

Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2019.
Sigma Plus Balanced

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



.Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

30. Juni 2019

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Fonds Sigma Plus Balanced für den Zeitraum vom 1. Januar 2019 bis zum 30. Juni 2019.

Das abgelaufene Berichtshalbjahr war geprägt von einer starken Aufwärtsbewegung an den internationalen Aktienmärkten, an der auch die europäischen Börsen partizipierten. Wenig beeindruckt von den global schwelenden Handelskonflikten verlieh die Aussicht auf weitere geldpolitische Lockerungen durch die EZB und US-Notenbank den Kapitalmärkten neue Impulse. Auf nationaler Ebene wurde die Entwicklung auch nicht durch die Abkühlung des ifo Geschäftsklimas beeinträchtigt.

Aus der Erwartung sinkender Zinsen resultierten eine erfreuliche Entwicklung am Rentenmarkt und deutlich nachgebende Renditen. US-Treasuries mit 10-jähriger Laufzeit rentierten zum Ende des Berichtszeitraums mit nur noch 2,0 Prozent. Die Rendite laufzeitgleicher Bundesanleihen bewegte sich seit Anfang Mai durchgehend im negativen Bereich und sank zuletzt auf minus 0,3 Prozent.

Politische Unsicherheiten beeindruckten die Aktienmärkte auf Halbjahressicht nur kurzfristig. An der Wall Street erreichte der marktbreite S&P 500 im Juni ein neues Rekordhoch. Auch die Märkte in Europa verzeichneten kontinuierliche Kurssteigerungen. Der Nikkei 225 in Japan folgte in geringerer Ausprägung dem positiven Gesamttrend.

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Abschnitt Anlagepolitik. Gerne nehmen wir die Gelegenheit zum Anlass, um Ihnen für das uns entgegengebrachte Vertrauen zu danken.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilhaber im Internet unter www.deka.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Dr. Ulrich Neugebauer
(stv. Vorsitzender)



Jörg Boysen



Thomas Ketter



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2019	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2019	7
Anhang	16
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	18

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

Sigma Plus Balanced Anlagepolitik.

Das Anlageziel des Sigma Plus Balanced ist mittel- bis langfristiger Kapitalzuwachs insbesondere durch die Erwirtschaftung laufender Erträge und durch eine positive Entwicklung der Kurse der im Sondervermögen enthaltenen Vermögenswerte. Das Fondsmanagement verfolgt die Strategie, je nach Marktlage weltweit in verzinsliche Wertpapiere (in der Regel Staatsanleihen der USA, Eurozone, Großbritannien) sowie bis zu 50 Prozent in Aktien zu investieren. Die Auswahl der Vermögenswerte trifft das Fondsmanagement nach einem mathematischen Verfahren, durch welches die Entwicklungen je zulässiger Anlageklasse flexibel genutzt werden. Zur Begrenzung der Anlagerisiken dieses Fonds mit ausgewogenem Verlustprofil erfolgt eine laufende Anpassung der Gewichtung der Anlageklassen. Von ihrem Basiswert abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) können dabei sowohl zu Investitions- als auch zu Absicherungszwecken eingesetzt und auch Währungsrisiken weitgehend reduziert werden. Sollte zu einem Zeitpunkt keine der Investitionsmöglichkeiten den Erwartungen des Fondsmanagements entsprechen, kann zum beträchtlichen Teil in kurzfristige liquide Geldanlagen angelegt werden. Dieser Investmentfonds darf mehr als 35 Prozent des Sondervermögens in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Bundesrepublik Deutschland und der Vereinigten Staaten von Amerika investieren.

Der Rentenanteil des Fonds wurde im stichtagsvergleich etwas zurückgenommen und betrug zum Stichtag 46,2 Prozent (inklusive Rentenfonds), wobei die Investitionen überwiegend in Euroland und den USA erfolgten. Die größten Positionen auf der Rentenseite bildeten weiterhin Unternehmensanleihen, gefolgt von Anleihen halbstaatlicher Emittenten (z.B. Länderschatzanweisungen) und einem kleinen Anteil an Rentenfonds. Ein Teil der Unternehmensanleihen war mit besonderen Merkmalen ausgestattet (z.B. Bonitätsanleihen). Zur Steuerung des Rentenportfolios wurden zudem Zinsterminkontrakte eingesetzt.

Der Aktienanteil in Wertpapieren wurde ausschließlich durch Einzelwerte abgebildet und per saldo merklich aufgestockt. Der Bestand lag zuletzt bei 47,8 Prozent des Fondsvolumens. Im Fokus standen unter regionalen Aspekten die USA und Europa. Aufstockungen erfolgten u.a. in den USA, Japan, Kanada und Frankreich. Die Branchengewichtungen ergaben sich implizit aus der Länderallokation und Einzelaktienauswahl. Durch Aktienindexfutures und -optionen wurde der Investitionsgrad in Aktien um 10,9 Prozentpunkte verringert.

Ein gemischter Fonds ergänzte zudem das Portfolio. Die Wertpapierpositionen in Fremdwährung waren zum Stichtag überwiegend durch Devisentermingeschäfte währungskursgesichert.

Der Fonds Sigma Plus Balanced verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 5,8 Prozent, das Fondsvolumen lag zum Stichtag bei 43,6 Mio. Euro.

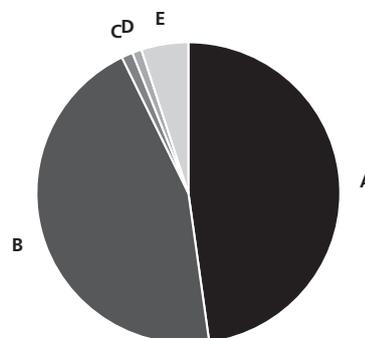
Wichtige Kennzahlen Sigma Plus Balanced

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre p.a.
Performance *	5,8%	1,1%	1,3%

ISIN DE0007019333

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

Fondsstruktur Sigma Plus Balanced



A	Aktien	47,8%
B	Renten	45,0%
C	Rentenfonds	1,2%
D	Gemischte Fonds	1,0%
E	Barreserve, Sonstiges	5,0%

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

Sigma Plus Balanced

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2019.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	20.565.469,93	47,21
Australien	528.732,84	1,22
Dänemark	423.254,31	0,97
Deutschland	544.565,44	1,24
Finnland	88.831,98	0,20
Frankreich	926.230,79	2,11
Großbritannien	1.221.235,32	2,80
Irland	275.335,03	0,63
Italien	257.039,63	0,59
Japan	1.878.838,67	4,32
Kanada	1.137.613,75	2,62
Niederlande	414.331,12	0,95
Schweden	238.261,40	0,55
Schweiz	416.421,84	0,96
Spanien	420.684,01	0,97
USA	11.794.093,80	27,08
2. Anleihen	19.359.677,67	44,40
Australien	1.185.900,70	2,72
Deutschland	3.327.054,50	7,62
Frankreich	1.933.720,26	4,44
Großbritannien	631.873,50	1,45
Irland	614.890,50	1,41
Kaiman-Inseln	268.068,85	0,62
Luxemburg	565.295,00	1,30
Mexiko	318.772,50	0,73
Neuseeland	263.509,70	0,60
Niederlande	685.836,85	1,57
Österreich	632.100,00	1,45
Panama	308.169,00	0,71
Schweden	1.328.061,00	3,04
Spanien	1.448.542,84	3,32
USA	5.847.882,47	13,42
3. Investmentanteile	953.078,74	2,19
Deutschland	423.039,00	0,97
Luxemburg	530.039,74	1,22
4. Sonstige Wertpapiere	211.738,76	0,49
Schweiz	208.189,57	0,48
Spanien	3.549,19	0,01
5. Derivate	259.330,33	0,58
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	1.953.062,85	4,47
7. Sonstige Vermögensgegenstände	315.404,96	0,73
II. Verbindlichkeiten	-33.314,19	-0,07
III. Fondsvermögen	43.584.449,05	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	20.565.469,93	47,21
AUD	528.732,84	1,22
CAD	1.082.366,04	2,49
CHF	416.421,84	0,96
DKK	423.254,31	0,97
EUR	2.454.521,45	5,61
GBP	1.304.266,69	2,99
JPY	1.878.838,67	4,32
SEK	238.261,40	0,55
USD	12.238.806,69	28,10
2. Anleihen	19.359.677,67	44,40
EUR	11.732.063,50	26,89
USD	7.627.614,17	17,51
3. Investmentanteile	953.078,74	2,19
EUR	953.078,74	2,19
4. Sonstige Wertpapiere	211.738,76	0,49
CHF	208.189,57	0,48
EUR	3.549,19	0,01
5. Derivate	259.330,33	0,58
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	1.953.062,85	4,47
7. Sonstige Vermögensgegenstände	315.404,96	0,73
II. Verbindlichkeiten	-33.314,19	-0,07
III. Fondsvermögen	43.584.449,05	100,00

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

Sigma Plus Balanced

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2019.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteil bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								35.810.535,58	82,17
Aktien								20.565.469,93	47,21
EUR								2.454.521,45	5,61
DE000A1EWWW0	adidas AG Namens-Aktien	STK		351	351	0	EUR 271,700	95.366,70	0,22
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aand. aan toonder	STK		4.482	0	0	EUR 19,796	88.725,67	0,20
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		540	806	266	EUR 210,250	113.535,00	0,26
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		5.431	0	0	EUR 22,860	124.152,66	0,28
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien	STK		1.704	0	0	EUR 44,130	75.197,52	0,17
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien	STK		6.650	0	2.066	EUR 15,144	100.707,60	0,23
FR0010908533	Edenred S.A. Actions Port.	STK		2.304	2.304	0	EUR 44,650	102.873,60	0,24
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK		924	0	421	EUR 86,560	79.981,44	0,18
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK		25.030	25.030	0	EUR 6,149	153.909,47	0,35
IT0003132476	ENI S.p.A. Azioni nom.	STK		7.140	0	0	EUR 14,444	103.130,16	0,24
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.	STK		17.343	17.343	0	EUR 8,736	151.508,45	0,35
FR0000121485	Kering S.A. Actions Port.	STK		250	250	0	EUR 518,400	129.600,00	0,30
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.	STK		532	532	0	EUR 248,000	131.936,00	0,30
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Action Port.(C.R.)	STK		451	512	61	EUR 371,750	167.659,25	0,38
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien	STK		771	771	0	EUR 92,300	71.163,30	0,16
FI0009013296	Neste Oyj Reg.Shs	STK		2.967	1.978	672	EUR 29,940	88.831,98	0,20
FR0000121501	Peugeot S.A. Actions Port.(C.R.)	STK		5.196	5.196	0	EUR 21,340	110.882,64	0,25
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port.	STK		4.711	0	1.852	EUR 18,450	86.917,95	0,20
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK		7.264	202	1	EUR 13,660	99.226,24	0,23
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien	STK		743	743	0	EUR 119,240	88.595,32	0,20
FR0000051807	Téléperformance SE Actions Port.	STK		452	0	273	EUR 175,100	79.145,20	0,18
NL0000009355	Unilever N.V. Cert.v.Aand.	STK		3.014	3.014	0	EUR 53,230	160.435,22	0,37
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam	STK		798	798	0	EUR 63,960	51.040,08	0,12
AUD								528.732,84	1,22
AU000000AGL7	AGL Energy Ltd. Reg.Shares	STK		3.722	3.722	0	AUD 20,010	45.885,22	0,11
AU000000ANZ3	Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Reg.Shares	STK		5.529	5.529	0	AUD 28,210	96.094,61	0,22
AU000000BHP4	BHP Group Ltd. Reg.Shares	STK		5.616	0	2.583	AUD 41,160	142.413,72	0,33
AU00000030678	Coles Group Ltd. Reg.Shares	STK		4.461	0	0	AUD 13,350	36.691,28	0,08
AU000000WES1	Wesfarmers Ltd. Reg.Shares	STK		4.461	0	0	AUD 36,160	99.382,52	0,23
AU000000WPL2	Woodside Petroleum Ltd. Reg.Shares	STK		4.833	4.833	0	AUD 36,360	108.265,49	0,25
CAD								1.082.366,04	2,49
CA01626P4033	Alimentation Couche-Tard Inc.Reg.Sh.Cl.B (Sub.Vtg)	STK		1.600	1.600	0	CAD 83,260	89.356,04	0,21
CA0636711016	Bank of Montreal Reg.Shares	STK		1.400	1.400	1.000	CAD 98,430	92.432,14	0,21
CA1360691010	Canadian Imperial Bk of Comm. Reg.Shares	STK		1.800	1.800	0	CAD 102,020	123.175,78	0,28
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK		100	0	100	CAD 1.220,250	81.849,56	0,19
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares	STK		7.600	7.600	0	CAD 23,780	121.225,21	0,28
CA7751092007	Rogers Communications Inc. Reg.Shares Cl.B	STK		2.700	2.700	0	CAD 69,490	125.850,11	0,29
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares	STK		1.900	0	500	CAD 103,460	131.854,08	0,30
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK		2.900	2.900	0	CAD 54,000	105.041,10	0,24
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK		2.900	0	0	CAD 76,120	148.069,05	0,34
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK		1.600	0	0	CAD 59,180	63.512,97	0,15
CHF								416.421,84	0,96
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK		1.278	0	212	CHF 100,480	115.681,01	0,27
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		2.647	3.518	2.906	CHF 89,110	212.486,81	0,49
CH0126881561	Swiss Re AG Namens-Aktien	STK		995	995	0	CHF 98,460	88.254,02	0,20
DKK								423.254,31	0,97
DK0010181759	Carlsberg AS Navne-Aktier B	STK		794	794	0	DKK 870,000	92.548,85	0,21
DK0060079531	DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier	STK		641	1.357	716	DKK 638,200	54.808,27	0,13
DK0010287234	H. Lundbeck A/S Navne-Aktier	STK		1.997	1.997	0	DKK 259,900	69.536,95	0,16
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		4.593	7.473	2.880	DKK 335,350	206.360,24	0,47
GBP								1.304.266,69	2,99
GB0000811801	Barratt Developments PLC Reg.Shares	STK		13.248	0	5.122	GBP 5,738	84.612,37	0,19
GB00BHOP3Z91	BHP Group PLC Reg.Shares	STK		5.416	0	867	GBP 20,070	120.989,88	0,28
GB0002875804	British American Tobacco PLC Reg.Shares	STK		2.669	2.669	0	GBP 27,680	82.231,40	0,19
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC Reg.Shares	STK		9.008	3.183	1.123	GBP 15,796	158.379,33	0,36
GB0004544929	Imperial Brands PLC Reg.Shares	STK		4.201	0	768	GBP 18,858	88.180,25	0,20
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom.	STK		15.875	0	0	GBP 4,699	83.031,37	0,19
GB0032089863	NEXT PLC Reg.Shares	STK		1.955	0	0	GBP 56,320	122.555,39	0,28
GB0006825383	Persimmon PLC Reg.Shares	STK		3.210	0	1.272	GBP 19,865	70.976,83	0,16
GB00B2B0DG97	Relx PLC Reg.Shares	STK		6.911	6.911	0	GBP 19,190	147.617,85	0,34
GB0007188757	Rio Tinto PLC Reg.Shares	STK		2.646	0	379	GBP 48,510	142.871,01	0,33
GB00B03MM408	Royal Dutch Shell Reg.Shares Cl.B	STK		5.401	0	652	GBP 25,845	155.372,35	0,36
GB00B10RZP78	Unilever PLC Reg.Shares	STK		873	2.415	1.542	GBP 48,830	47.448,66	0,11
JPY								1.878.838,67	4,32
JP3122400009	Advantest Corp. Reg.Shares ¹⁾	STK		4.300	4.300	0	JPY 2.965,000	104.013,87	0,24
JP3526600006	Chubu Electric Power Co. Inc. Reg.Shares	STK		6.300	6.300	0	JPY 1.511,500	77.686,72	0,18
JP3486800000	Daito Trust Constr. Co. Ltd. Reg.Shares	STK		500	500	0	JPY 13.735,000	56.026,92	0,13
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd. Reg.Shares	STK		4.500	4.500	0	JPY 3.141,000	115.313,07	0,26
JP3768600003	Haseko Corp. Reg.Shares	STK		6.800	0	1.600	JPY 1.090,000	60.469,10	0,14

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
JP3143600009	ITOCHU Corp. Reg.Shares		STK	5.700	5.700	0	JPY 2.060,500	95.817,66	0,22
JP3210200006	Kajima Corp. Reg.Shares		STK	5.100	0	5.400	JPY 1.478,000	61.495,41	0,14
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares		STK	6.000	0	0	JPY 2.743,500	134.293,29	0,31
JP3898400001	Mitsubishi Corp. Reg.Shares		STK	5.200	0	0	JPY 2.840,000	120.481,34	0,28
JP3902900004	Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Reg.Shares		STK	20.200	32.100	11.900	JPY 512,000	84.376,10	0,19
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares		STK	2.900	0	0	JPY 5.017,000	118.697,12	0,27
JP3165650007	NTT Docomo Inc. Reg.Shares		STK	4.900	0	0	JPY 2.512,500	100.438,51	0,23
JP3190000004	Obayashi Corp. Reg.Shares ¹⁾		STK	10.700	0	0	JPY 1.061,000	92.618,40	0,21
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares		STK	8.600	8.600	0	JPY 1.608,000	112.819,09	0,26
JP3347200002	Shionogi & Co. Ltd. Reg.Shares		STK	1.800	0	600	JPY 6.209,000	91.178,46	0,21
JP3368000000	Showa Denko K.K. Reg.Shares		STK	3.300	3.300	0	JPY 3.170,000	85.343,67	0,20
JP3435000009	SONY Corp. Reg.Shares		STK	700	0	2.500	JPY 5.648,000	32.254,54	0,07
JP3322930003	Sumco Corp. Reg.Shares		STK	7.800	7.800	0	JPY 1.282,000	81.579,44	0,19
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group Reg.Shares		STK	3.200	0	0	JPY 3.806,000	99.361,21	0,23
JP3560800009	Tokai Carbon Co. Ltd. Reg.Shares		STK	8.500	8.500	0	JPY 1.124,000	77.944,12	0,18
JP3595200001	Tosoh Corp. Reg.Shares ¹⁾		STK	6.200	0	3.900	JPY 1.515,000	76.630,63	0,18
SEK								238.261,40	0,55
SE0000667891	Sandvik AB Namn-Aktier		STK	4.749	8.264	3.515	SEK 169,800	76.366,10	0,18
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria)		STK	7.541	7.541	0	SEK 85,740	61.231,26	0,14
SE0000115446	Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria)		STK	7.278	0	0	SEK 146,050	100.664,04	0,23
USD								12.238.806,69	28,10
US000287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	1.934	0	300	USD 70,000	118.889,96	0,27
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A		STK	1.000	0	0	USD 183,000	160.709,58	0,37
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares		STK	700	0	100	USD 293,230	180.259,07	0,41
IE00BFR3W74	Allegion PLC Reg.Shares		STK	1.200	0	200	USD 108,770	114.625,45	0,26
US0185811082	Alliance Data Systems Corp. Reg.Shares		STK	600	0	0	USD 137,300	72.345,66	0,17
US01973R1014	Allison Transmission Hldg.Inc. Reg.Shares		STK	2.300	0	0	USD 45,890	92.690,79	0,21
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk Cl.C		STK	100	0	0	USD 1.076,010	94.494,60	0,22
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	100	0	100	USD 1.076,630	94.549,05	0,22
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares		STK	195	47	52	USD 1.904,280	326.103,98	0,75
US0234361089	Amedisys Inc. Reg.Shares		STK	600	600	0	USD 119,670	63.056,12	0,14
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	700	0	100	USD 184,020	113.123,74	0,26
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	2.900	700	400	USD 199,740	508.690,61	1,17
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares		STK	6.800	6.200	2.600	USD 32,980	196.947,40	0,45
US0495601058	Atmos Energy Corp. Reg.Shares		STK	800	800	0	USD 104,830	73.648,90	0,17
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	1.000	0	200	USD 164,010	144.032,67	0,33
US0536111091	Avery Dennison Corp. Reg.Shares		STK	1.100	0	0	USD 113,030	109.188,55	0,25
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares		STK	5.500	0	5.000	USD 28,210	136.256,26	0,31
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New		STK	400	0	400	USD 212,020	74.477,91	0,17
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares		STK	1.800	0	0	USD 68,470	108.233,95	0,25
US09857L1089	Booking Holdings Inc. Reg.Shares		STK	100	100	0	USD 1.845,170	162.041,80	0,37
US1011371077	Boston Scientific Corp. Reg.Shares		STK	3.200	0	700	USD 41,930	117.832,62	0,27
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	3.300	3.300	0	USD 45,100	130.701,68	0,30
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares		STK	600	600	0	USD 285,710	150.545,36	0,35
US11133T1034	Broadridge Financial Solutions Reg.Shares		STK	800	0	0	USD 128,700	90.418,90	0,21
US1220171060	Burlington Stores Inc. Reg.Shares		STK	600	0	300	USD 169,410	89.264,95	0,20
US1270971039	Cabot Oil & Gas Corp. Reg.Shares		STK	4.800	0	700	USD 22,660	95.519,45	0,22
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	1.800	0	1.000	USD 70,170	110.921,23	0,25
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	2.600	0	600	USD 50,830	116.060,42	0,27
US12514G1085	CDW Corp. Reg.Shares		STK	1.000	0	300	USD 110,400	96.952,67	0,22
US1508701034	Celanese Corp. (Del.) Reg.Shares		STK	1.000	1.000	0	USD 106,140	93.211,56	0,21
US1510201049	Celgene Corp. Reg.Shares		STK	1.400	0	800	USD 92,350	113.541,76	0,26
US15189T1079	CenterPoint Energy Inc. Reg.Shares		STK	4.500	0	0	USD 28,510	112.667,95	0,26
US1729081059	Cintas Corp. Reg.Shares		STK	500	0	100	USD 235,680	103.486,43	0,24
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	800	0	900	USD 55,730	39.153,42	0,09
US1746101054	Citizens Financial Group Inc. Reg.Shares		STK	3.600	0	700	USD 34,770	109.925,35	0,25
US1773761002	Citrix Systems Inc. Reg.Shares		STK	1.300	1.300	0	USD 97,720	111.562,31	0,26
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A		STK	4.800	0	2.000	USD 42,000	177.044,00	0,41
US2003401070	Comerica Inc. Reg.Shares		STK	1.200	0	300	USD 71,370	75.212,08	0,17
US20825C1045	ConocoPhillips Reg.Shares		STK	2.400	0	300	USD 61,270	129.136,73	0,30
US2435371073	Deckers Outdoor Corp. Reg.Shares		STK	900	0	0	USD 175,240	138.505,31	0,32
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares		STK	1.900	2.200	300	USD 77,590	129.464,30	0,30
CA2925051047	EnCana Corp. Reg.Shares		STK	12.557	12.558	1	USD 5,010	55.247,71	0,13
US26875P1012	EOG Resources Inc. Reg.Shares		STK	1.400	0	200	USD 92,110	113.246,68	0,26
US30161N1019	Exelon Corp. Reg.Shares		STK	2.700	0	400	USD 47,560	112.770,70	0,26
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares		STK	2.300	0	400	USD 75,820	153.144,81	0,35
US30303M1027	Facebook Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	800	0	0	USD 189,500	133.134,28	0,31
US3032501047	Fair Isaac Corp. Reg.Shares		STK	300	0	100	USD 302,100	79.590,76	0,18
US3167731005	Fifth Third Bancorp Reg.Shares		STK	5.000	0	0	USD 27,290	119.829,63	0,27
US3379321074	FirstEnergy Corp. Reg.Shares		STK	2.700	0	500	USD 42,510	100.796,52	0,23
US40416M1053	HD Supply Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.200	0	0	USD 39,550	76.411,70	0,18
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares		STK	7.500	8.700	1.200	USD 14,970	98.599,28	0,23
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares		STK	400	0	0	USD 264,600	92.948,10	0,21
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares		STK	4.400	1.600	500	USD 47,460	183.388,07	0,42
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	2.100	500	300	USD 140,690	259.461,67	0,60

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares	STK	1.800	1.800	0	200	USD 108,840	172.048,83	0,39
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares	STK	1.000	1.000	0	200	USD 133,920	117.607,80	0,27
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares	STK	500	500	0	300	USD 186,130	81.729,16	0,19
US5132721045	Lamb Weston Holdings Inc. Reg.Shares	STK	1.600	1.600	0	0	USD 61,700	86.695,35	0,20
US5218652049	Lear Corp. Reg.Shares	STK	800	800	0	0	USD 140,460	98.680,95	0,23
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares	STK	500	500	0	100	USD 273,330	120.018,44	0,28
US5463471053	Louisiana Pacific Corp. Reg.Shares	STK	3.200	3.200	0	800	USD 25,970	72.981,47	0,17
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV Reg.Shares A	STK	1.500	1.500	0	200	USD 86,640	114.130,15	0,26
US55261F1049	M&T Bank Corp. Reg.Shares	STK	700	700	0	0	USD 168,720	103.718,28	0,24
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares	STK	3.400	3.400	0	900	USD 39,000	116.448,58	0,27
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares	STK	1.100	1.100	0	0	USD 133,920	129.368,58	0,30
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK	1.400	1.400	1.400	1.700	USD 83,830	103.066,65	0,24
US5951121038	Micron Technology Inc. Reg.Shares	STK	3.100	3.100	0	600	USD 38,070	103.641,87	0,24
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK	3.700	3.700	400	1.500	USD 134,150	435.896,20	1,00
US60855R1005	Molina Healthcare Inc. Reg.Shares	STK	900	900	900	0	USD 141,340	111.711,60	0,26
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc. Reg.Shares	STK	800	800	0	0	USD 147,260	103.458,33	0,24
US6821891057	ON Semiconductor Corp. Reg.Shares	STK	5.000	5.000	0	1.000	USD 20,390	89.531,92	0,21
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares	STK	2.000	2.000	0	300	USD 70,690	124.159,13	0,28
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares	STK	5.600	5.600	0	1.700	USD 43,430	213.583,91	0,49
US7181721090	Phillip Morris Internat. Inc. Reg.Shares	STK	2.000	2.000	2.000	0	USD 77,920	136.857,82	0,31
US7185461040	Phillips 66 Reg.Shares	STK	1.300	1.300	0	200	USD 91,750	104.746,64	0,24
US7237871071	Pioneer Natural Resources Co. Reg.Shares	STK	700	700	1.000	300	USD 150,810	92.708,35	0,21
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares	STK	600	600	0	300	USD 226,990	119.604,81	0,27
US8454671095	Southwestern Energy Co. Reg.Shares	STK	24.800	24.800	0	0	USD 3,060	66.644,42	0,15
US8718291078	Sysco Corp. Reg.Shares	STK	2.000	2.000	0	0	USD 70,440	123.720,03	0,28
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares	STK	1.500	1.500	0	300	USD 100,140	131.913,59	0,30
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK	1.200	1.200	500	400	USD 207,020	218.164,57	0,50
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK	400	400	0	0	USD 109,780	38.563,27	0,09
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares	STK	100	100	0	1.600	USD 139,300	12.233,25	0,03
US8894781033	Toll Brothers Inc. Reg.Shares	STK	3.400	3.400	0	0	USD 36,520	109.043,65	0,25
US8910271043	Torchmark Corp. Reg.Shares	STK	1.200	1.200	0	0	USD 88,440	93.201,02	0,21
US8919061098	Total System Services Inc. Reg.Shares	STK	1.100	1.100	0	600	USD 128,220	123.862,30	0,28
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	1.800	1.800	0	300	USD 79,650	125.906,74	0,29
US9026811052	UGI Corp. Reg.Shares	STK	1.400	1.400	0	0	USD 52,810	64.928,43	0,15
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares	STK	1.000	1.000	0	0	USD 131,970	115.895,32	0,27
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares	STK	600	600	0	100	USD 246,340	129.800,65	0,30
US92343E1029	Verisign Inc. Reg.Shares	STK	700	700	0	100	USD 207,290	127.428,65	0,29
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares	STK	2.200	2.200	0	0	USD 57,250	110.608,59	0,25
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	700	700	0	100	USD 178,580	109.779,57	0,25
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	1.500	1.500	0	600	USD 171,230	225.559,85	0,52
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc. Reg.Shares	STK	1.800	1.800	0	300	USD 54,520	86.182,49	0,20
US94106L1098	Waste Management Inc. (Del.) Reg.Shares	STK	1.200	1.200	0	200	USD 115,840	122.076,05	0,28
US94946T1060	WellCare Health Plans Inc. Reg.Shares	STK	400	400	0	0	USD 286,070	100.490,03	0,23
US9892071054	Zebra Technologies Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	600	600	600	0	USD 207,630	109.403,71	0,25
US9897011071	Zions Bancorporation N.A. Reg.Shares	STK	2.200	2.200	2.200	0	USD 45,000	86.941,25	0,20
Verzinsliche Wertpapiere								15.033.326,89	34,47
EUR								9.990.361,00	22,90
FR0011076439	4,0000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 11/21	EUR	300.000	300.000	0	0	% 108,447	325.339,50	0,75
FR0010870949	4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20	EUR	300.000	300.000	0	0	% 103,548	310.642,50	0,71
XS0802174044	3,0000 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 12/21	EUR	300.000	300.000	0	0	% 106,258	318.772,50	0,73
XS1205616268	1,3750 % APT Pipelines Ltd. MTN 15/22	EUR	300.000	300.000	0	0	% 103,623	310.867,50	0,71
XS0953783239	2,3750 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 13/20	EUR	300.000	300.000	0	0	% 102,720	308.158,50	0,71
XS1232146412	0,7500 % Caterpillar Intl Finance Ltd. MTN 15/20	EUR	300.000	300.000	0	0	% 101,269	303.805,50	0,70
FR0011660596	2,6250 % Eutelsat S.A. Bonds 13/20	EUR	300.000	300.000	0	0	% 100,795	302.385,00	0,69
XS0723509104	5,2500 % FMC Finance VIII S.A. Notes 12/19 Reg.S	EUR	250.000	250.000	0	0	% 100,415	251.037,50	0,58
DE000A135JM6	0,8750 % Freistaat Thüringen Landessch. S.2014/02 14/24	EUR	2.500.000	2.500.000	0	500.000	% 106,404	2.660.100,00	6,09
XS0875513268	2,3750 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 13/20	EUR	350.000	350.000	0	0	% 101,386	354.851,00	0,81
XS1379182006	1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22	EUR	300.000	300.000	0	0	% 104,060	312.178,50	0,72
XS1191116174	1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22	EUR	300.000	300.000	0	0	% 104,035	312.103,50	0,72
FR0011535764	2,5000 % Kering S.A. MTN 13/20	EUR	100.000	100.000	0	0	% 102,825	102.825,00	0,24
FR0011625441	1,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 13/20	EUR	300.000	300.000	0	0	% 102,710	308.128,50	0,71
XS0829360923	6,0000 % Naturgy Capital Markets S.A. MTN 12/20	EUR	300.000	300.000	0	0	% 103,616	310.848,00	0,71
XS0690406243	4,2500 % OMV AG MTN 11/21 ¹⁾	EUR	300.000	300.000	0	0	% 110,513	331.539,00	0,76
XS0841018004	2,8750 % Origin Energy Finance Ltd. MTN 12/19	EUR	300.000	300.000	0	0	% 100,853	302.557,50	0,69
XS1082660744	2,5000 % ORLEN Capital AB Notes 14/21	EUR	300.000	300.000	0	0	% 104,912	314.736,00	0,72

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
FR0011798115	2,0000 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 14/20		EUR	300.000	0	0	% 102,038	306.114,00	0,70
XS1082661551	1,3750 % PZU Finance AB Notes 14/19		EUR	300.000	0	0	% 100,004	300.012,00	0,69
XS0976892611	3,2500 % Rentokil Initial PLC MTN 13/21		EUR	300.000	0	0	% 106,565	319.695,00	0,73
XS0933604943	2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 13/20		EUR	300.000	0	0	% 102,564	307.692,00	0,71
XS1077584024	1,8750 % Ryanair DAC MTN 14/21		EUR	300.000	0	0	% 103,695	311.085,00	0,71
XS1188117391	0,9000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20		EUR	300.000	0	0	% 100,715	302.145,00	0,69
XS0957258212	1,7500 % Unilever N.V. MTN 13/20 ¹⁾		EUR	100.000	0	0	% 102,182	102.181,50	0,23
XS0439828269	4,7500 % Verbund AG MTN 09/19		EUR	300.000	0	0	% 100,187	300.561,00	0,69
USD								5.042.965,89	11,57
US00182EAV11	2,6000 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) MTN 14/19 144A		USD	300.000	0	0	% 100,019	263.509,70	0,60
US15089QAC87	5,8750 % Celanese US Holdings LLC Notes 11/21		USD	300.000	0	0	% 105,971	279.189,43	0,64
US172967FF30	5,3750 % Citigroup Inc. Notes 10/20		USD	850.000	0	0	% 103,240	770.647,01	1,76
US361448AN33	4,7500 % GATX Corp. Notes 12/22		USD	300.000	0	0	% 105,656	278.360,85	0,64
US472319AF91	8,5000 % Jefferies Group LLC Notes 09/19		USD	300.000	0	0	% 100,196	263.974,71	0,61
US46625HJD35	4,5000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 12/22		USD	550.000	0	0	% 105,277	508.492,80	1,17
US615369AA32	5,5000 % Moody's Corp. Notes 10/20		USD	300.000	0	0	% 103,483	272.634,58	0,63
US61747YCM57	5,5000 % Morgan Stanley MTN S.F 10/20		USD	550.000	0	0	% 101,784	491.621,37	1,13
US61744YAH18	2,7500 % Morgan Stanley Notes 17/22		USD	300.000	0	0	% 101,042	266.204,88	0,61
US824348AU08	2,7500 % Sherwin-Williams Co. Notes 17/22		USD	300.000	0	0	% 100,274	264.180,21	0,61
US84265VAD73	5,3750 % Southern Copper Corp. Notes 10/20		USD	300.000	0	0	% 102,204	269.264,95	0,62
US38141IGGS75	5,7500 % The Goldman Sachs Group Inc. Notes 12/22		USD	800.000	0	0	% 107,940	758.338,46	1,73
US98310WAJ71	4,2500 % Wyndham Destinations Inc. Notes 12/22		USD	400.000	0	0	% 101,500	356.546,94	0,82
Sonstige Beteiligungswertpapiere								208.189,57	0,48
CHF								208.189,57	0,48
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine		STK	847	246	90	CHF 272,850	208.189,57	0,48
Andere Wertpapiere								3.549,19	0,01
EUR								3.549,19	0,01
ES06735169E5	Repsol S.A. Anrechte		STK	7.264	7.264	0	EUR 0,489	3.549,19	0,01
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								3.924.560,78	9,01
Verzinsliche Wertpapiere								3.924.560,78	9,01
EUR								1.339.912,50	3,07
ES0211845252	4,7500 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 12/19		EUR	300.000	0	0	% 101,578	304.734,00	0,70
XS1319820624	1,6250 % Carnival Corp. Notes 16/21		EUR	300.000	0	0	% 102,723	308.169,00	0,71
XS1117297942	0,6880 % Geberit International B.V. Notes 15/21		EUR	100.000	0	0	% 101,229	101.229,00	0,23
XS1238991480	2,0000 % Harman Finance Intern. S.C.A. Notes 15/22		EUR	300.000	0	0	% 104,753	314.257,50	0,72
XS1137512668	1,5000 % Mölnlycke Holding AB Notes 14/22		EUR	300.000	0	0	% 103,841	311.523,00	0,71
USD								2.584.648,28	5,94
US03027XAH35	3,3000 % American Tower Corp. Notes 16/21		USD	300.000	0	0	% 101,320	266.935,98	0,61
US05946KAD37	3,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Notes 15/20		USD	600.000	0	0	% 100,740	530.815,84	1,22
US449786BJ07	2,0500 % ING Bank N.V. Notes 16/21 144A		USD	200.000	0	0	% 99,485	174.734,35	0,40
US67066GAD60	2,2000 % NVIDIA Corp. Notes 16/21		USD	300.000	0	0	% 99,692	262.646,88	0,60
US714264AA62	5,7500 % Pernod-Ricard S.A. Notes 11/21 144A		USD	300.000	0	0	% 105,628	278.285,76	0,64
US761713BE57	3,2500 % Reynolds American Inc. Notes 15/20		USD	300.000	0	0	% 100,648	265.165,54	0,61
US761713BF23	4,0000 % Reynolds American Inc. Notes 15/22		USD	300.000	0	0	% 103,879	273.677,88	0,63
US81180WAV37	4,2500 % Seagate HDD Cayman Notes 17/22		USD	300.000	0	0	% 101,750	268.068,85	0,62
US8672EMAG91	2,8000 % Suncorp-Metway Ltd. MTN 17/22 144A		USD	300.000	0	0	% 100,326	264.317,20	0,61
Nichtnotierte Wertpapiere								401.790,00	0,92
Verzinsliche Wertpapiere								401.790,00	0,92
EUR								401.790,00	0,92
XS1821532493	0,0200 % Toyota Industries Fin. Intl AB MTN 18/21		EUR	400.000	0	0	% 100,448	401.790,00	0,92

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
Wertpapier-Investmentanteile								953.078,74	2,19	
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								423.039,00	0,97	
EUR								423.039,00	0,97	
DE0005424568	Deka-BR 45		ANT	6.900	6.900	0	EUR 61,310	423.039,00	0,97	
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								530.039,74	1,22	
EUR								530.039,74	1,22	
LU1685587914	Deka-MultiFactor Emerging Markets Corporates I		ANT	2.038	0	0	EUR 98,060	199.846,28	0,46	
LU1685588219	Deka-MultiFactor Global Corporates I		ANT	811	0	0	EUR 99,480	80.678,28	0,19	
LU1685587591	Deka-MultiFactor Global Corporates HY I		ANT	1.991	0	0	EUR 98,620	196.352,42	0,45	
LU1685588649	Deka-MultiFactor Global Government Bonds I		ANT	532	0	0	EUR 99,930	53.162,76	0,12	
Summe Wertpapiervermögen²⁾								EUR	41.089.965,10	94,29
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte								-33.222,47	-0,07	
	FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 19	IFEU	GBP	Anzahl -2				-1.758,65	0,00	
	FTSE MIB INDEX Future (IFS) Sep. 19	XMIL	EUR	Anzahl -1				-2.850,00	-0,01	
	IBEX 35 Future (MFXI) Juli 19	XMAD	EUR	Anzahl -2				-1.210,00	0,00	
	S&P 500 ST Future (SP) Sep. 19	XIOM	USD	Anzahl -4				-31.702,82	-0,07	
	S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 19	XMOD	CAD	Anzahl -2				456,12	0,00	
	Swiss Market Index Future (S30) Sep. 19	XEUR	CHF	Anzahl -1				90,08	0,00	
	Topix-Tokyo Stock Price Index Future (ITI) Sep. 19	XOSE	JPY	Anzahl -4				3.752,80	0,01	
Optionsrechte								32.666,69	0,07	
Optionsrechte auf Aktienindices								32.666,69	0,07	
	DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juli 19 3250	XEUR		Anzahl 12			EUR 4,900	588,00	0,00	
	S & P 500 Index (S500) Put Aug. 19 2825	XCBO		Anzahl 9			USD 30,320	23.964,17	0,05	
	S & P 500 Index (S500) Put Juli 19 2750	XCBO		Anzahl 14			USD 6,600	8.114,52	0,02	
Summe Aktienindex-Derivate								EUR	-555,78	0,00
Zins-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte								57.377,64	0,12	
	10 Year Spanish Bono Futures (FBON) Sep. 19	XEUR	EUR	500.000				14.432,85	0,03	
	EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 19	XEUR	EUR	-1.100.000				-5.620,00	-0,01	
	EURO Bund Future (FGBL) Sep. 19	XEUR	EUR	800.000				13.520,00	0,03	
	EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 19	XEUR	EUR	-3.700.000				-6.845,00	-0,02	
	EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 19	XEUR	EUR	600.000				27.230,00	0,06	
	Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 19	XCBT	USD	400.000				5.406,38	0,01	
	Long Gilt Future (FLG) Sep. 19	IFEU	GBP	700.000				7.791,50	0,02	
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 19	XEUR	EUR	700.000				17.290,00	0,04	
	Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 19	XCBT	USD	400.000				8.233,07	0,02	
	Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 19	XCBT	USD	-4.200.000				-24.061,16	-0,06	
Summe Zins-Derivate								EUR	57.377,64	0,12
Devisen-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								202.508,47	0,46	
Offene Positionen										
	AUD/EUR 800.000,00	OTC						3.270,03	0,01	
	CAD/EUR 1.650.000,00	OTC						-12.233,88	-0,03	
	CHF/EUR 770.000,00	OTC						-4.729,82	-0,01	
	GBP/EUR 1.200.000,00	OTC						18.610,07	0,04	
	JPY/EUR 213.000.000,00	OTC						14.553,19	0,03	
	SEK/EUR 2.500.000,00	OTC						-888,26	0,00	
	USD/EUR 18.100.000,00	OTC						183.927,14	0,42	
Summe Devisen-Derivate								EUR	202.508,47	0,46
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds										
Bankguthaben										
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.244.094,88			% 100,000	1.244.094,88	2,84	
EUR-Guthaben bei										
	Landesbank Baden-Württemberg		EUR	33.192,65			% 100,000	33.192,65	0,08	
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	347.268,75			% 100,000	46.526,14	0,11	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	137.904,67			% 100,000	153.497,74	0,35	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	21.722,74			% 100,000	2.240,28	0,01	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	242.520,90			% 100,000	22.967,30	0,05	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	57.303,99			% 100,000	35.304,84	0,08	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	91.728,99			% 100,000	61.528,19	0,14	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	125.019,91			% 100,000	112.623,95	0,26	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	40.608,30			% 100,000	4.566,94	0,01	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	7.681.850,00			% 100,000	62.670,61	0,14	

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	197.962,23			% 100,000	173.849,33	0,40
	Summe Bankguthaben						EUR	1.953.062,85	4,47
	Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR	1.953.062,85	4,47
	Sonstige Vermögensgegenstände								
	Zinsansprüche		EUR	238.576,30				238.576,30	0,55
	Dividendenansprüche		EUR	32.845,70				32.845,70	0,08
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	103,79				103,79	0,00
	Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung		EUR	38.629,17				38.629,17	0,09
	Forderungen aus Ersatzleistung Zinsen/Dividenden		EUR	5.250,00				5.250,00	0,01
	Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	315.404,96	0,73
	Sonstige Verbindlichkeiten								
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-50,87				-50,87	0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-1.000,73				-1.000,73	0,00
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-32.262,59				-32.262,59	-0,07
	Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-33.314,19	-0,07
	Fondsvermögen						EUR	43.584.449,05	100,00
	Umlaufende Anteile						STK	999.905,000	
	Anteilwert						EUR	43,59	

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

¹⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

²⁾ Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen in EUR		gesamt
		befristet	unbefristet	
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
Advantest Corp. Reg.Shares	STK 2.645		63.980,62	
Obayashi Corp. Reg.Shares	STK 8.611		74.536,17	
Tosoh Corp. Reg.Shares	STK 3.448		42.616,52	
4,2500 % OMV AG MTN 11/21	EUR 300.000		331.539,00	
1,7500 % Unilever N.V. MTN 13/20	EUR 100.000		102.181,50	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		614.853,81	614.853,81

Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 1.596.060,00

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2019

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,89842	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,46395	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,69645	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	10,55940	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,11007	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,13870	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,49085	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	122,57500	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,89180	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,62312	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XMAD	Madrid - Bolsa de Madrid
XMIL	Mailand - Borsa Italiana
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)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
XMOD	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options

OTC Over-the-Counter

Sigma Plus Balanced

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				
AU000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK	0	13.970
AU000000CIM7	CIMIC Group Ltd. Reg.Shares	STK	1.620	1.620
AU000000CPU5	Computershare Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.605
AU000000RHC8	Ramsay Health Care Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.715
CHF				
CH0432492467	Alcon AG Namens-Aktien	STK	529	529
CH0013841017	Lonza Group AG Namens-Aktien	STK	0	373
DKK				
DK00060634707	Royal Unibrew AS Navne-Aktier	STK	0	984
DK0010268606	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier	STK	1.369	1.369
EUR				
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK	518	518
NL0011872643	ASR Nederland N.V. Aandelen op naam	STK	0	2.224
ES0130670112	Endesa S.A. Acciones Port.	STK	2.196	2.196
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port.	STK	5.299	5.299
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK	972	972
DE0005SHA0159	Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.	STK	0	6.306
FR0013326246	Unib.-Rod.SEWFD Unib.-Rod.NV Stapled Shares	STK	577	577
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien	STK	1.886	1.886
GBP				
GB0002162385	Aviva PLC Reg.Shares	STK	0	24.573
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Reg.Shares	STK	12.826	12.826
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC Reg.Shares	STK	0	163.285
GB00B03MLX29	Royal Dutch Shell Reg.Shares Cl.A	STK	0	3.897
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC Reg.Shares	STK	0	68.801
GB0001367019	The British Land Co. PLC Reg.Shares	STK	0	11.821
JPY				
JP3476480003	Dai-Ichi Life Holdings Inc. Reg.Shares	STK	4.900	4.900
JP3788600009	Hitachi Ltd. Reg.Shares	STK	0	2.400
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares	STK	1.900	4.000
JP3633400001	Toyota Motor Corp. Reg.Shares	STK	0	1.300
JP3659000008	West Japan Railway Co. Reg.Shares	STK	700	700
NOK				
NO0003921009	DNO ASA Navne-Aksjer A	STK	0	39.107
SEK				
SE0011166610	Atlas Copco AB Namn-Aktier A	STK	1.908	1.908
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Akt. B (fria)	STK	7.143	7.143
USD				
US0010551028	AFLAC Inc. Reg.Shares	STK	0	3.200
US0220951033	Altria Group Inc. Reg.Shares	STK	3.800	3.800
US0970231058	Boeing Co. Reg.Shares	STK	0	600
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares	STK	0	1.000
US1255231003	Cigna Corp. Reg.Shares	STK	0	389
US1729674242	Citigroup Inc. Reg.Shares	STK	0	2.300
US2166484020	Cooper Companies Inc. Reg.Shares	STK	0	600
US2172041061	Copart Inc. Reg.Shares	STK	0	2.300
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares	STK	0	800
US2644115055	Duke Realty Corp. Reg.Shares	STK	2.200	2.200
US23355L1061	DXC Technology Co. Reg.Shares	STK	0	1.600
US2774321002	Eastman Chemical Co. Reg.Shares	STK	0	1.700
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares	STK	0	700
US3142111034	Federated Investors Inc. Reg.Shares Cl.B	STK	0	3.800
US3377381088	Fiserv Inc. Reg.Shares	STK	0	1.900
US34959E1091	Fortinet Inc. Reg.Shares	STK	0	1.600
US4198791018	Hawaiian Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	1.800
US45168D1046	IDEXX Laboratories Inc. Reg.Shares	STK	0	700
IE00BBGT3753	Mallinckrodt PLC Reg.Shares	STK	0	3.400
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A	STK	0	500
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares	STK	0	200
US65339F1012	Nextera Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	400
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares	STK	600	1.400
IE00B58JVZ52	Seagate Technology PLC Reg.Shares	STK	0	3.100
US1689051076	The Children's Place Inc. Reg.Shares	STK	0	800
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares	STK	900	900
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares	STK	0	1.200
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares	STK	0	400
US9078181081	Union Pacific Corp. Reg.Shares	STK	0	600
US9497461015	Wells Fargo & Co. Reg.Shares	STK	0	1.600
US9581021055	Western Digital Corp. Reg.Shares	STK	0	2.100
US98310W1080	Wyndham Destinations Inc. Reg.Shares	STK	0	3.000
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
XS0789283792	2,7500 % Anglo American Capital PLC MTN 12/19	EUR	0	250.000
FR0010957662	3,6410 % Bouygues S.A. Obl. 10/19	EUR	0	450.000

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
XS0800572454	2,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 12/19	EUR	0	350.000
XS0944362812	2,3750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 13/20	EUR	0	300.000
XS1198115898	0,5000 % Essity AB MTN 15/20	EUR	0	500.000
XS0482908091	4,7500 % Experian Finance PLC MTN 10/20	EUR	0	450.000
XS1369254310	1,0000 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19	EUR	0	200.000
XS0592627003	4,2500 % Telia Company AB MTN 11/20	EUR	0	450.000
FR0010830034	4,8750 % Vivendi S.A. MTN 09/19	EUR	0	350.000
XS0858089740	2,3750 % Volvo Treasury AB MTN 12/19	EUR	0	500.000
DE000A1HNW52	3,1250 % Vonovia Finance B.V. Anl. 13/19	EUR	0	100.000
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06735169D7	Repsol S.A. Anrechte	STK	0	7.063
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
ES03136793B0	1,7500 % Bankinter S.A. Bonos 14/19	EUR	0	300.000
USD				
US44987CAN83	2,3000 % ING Bank N.V. MTN 16/19 144A	USD	0	400.000
US74834LAU44	2,7000 % Quest Diagnostics Inc. Notes 14/19	USD	0	300.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
USD				
US04685W1036	athenahealth Inc. Reg.Shares	STK	0	800
US6512901082	Newfield Exploration Co. Reg.Shares	STK	0	4.700

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:		
(Basiswert(e): Amsterdam EXchanges (AEX) Index, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), Nasdaq-100 Index, OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), S&P 500 Index)	EUR	5.788
Verkaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): Amsterdam EXchanges (AEX) Index, CAC 40 INDEX, DAX Performance-Index, FTSE 100 Index, FTSE MIB Index, IBEX 35 Index, OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), OMX Stockholm 30 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), Swiss Market Index (Price) (CHF), TOPIX Index (Price) (JPY))	EUR	13.158
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): 10 Year Spanish Bono Futures (FBON), EURO Bund Future (FGBL), EURO-BTP Future (FBTP), Five-Year US Treasury Note Future (FV), Long Gilt Future (FLG), Long Term EURO OAT Future (FOAT), Ten-Year US Treasury Note Future (TY))	EUR	7.767
Verkaufte Kontrakte:		
(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM), EURO Schatz Future (FGBS), Two-Year US Treasury Note Future (TU))	EUR	15.161
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))	EUR	3.750
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	26.949
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):		
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	11.288
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	622
CAD/EUR	EUR	1.129
CHF/EUR	EUR	768
GBP/EUR	EUR	1.798
JPY/EUR	EUR	1.859
SEK/EUR	EUR	402
USD/EUR	EUR	19.526
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	1.183
CAD/EUR	EUR	1.891
CHF/EUR	EUR	1.216
GBP/EUR	EUR	3.274
JPY/EUR	EUR	3.673
SEK/EUR	EUR	539

Sigma Plus Balanced

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
USD/EUR	EUR	36.023
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
befristet	EUR	226
(Basiswert(e): Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A)		
unbefristet	EUR	6.694
(Basiswert(e): 1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22, 1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22, 1,6250 % Carnival Corp. Notes 16/21, 1,7500 % Bankinter S.A. Bonos 14/19, 1,7500 % Unilever N.V. MTN 13/20, 2,3750 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 13/20, 2,3750 % HELLA GmbH & Co. KGaA Anl. 13/20, 2,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 12/19, 2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 13/20, 4,2500 % Telia Company AB MTN 11/20, 4,7500 % Experian Finance PLC MTN 10/20, 4,8750 % Vivendi S.A. MTN 09/19, Amgen Inc. Reg.Shares, Celgene Corp. Reg.Shares, Merck & Co. Inc. Reg.Shares, Microsoft Corp. Reg.Shares, Nextera Energy Inc. Reg.Shares, NEXT PLC Reg.Shares, Pfizer Inc. Reg.Shares, Sumco Corp. Reg.Shares, Unilever N.V. Cert.v.Aand., West Japan Railway Co. Reg.Shares)		

Sigma Plus Balanced

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	999,905
Anteilwert	EUR	43,59

Angaben zu Bewertungsverfahren

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgt durch die Verwaltungsgesellschaft auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch (§ 168) und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und -Bewertungsverordnung (KARBV).

Aktien / aktienähnliche Genussscheine / Beteiligungen / Investmentanteile

Aktien und aktienähnliche Genussscheine werden grundsätzlich mit dem zuletzt verfügbaren Kurs ihrer Heimatbörse bewertet, sofern die Umsatzzumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte, z.B. Broker-Quotes, zugrunde gelegt, welche sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Investmentanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet, sofern dieser aktuell und verlässlich ist. Exchange-traded funds (ETFs) werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs bewertet.

Renten / rentenähnliche Genussscheine / Zertifikate / Schuldscheindarlehen

Verzinsliche Wertpapiere, rentenähnliche Genussscheine, Zertifikate und Schuldscheindarlehen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mittels externer Modellkurse, z.B. Broker-Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.

Bankguthaben

Der Wert von Bankguthaben, Einlagezertifikaten und ausstehenden Forderungen, Bardividenden und Zinsansprüchen entspricht grundsätzlich dem jeweiligen nominalen Betrag.

Derivate

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Die Bewertung von Futures und Optionen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, erfolgt anhand von Fair Values, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Black-Scholes-Merton) ermittelt werden. Die Bewertung von Swaps erfolgt anhand von Fair Values, welche mittels marktgängiger Verfahren (z.B. Discounted-Cash-Flow-Verfahren) ermittelt werden. Devisentermingeschäfte werden nach der Forward Point Methode bewertet.

Sonstiges

Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Fonds geführt werden, wird in diese Währung zu den jeweiligen Devisenkursen (i.d.R. Reuters-Fixing) umgerechnet.

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Aktien	181.133,31	0,42
Verzinsliche Wertpapiere	433.720,50	1,00

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	614.853,81	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	614.853,81

Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für bilaterale Geschäfte

Die Sicherheit, die der Fonds erhält, kann in liquiden Mitteln (u.a. Bargeld und Bankguthaben) oder durch die Übertragung oder Verpfändung von Schuldverschreibungen, insbesondere Staatsanleihen, geleistet werden. Schuldverschreibungen, die als Sicherheit begeben werden, müssen ein Mindestrating von BBB- aufweisen. Die Sicherheit kann auch in Aktien bestehen. Die Aktien, die als Sicherheit begeben werden, müssen an einem geregelten Markt in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder an einer Börse in einem Mitgliedstaat der OECD notiert sein oder gehandelt werden und in einem wichtigen Index enthalten sein.

Von den Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten sowie ggf. nach Restlaufzeit variieren. Die Haircuts fallen für die aufgeführten Wertpapierkategorien wie folgt aus:

- Bankguthaben 0%
- Aktien 5% - 40%
- Renten 0,5% - 30%

Darüber hinaus kann für Sicherheiten in einer anderen Währung als der Fondswährung ein zusätzlicher Wertabschlag von bis zu 10%-Punkten angewandt werden. In besonderen Marktsituationen (z.B. Marktturbulenzen) kann die Verwaltungsgesellschaft von den genannten Werten abweichen.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen
EUR

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR
unbefristet	1.969.776,83

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	873,86	100,00
Kostenanteil des Fonds	428,22	49,00
Ertragsanteil der KVG	428,22	49,00

Sigma Plus Balanced

Als Bruttoertrag wird mit dem auf Fondsebene verbuchten Ertrag aus Leihegeschäften gerechnet.

Der Ertragsanteil der KVG entspricht maximal dem Kostenanteil des Fonds. Der Kostenanteil der KVG ist auf Ebene des Sondervermögens im Einzelnen nicht bestimmbar.

Geschäftsbedingt gibt es bei Principalgeschäften keine expliziten Kosten durch Dritte. Sofern diese Geschäfte getätigt werden, sind Ertrags- und Kostenanteile Dritter über die in den Wertpapierleihesätzen enthaltenen Margen abgedeckt und damit bereits im Ertragsanteil des Fonds berücksichtigt. Bei Agencygeschäften werden Erträge und Kosten Dritter über eine Gebührenaufteilung (Fee split) definiert. Hier beträgt der Ertragsanteil des Agenten zwischen 20% und 35% vom Bruttoleihesatz.

Kosten Dritter als Agent der KVG werden nicht auf Ebene des Sondervermögens offengelegt.

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)

Eine Wiederanlage von Barsicherheiten liegt nicht vor.

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

1,50% (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
Orange S.A.	843.750,25
Münchener Hypothekbank eG	725.082,74
FMS Wertmanagement	200.808,00
Berlin Hyp AG	200.135,84

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
Clearstream Banking Frankfurt	1.126.026,58 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
J.P.Morgan AG Frankfurt	843.750,25 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

Eine Zuordnung der Kontrahenten zu den erhaltenen Sicherheiten ist auf Geschäftsartenebenen durch die Globalbesicherung im Einzelnen bei Total Return Swaps nicht möglich. Der ausgewiesene Wert enthält daher ausdrücklich keine Total Return Swaps, diese sind innerhalb der Globalbesicherung jedoch ausreichend besichert.

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten/Depots	0,00%
Sammelkonten/Depots	0,00%
andere Konten/Depots	0,00%
Verwahrart bestimmt Empfänger	0,00%

Da eine Zuordnung begebener Sicherheiten bei Total Return Swaps auf Geschäftsartenebene durch die Globalbesicherung im Einzelnen nicht möglich ist, erfolgt der %-Ausweis für die Verwahrarten ohne deren Berücksichtigung.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2019

Deka Investment GmbH

Die Geschäftsführung

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 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 2018

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.

Alleingeschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Rüdiger
Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;
Vorsitzender des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main;
Mitglied des Aufsichtsrates der Deka Immobilien GmbH,
Frankfurt am Main

Stellvertretende Vorsitzende

Manuela Better
Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main;
Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main
und der
Deka Immobilien GmbH, Frankfurt am Main
und der
Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main
und der
WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf
und der
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;
Mitglied des Verwaltungsrates der
DekaBank Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A., Luxemburg;
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,
Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof
Vorsitzender des Vorstandes der
Ostsächsischen Sparkasse Dresden, Dresden

Jörg Münning
Vorsitzender des Vorstandes der
LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

Dr. Ulrich Neugebauer (stv. Vorsitzender)
Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,
Köln
und der
Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln
und der
Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

Jörg Boysen

Thomas Ketter
Mitglied der Geschäftsführung der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main

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

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squaire
Am Flughafen
60549 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Deutschland

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

Stand: 30. Juni 2019

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt am Main

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