01
Stryker Corp. Registered Shares DL -,10	864952		STK	760			USD 94,250	65.546,02	0,03
SunTrust Banks Inc. Registered Shares DL 1	871788		STK	1.416			USD 43,310	56.118,08	0,03
Symantec Corp. Registered Shares DL -,01	879358		STK	1.811			USD 21,290	35.281,37	0,02
Synchrony Financial Registered Shares DL -,001	A117UJ		STK	2.244	2.244		USD 30,430	62.485,06	0,03
Sysco Corp. Registered Shares DL 1	859121		STK	1.540			USD 41,460	58.425,36	0,03
T. Rowe Price Group Inc. Registered Shares DL -,20	870967		STK	681			USD 72,090	44.923,49	0,02
Target Corp. Registered Shares DL -,0833	856243		STK	1.710			USD 73,620	115.197,56	0,05
TE Connectivity Ltd. Nam.-Aktien SF 0,57	A0RP04		STK	1.104			USD 65,490	66.159,99	0,03
Teco Energy Inc. Registered Shares DL 1	857240		STK	537			USD 26,820	13.179,06	0,01
TEGNA Inc. Registered Shares DL 1	A14VMF		STK	604	604		USD 25,700	14.204,35	0,01
Tenet Healthcare Corp. Registered Shares DL -,05	A1J5US		STK	274			USD 30,280	7.592,03	0,00
Teradata Corp. (Del.) Registered Shares DL -,01	A0M0ZR		STK	436			USD 26,820	10.700,32	0,01
Tesoro Corp. Registered Shares DL -,1666	859620		STK	361			USD 104,280	34.447,65	0,02
Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1	852654		STK	2.903			USD 56,160	149.185,12	0,07
Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1	857209		STK	940			USD 142,860	122.882,45	0,06
Tiffany & Co. Registered Shares DL -,01	872811		STK	313			USD 77,050	22.068,27	0,01
Time Warner Cable Inc. Registered Shares DL -,01	A0RGZ		STK	776			USD 185,770	131.913,33	0,06
Time Warner Inc. Registered Shares New DL -,01	A0RGAY		STK	2.456			USD 64,440	144.822,24	0,07
TJX Companies Inc. Registered Shares DL 1	854854		STK	1.916			USD 71,360	125.112,79	0,06
Torchmark Corp. Registered Shares DL 1	866408		STK	369			USD 57,590	19.445,76	0,01
Total System Services Inc. Registered Shares DL -,10	905328		STK	422			USD 50,150	19.365,77	0,01
Tractor Supply Co. Registered Shares DL -,008	889826		STK	368			USD 86,290	29.057,59	0,01
Transocean Ltd. Nam.-Aktien SF 15	A0REAY		STK	891			USD 12,270	10.004,00	0,00
Travelers Companies Inc.,The Registered Shares o.N.	A0MLX4		STK	993			USD 114,290	103.850,56	0,05

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Tripadvisor Inc. Registered Shares DL -,001	A1JRLK		STK	289			USD 86,150	22.782,66	0,01
TYCO International PLC Registered Shares DL -,01	A12FBS		STK	1.219			USD 32,200	35.917,90	0,02
Tyson Foods Inc. Reg. Shares Cl.A DL -,10	870625		STK	745			USD 53,780	36.663,04	0,02
U.S. Bancorp Registered Shares DL -,01	917523		STK	4.896			USD 43,010	192.691,35	0,09
Under Armour Inc. Registered Shs A DL -,000333	A0HL4V		STK	425			USD 80,960	31.485,51	0,01
Union Pacific Corp. Registered Shares DL 2,50	858144		STK	2.466			USD 78,510	177.161,53	0,08
United Continental Holdg. Inc. Registered Shares DL-,01	A1C6TV		STK	1.013	1.013		USD 57,510	53.309,45	0,03
United Parcel Service Inc. Reg. Shares Class B DL -,01	929198		STK	1.879			USD 97,090	166.937,02	0,08
United Rentals Inc. Registered Shares DL -,01	911443		STK	254			USD 72,680	16.892,74	0,01
United Technologies Corp. Registered Shares DL 1	852759		STK	2.216			USD 96,900	196.492,01	0,09
UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01	869561		STK	2.693			USD 118,920	293.050,60	0,14
Universal Health Services Inc. Reg. Shares Class B DL -,01	866462		STK	242			USD 120,020	26.577,88	0,01
Unum Group Registered Shares DL -,10	872055		STK	709			USD 33,520	21.747,11	0,01
Urban Outfitters Inc. Registered Shares DL -,0001	888903		STK	288			USD 23,090	6.085,10	0,00
V.F. Corp. Registered Shares o.N.	857621		STK	928			USD 62,660	53.209,57	0,03
Valero Energy Corp. Registered Shares DL -,01	908683		STK	1.453			USD 71,580	95.171,89	0,05
Varian Medical Systems Inc. Registered Shares DL 1	852812		STK	287			USD 81,350	21.364,41	0,01
Ventas Inc. Registered Shares DL -,25	878380		STK	767			USD 56,630	39.745,99	0,02
Verisign Inc. Registered Shares DL -,001	911090		STK	401			USD 88,140	32.342,14	0,02
Verisk Analytics Inc. Registered Shs DL -,001	A0YA2M		STK	416	416		USD 77,510	29.505,46	0,01
Verizon Communications Inc. Registered Shares DL -,10	868402		STK	10.868			USD 46,770	465.123,59	0,22
Vertex Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,01	882807		STK	611			USD 126,400	70.670,74	0,03
Viacom Inc. Reg. Shares Class B DL -,001	A0HM1Q		STK	1.197			USD 40,860	44.755,24	0,02
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	A0NC7B		STK	5.420			USD 78,350	388.588,24	0,18
Vornado Realty Trust Reg.Shs of Benef. Int. DL-,04	893899		STK	445			USD 101,160	41.192,69	0,02
Vulcan Materials Co. Registered Shares DL 1	855854		STK	341			USD 95,590	29.827,59	0,01
Wal-Mart Stores Inc. Registered Shares DL -,10	860853		STK	4.395			USD 61,680	248.058,78	0,12
Walgreens Boots Alliance Inc. Reg. Shares DL -,01	A12HJF		STK	2.260			USD 86,390	178.658,33	0,08
Waste Management Inc. (Del.) Registered Shares DL -,01	893579		STK	1.149			USD 53,980	56.755,02	0,03
Waters Corp. Registered Shares DL -,01	898123		STK	226			USD 135,640	28.050,95	0,01
WEC Energy Group Inc. Registered Shares DL 10	A14V4V		STK	834	834		USD 52,230	39.860,01	0,02

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Wells Fargo & Co. Registered Shares DL 1,666	857949		STK	12.880			USD 54,890	646.934,72	0,31
Welltower Inc. Registered Shares DL 1	A1409D		STK	738	738		USD 68,320	46.137,66	0,02
Western Digital Corp. Registered Shares DL -,01	863060		STK	569			USD 61,090	31.807,81	0,02
Western Union Co. Registered Shares DL -,01	A0LA17		STK	1.494			USD 18,240	24.936,00	0,01
WestRock Co. Registered Shares DL -,01	A14V41		STK	360	360		USD 45,760	15.074,39	0,01
Weyerhaeuser Co. Registered Shares DL 1,25	854357		STK	1.433			USD 30,340	39.784,43	0,02
Whirlpool Corp. Registered Shares DL 1	856331		STK	206			USD 148,570	28.005,91	0,01
Whole Foods Market Inc. Registered Shares o.N.	886391		STK	1.176			USD 33,780	36.351,16	0,02
Williams Cos.Inc., The Registered Shares DL 1	855451		STK	1.791			USD 24,410	40.005,04	0,02
Wyndham Worldwide Corp. Registered Shares DL -,01	A0J37Z		STK	359			USD 72,880	23.941,66	0,01
Wynn Resorts Ltd. Registered Shares DL -,01	663244		STK	210			USD 68,640	13.190,10	0,01
Xcel Energy Inc. Registered Shares DL 2,50	855009		STK	1.283			USD 36,400	42.734,58	0,02
Xerox Corp. Registered Shares DL 1	853906		STK	3.216			USD 10,720	31.547,30	0,02
Xilinx Inc. Registered Shares DL -,01	880135		STK	687			USD 47,840	30.074,56	0,01
XL Group PLC Registered Shares DL -,01	A1C06F		STK	775			USD 39,820	28.239,33	0,01
Xylem Inc. Registered Shares DL -,01	A1JMBU		STK	489			USD 36,870	16.498,08	0,01
Yahoo! Inc. Registered Shares DL-,001	900103		STK	2.546			USD 33,370	77.743,84	0,04
Yum! Brands, Inc. Registered Shares o.N.	909190		STK	1.184			USD 73,810	79.968,38	0,04
Zimmer Biomet Holdings Inc. Registered Shares DL -,01	753718		STK	445			USD 102,470	41.726,13	0,02
Zions Bancorporation Registered Shares o.N.	856942		STK	484			USD 27,470	12.166,21	0,01
Zoetis Inc. Registered Shares Cl.A DL -,01	A1KBYX		STK	1.307			USD 48,260	57.718,40	0,03
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	0,00	0,00
Andere Wertpapiere									
Safeway Inc. Reg. Cont. Value Rights (PDC)	A14NAV		STK	630			USD 0,000	0,00	0,00
Safeway Inc. Reg.Cont.Val.Rights (Casa Ley)	A14NEJ		STK	630			USD 0,000	0,00	0,00
Investmentanteile							EUR	18.272.607,88	8,69
Gruppenfremde Investmentanteile									
iShares Core DAX UCITS ETF DE Inhaber-Anteile	593393		ANT	192.404	192.404		EUR 94,970	18.272.607,88	8,69
Summe Wertpapiervermögen							EUR	157.684.989,54	75,02

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	1.068.298,10	0,51
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-338.484,24	-0,16
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
DAX Index Future 18.03.16		185	EUR	Anzahl 81				69.175,00	0,03
Euro STOXX 50 Future 18.03.16		185	EUR	Anzahl 193				-210.740,00	-0,10
S&P 500 E-Mini Index Future 18.03.16		359	USD	Anzahl 226				-196.981,20	-0,09
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
Call DAX 12387,36 04.01.16		OTC		Anzahl -3.725		EUR	0,000	-0,02	0,00
Call Euro Stoxx 3792,81 04.01.16		OTC		Anzahl -30.719		EUR	0,000	-0,03	0,00
Put DAX 9121,6 04.01.16		OTC		Anzahl 3.725		EUR	0,004	15,08	0,00
Put Euro Stoxx 2818,51 04.01.16		OTC		Anzahl 30.719		EUR	0,001	44,94	0,00
Put S&P 1703,1303 04.01.16		OTC		Anzahl 35.022		USD	0,000	1,99	0,00
Devisen-Derivate							EUR	1.406.782,34	0,67
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR 53,8 Mio.		OTC						1.406.782,34	0,67
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	51.566.360,36	24,53
Bankguthaben							EUR	51.566.360,36	24,53
EUR-Guthaben bei:									
State Street Bank GmbH (München)			EUR	11.931.463,38		% 100,000		11.931.463,38	5,68
Wüstenrot Bank AG Pfandbriefbank (Ludwigsburg)			EUR	35.500.000,00		% 100,000		35.500.000,00	16,89
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			USD	4.518.698,12		% 100,000		4.134.896,98	1,97
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	121.855,82	0,06
Zinsansprüche			EUR	618,41				618,41	0,00
Dividendenansprüche			EUR	121.237,41				121.237,41	0,06
Sonstige Verbindlichkeiten *)			EUR	-237.665,77				-237.665,77	-0,11
Fondsvermögen							EUR	210.203.838,05	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	82,17	
Umlaufende Anteile							STK	2.558.061	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten, Zinsverbindlichkeiten

Fußnoten:

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

US-Dollar	(USD)	per 30.12.2015 1,0928200	=	1 Euro (EUR)
-----------	-------	-----------------------------	---	--------------

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Frankfurt/Zürich - Eurex
359	Chicago Merc. Ex.

c) 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):

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	-----	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Allegheny Technologies Inc. Registered Shares DL-,01	931083	STK		282	
Altera Corp. Registered Shares o.N.	875650	STK		840	
Avon Products Inc. Registered Shares DL -,25	853836	STK		1.136	
Chemours Co., The Registered Shares DL -,01	A14RPH	STK	491	491	
Comcast Corp. Reg. Shs Cl. A (Spec.) DL-,01	157485	STK	988	988	
Communications Sal.& Leas.Inc. Registered Shares DL -,0001	A14RMO	STK		310	
Denbury Resources Inc. Registered Shares DL-,001	903307	STK		981	
Gannett Co. Inc. Registered Shares DL -,01	A14TU5	STK		302	
Gannett Co. Inc. Registered Shares DL 1	854136	STK		604	
Google Inc. Reg. Shares Class A DL -,001	A0B7FY	STK	43	777	
Google Inc. Registered Shares C DL -,001	A110NH	STK	57	793	
Health Care REIT Inc. Registered Shares DL 1	874732	STK		738	
Hewlett-Packard Co. Registered Shares DL -,01	851301	STK		5.131	
Hospira Inc. Registered Shares DL -,01	A0CAGX	STK		435	
Meadwestvaco Corp. Registered Shares DL -,01	540952	STK		462	
Nabors Industries Ltd. Registered Shares DL -,001	662778	STK		765	
Noble Corp. PLC Registered Shares DL -,01	A1W86Q	STK		664	
Pall Corp. Registered Shares DL -,10	859043	STK		292	
QEP Resources Inc. Registered Shares DL -,01	A1CYV1	STK		469	
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	876845	STK		47.329	
RWE AG Inhaber-Stammaktien o.N.	703712	STK		22.647	
Talen Energy Corp. Registered Shares DL-,001	A14STA	STK		191	
TopBuild Corp. Registered Shares DL -,01	A14UY4	STK	104	104	
Windstream Holdings Inc. Registered Shares DL-,0001	A14R1W	STK		258	
Wisconsin Energy Corp. Registered Shares DL 10	873322	STK		834	

Andere Wertpapiere

Banco Bilbao Vizcaya Argent. Anrechte	A1410P	STK	279.308	279.308	
Banco Santander S.A. Anrechte (Gratis)	A142K0	STK	634.196	634.196	
Iberdrola S.A. Anrechte	A14VML	STK	271.167	271.167	
Telefónica S.A. Anrechte	A1432X	STK	193.604	193.604	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Aktien

DirectTV Registered Shares DL -,01	A1J1EZ	STK		1.240	
Family Dollar Stores Inc. Registered Shares DL -,10	859612	STK		253	
Hudson City Bancorp Inc. Registered Shares DL -,01	924928	STK		1.249	
Kraft Foods Group Inc. Registered Shares o.N.	A1J20U	STK		1.557	
Nielsen N.V. Aandelen an toonder EO -,07	A1H62H	STK		550	
Sigma-Aldrich Corp. Registered Shares DL 1	863120	STK		316	

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

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:			
(Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, S+P 500)	EUR		84.895,75

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
USD/EUR			EUR		264,921
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices					
Gekaufte Verkaufsoptionen:					
(Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, S+P 500)			EUR		1.465,19
Verkaufte Kaufoptionen:					
(Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, S+P 500)			EUR		1.690,16

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	82,17
Umlaufende Anteile	STK	2.558.061

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Verantwortung für die Anteilwertermittlung obliegt der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH (im Folgenden: Gesellschaft) unter Kontrolle der Verwahrstelle auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung.

Die Kurse der Vermögensgegenstände im Zusammenhang mit der Anteilwertermittlung werden von einem externen Bewerter geliefert. Unter Vermögensgegenständen versteht die Gesellschaft im Folgenden Wertpapiere, Optionen, Finanzterminkontrakte, Devisentermingeschäfte und Swaps.

Die Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, erfolgt grundsätzlich zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Vermögensgegenstände, für welche die Kursstellung auf der Grundlage von Geld- und Briefkursen erfolgt, werden grundsätzlich zum Geldkurs („Bid“) bewertet.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt. Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte. Die Gesellschaft nutzt zur Ermittlung der Verkehrswerte grundsätzlich externe Bewertungsmodelle. Die Verkehrswerte können auch von einem Emittenten, Kontrahenten oder sonstigen Dritten ermittelt und mitgeteilt werden.

Die Gesellschaft bewertet Investmentanteile mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis oder mit einem aktuellen Kurs. Die Bankguthaben und übrigen Forderungen werden mit ihrem Nominalbetrag, die Verbindlichkeiten mit dem Rückzahlungsbetrag angesetzt. Vermögensgegenstände in ausländischer Währung werden zu den von Reuters bereitgestellten Devisenkursen des Tages der Preisberechnung in Euro umgerechnet.

Zusätzliche steuerliche Informationen

Der Aktiengewinn kann bei der Gesellschaft erfragt werden.

Die von der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH für den Zeitraum 01.03.2013 bis 30.06.2013 ermittelten Aktiengewinne der Publikumsfonds für in Deutschland körperschaftsteuerpflichtige Anleger können auf der Homepage des elektronischen Bundesanzeigers unter der Adresse <https://www.bundesanzeiger.de> und auf der Homepage der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH unter der Adresse <https://www.LBBW-AM.de> abgerufen werden.

Stuttgart, den 4. Januar 2016

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

