

Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2018.
Sigma Plus Balanced

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.

.iDeka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

Juli 2018

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 2018 bis zum 30. Juni 2018.

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

Die Qualität deutscher Staatsanleihen war nach einem Renditeanstieg im Januar wieder gefragt. Die Rendite 10-jähriger Bundesanleihen sank von knapp 0,8 Prozent Anfang Februar auf zuletzt 0,3 Prozent. Vor dem Hintergrund der protektionistischen Stimmungslage in den USA und der Irritationen rund um die Regierungsbildung in Italien suchten Anleger vergleichsweise sichere Anlagen. Laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten in einem Umfeld guter Wirtschaftsdaten und moderater Zinserhöhungsschritte der US-Notenbank zuletzt bei knapp 2,9 Prozent.

An den Aktienmärkten setzte sich nach dem Jahreswechsel die kräftige Aufwärtsbewegung des Vorjahres zunächst fort. Befürchtungen vor einer frühzeitigen Straffung der Geldpolitik durch die großen Notenbanken ließen die Börsen jedoch bis Ende März in eine Korrekturphase abtauchen, von der sich die großen Indizes nicht mehr vollständig erholen konnten. Folglich verbuchten im Berichtszeitraum sowohl der Dow Jones Industrial in den USA als auch der Nikkei 225 in Japan sowie der DAX Verluste im einstelligen Prozentbereich.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Sigma Plus Balanced im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von minus 2,2 Prozent.

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

Mit freundlichen Grüßen

Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Stefan Keitel (Vorsitzender)



Thomas Ketter



Dr. Ulrich Neugebauer



Michael Schmidt



Thomas Schneider

Inhalt.

Anlagepolitik. Sigma Plus Balanced	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2018. Sigma Plus Balanced	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2018. Sigma Plus Balanced	7
Anhang. Sigma Plus Balanced	15
Informationen der Verwaltung.	17
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 merklich angehoben und betrug zum Stichtag 51,8 Prozent, wobei die Investitionen überwiegend in Euroland und den USA erfolgten. Zur partiellen Absicherung des Rentenportfolios wurden Zinsterminkontrakte im wirtschaftlichen Gegenwert von 14,9 Prozent des Fondsvermögens eingesetzt. Die Portfoliostruktur wurde im Verlauf signifikant verändert. Die größten Positionen auf der Renten- seite bildeten zuletzt Unternehmensanleihen, gefolgt von Anleihen halbstaatlicher Emittenten (z.B. Länderschatzanweisungen). Die Positionen in Staatsanleihen, besicherten Titeln und Rentenfonds wurden in der Berichtsperiode veräußert. Ein Teil der Unternehmensanleihen war mit besonderen Merkmalen ausgestattet (Bonitätsanleihen).

Der Aktienanteil in Wertpapieren lag zuletzt bei 41,0 Prozent und wurde ausschließlich durch Einzelwerte abgebildet. Im Fokus standen dabei die Anlageregionen Euroland und die USA. Die Branchengewichtungen ergaben sich implizit aus der Länderallokation und Einzelaktienauswahl. Durch Aktienindexfutures und -optionen wurde der Investitionsgrad in Aktien um 11,3 Prozentpunkte verringert. Die Wertpapierpositionen in Fremdwährung waren zum Stichtag überwiegend durch Devisentermingeschäfte währungskursgesichert.

Das Sondervermögen Sigma Plus Balanced verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von minus 2,2 Prozent.

Wichtige Kennzahlen

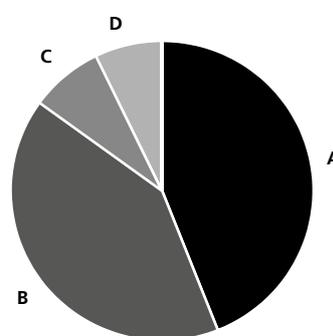
Sigma Plus Balanced

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Performance*	-2,2%	-0,2%	-0,2%
ISIN	DE0007019333		

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

Fondsstruktur

Sigma Plus Balanced



A	Festverzinsliche Anleihe	44,0%
B	Aktien	41,0%
C	Wertpapiere mit besonderer Ausstattung	7,8%
D	Barreserve, Sonstiges	7,2%

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 2018.

Gliederung nach Anlageart - Land	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	20.888.279,35	40,38
Australien	1.340.361,09	2,61
Dänemark	373.000,77	0,72
Deutschland	883.890,05	1,72
Finnland	111.552,76	0,22
Frankreich	755.859,03	1,45
Großbritannien	1.292.646,49	2,50
Irland	457.043,82	0,89
Italien	160.819,61	0,31
Japan	1.289.935,88	2,49
Kanada	675.589,63	1,30
Niederlande	569.509,84	1,10
Norwegen	109.297,78	0,21
Österreich	139.148,40	0,27
Schweden	99.117,14	0,19
Schweiz	365.040,14	0,71
Spanien	119.760,63	0,23
USA	12.145.706,29	23,46
2. Anleihen	26.519.048,32	51,19
Australien	1.185.535,98	2,29
Dänemark	359.108,75	0,69
Deutschland	3.797.605,25	7,32
Frankreich	3.029.796,26	5,85
Großbritannien	1.637.168,25	3,16
Irland	619.558,50	1,20
Kaiman-Inseln	255.386,40	0,49
Luxemburg	580.966,25	1,12
Mexiko	324.795,00	0,63
Neuseeland	256.575,93	0,50
Niederlande	1.647.642,38	3,18
Norwegen	201.509,00	0,39
Österreich	656.020,50	1,27
Panama	311.967,00	0,60
Schweden	3.192.154,00	6,16
Spanien	1.766.567,27	3,42
USA	6.696.691,60	12,92
3. Sonstige Wertpapiere	302.559,82	0,58
Schweiz	302.559,82	0,58
4. Derivate	-264.462,98	-0,52
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	3.654.716,76	7,03
6. Sonstige Vermögensgegenstände	746.132,49	1,44
II. Verbindlichkeiten	-50.978,59	-0,10
III. Fondsvermögen	51.795.295,17	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	20.888.279,35	40,38
AUD	1.340.361,09	2,61
CAD	675.589,63	1,30
CHF	365.040,14	0,71
DKK	373.000,77	0,72
EUR	2.423.269,69	4,69
GBP	1.412.407,12	2,73
JPY	1.289.935,88	2,49
NOK	109.297,78	0,21
SEK	99.117,14	0,19
USD	12.800.260,11	24,73
2. Anleihen	26.519.048,32	51,19
EUR	17.767.916,00	34,30
USD	8.751.132,32	16,89
3. Sonstige Wertpapiere	302.559,82	0,58
CHF	302.559,82	0,58
4. Derivate	-264.462,98	-0,52
5. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	3.654.716,76	7,03
6. Sonstige Vermögensgegenstände	746.132,49	1,44
II. Verbindlichkeiten	-50.978,59	-0,10
III. Fondsvermögen	51.795.295,17	100,00

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

Sigma Plus Balanced

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2018.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								40.920.164,41	79,03
Aktien								20.888.279,35	40,38
EUR								2.423.269,69	4,69
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		959	0	3.186	EUR 176,200	168.975,80	0,33
NL0011872643	ASR Nederland N.V. Aandelen op naam	STK		4.202	0	8.054	EUR 34,920	146.733,84	0,28
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur	STK		4.034	6.918	2.884	EUR 21,130	85.238,42	0,16
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien	STK		1.704	0	12.530	EUR 76,120	129.708,48	0,25
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK		1.345	0	4.742	EUR 93,860	126.241,70	0,24
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.	STK		19.315	0	243.704	EUR 4,763	91.997,35	0,18
AT0000652011	Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien	STK		3.876	0	2.202	EUR 35,900	139.148,40	0,27
NL0006294274	Euronext N.V. Aandelen an toonder	STK		2.197	0	7.050	EUR 54,200	119.077,40	0,23
NL0012059018	EXOR N.V. Aandelen aan toonder	STK		1.834	0	9.005	EUR 57,900	106.188,60	0,21
FR0000121147	Faurecia S.A. Actions Port.	STK		1.760	0	11.057	EUR 61,640	108.486,40	0,21
IT0001415246	Fincantieri S.p.A. Azioni nom.	STK		57.980	0	176.829	EUR 1,187	68.822,26	0,13
FI0009013296	Neste Oyj Reg.Shs	STK		1.661	0	1.954	EUR 67,160	111.552,76	0,22
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		2.565	0	7.092	EUR 69,350	177.882,75	0,34
DE000SHA0159	Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.	STK		11.602	0	17.693	EUR 11,100	128.782,20	0,25
DE000WAF3001	Siltronic AG Namens-Aktien	STK		1.249	0	3.010	EUR 123,000	153.627,00	0,30
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A. Actions Port.	STK		600	0	338	EUR 174,800	104.880,00	0,20
FR0000120271	Total S.A. Actions au Porteur	STK		2.909	2.909	17.536	EUR 52,640	153.129,76	0,30
DE000TUAG000	TUI AG Namens-Aktien	STK		7.596	0	22.147	EUR 18,850	143.184,60	0,28
DE000UNSE018	Uniper SE Namens-Aktien	STK		6.213	0	16.667	EUR 25,690	159.611,97	0,31
AUD								1.340.361,09	2,61
AU0000000ALL7	Aristocrat Leisure Ltd. Reg.Shares	STK		10.763	0	30.761	AUD 30,900	211.348,35	0,41
AU0000000BSL0	Bluescope Steel Ltd. Reg.Shares	STK		13.970	0	7.840	AUD 17,260	153.230,15	0,30
AU0000000CTX1	Caltex Australia Ltd. Reg.Shares	STK		10.426	0	12.679	AUD 32,540	215.596,80	0,42
AU0000000CPU5	Computershare Ltd. Reg.Shares	STK		17.296	21.229	17.514	AUD 18,430	202.571,36	0,39
AU0000000FMG4	Fortescue Metals Group Ltd. Reg.Shares	STK		64.341	0	301.837	AUD 4,390	179.497,89	0,35
AU0000000GNC9	GrainCorp Ltd. Reg.Shares	STK		16.931	26.432	9.501	AUD 7,680	82.632,49	0,16
AU0000000RHC8	Ramsay Health Care Ltd. Reg.Shares	STK		2.949	4.604	1.655	AUD 53,980	101.161,37	0,20
AU0000000WES1	Wesfarmers Ltd. Reg.Shares	STK		6.195	0	5.895	AUD 49,360	194.322,68	0,38
CAD								675.589,63	1,30
CA1360691010	Canadian Imperial Bk of Comm. Reg.Shares	STK		1.000	1.000	0	CAD 114,110	74.232,61	0,14
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK		300	0	700	CAD 1.014,190	197.930,00	0,38
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares	STK		3.400	0	3.000	CAD 98,820	218.572,14	0,42
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK		1.900	0	1.000	CAD 75,780	93.665,41	0,18
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK		1.600	0	3.900	CAD 87,610	91.189,47	0,18
CHF								365.040,14	0,71
CH0013841017	Lonza Group AG Namens-Aktien	STK		538	0	1.192	CHF 263,200	122.373,11	0,24
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		3.759	0	11.109	CHF 74,700	242.667,03	0,47
DKK								373.000,77	0,72
DK0010274414	Danske Bank AS Navne-Aktier	STK		6.212	0	8.414	DKK 200,200	166.882,59	0,32
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		2.118	0	1.216	DKK 296,050	84.140,78	0,16
DK0060634707	Royal Unibrew AS Navne-Aktier	STK		1.800	2.840	1.040	DKK 505,000	121.977,40	0,24
GBP								1.412.407,12	2,73
GB0002162385	Aviva PLC Reg.Shares	STK		24.573	24.573	35.511	GBP 5,040	139.740,62	0,27
GB0000811801	Barratt Developments PLC Reg.Shares	STK		26.288	26.288	0	GBP 5,172	153.408,71	0,30
GB0004544929	Imperial Brands PLC Reg.Shares	STK		4.969	4.969	0	GBP 28,395	159.200,65	0,31
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom.	STK		15.875	15.875	0	GBP 6,686	119.760,63	0,23
GB0032089863	NEXT PLC Reg.Shares	STK		1.955	1.955	0	GBP 60,780	134.073,03	0,26
GB0006825383	Persimmon PLC Reg.Shares	STK		5.979	0	7.045	GBP 25,380	171.219,85	0,33
GB00071188757	Rio Tinto PLC Reg.Shares	STK		3.025	3.025	0	GBP 42,265	144.258,10	0,28
GB000803MM408	Royal Dutch Shell Reg.Shares Cl.B	STK		3.897	3.897	0	GBP 27,400	120.479,99	0,23
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC Reg.Shares	STK		89.691	0	309.993	GBP 1,787	180.794,76	0,35
GB0001367019	The British Land Co. PLC Reg.Shares	STK		11.821	11.821	0	GBP 6,708	89.470,78	0,17
JPY								1.289.935,88	2,49
JP3768600003	Haseko Corp. Reg.Shares	STK		15.200	0	31.500	JPY 1.531,000	180.915,81	0,35
JP3788600009	Hitachi Ltd. Reg.Shares	STK		27.000	0	104.000	JPY 781,600	164.061,26	0,32
JP3210200006	Kajima Corp. Reg.Shares	STK		27.000	0	82.000	JPY 858,000	180.097,96	0,35
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares	STK		6.000	6.000	0	JPY 3.031,000	141.382,26	0,27
JP3718800000	Nippon Suisan Kaisha Ltd. Reg.Shares	STK		18.500	0	10.200	JPY 546,000	78.527,56	0,15
JP3165650007	NTT Docomo Inc. Reg.Shares	STK		4.900	4.900	6.600	JPY 2.822,500	107.519,63	0,21
JP3190000004	Obayashi Corp. Reg.Shares	STK		21.500	0	53.800	JPY 1.153,000	192.719,43	0,37
JP3595200001	Tosoh Corp. Reg.Shares	STK		12.900	0	46.300	JPY 1.717,000	172.193,89	0,33
JP3126190002	ULVAC Inc. Reg.Shares	STK		2.200	0	0	JPY 4.240,000	72.518,08	0,14
NOK								109.297,78	0,21
NO0003921009	DNO ASA Navne-Aksjer A	STK		67.780	67.780	0	NOK 15,280	109.297,78	0,21
SEK								99.117,14	0,19
SE0000115446	Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria)	STK		7.278	7.278	0	SEK 141,850	99.117,14	0,19
USD								12.800.260,11	24,73
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares	STK		2.734	0	2.500	USD 92,430	217.351,41	0,42
US00724F1012	Adobe Systems Inc. Reg.Shares	STK		1.200	1.200	0	USD 239,810	247.513,87	0,48
US0079731008	Advanced Energy Inds Inc. Reg.Shares	STK		2.800	0	1.600	USD 57,940	139.536,40	0,27
IE00BFRT3W74	Alliege PLC Reg.Shares	STK		2.900	0	3.600	USD 77,180	192.510,21	0,37
US0185811082	Alliance Data Systems Corp. Reg.Shares	STK		800	800	0	USD 235,560	162.084,89	0,31
US01973R1014	Allison Transmission Hldg.Inc. Reg.Shares	STK		3.500	3.500	0	USD 39,930	120.203,84	0,23
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		200	200	0	USD 1.126,780	193.829,61	0,37
US00164V1035	AMC Networks Inc. Reg.Shares A	STK		1.000	1.000	0	USD 63,220	54.375,78	0,10
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK		800	800	1.100	USD 183,340	126.153,18	0,24

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	1.600	1.600	0	USD 185,500	255.278,89	0,49
US04685W1036	athenahealth Inc. Reg.Shares		STK	800	800	0	USD 158,790	109.260,74	0,21
US0536111091	Avery Dennison Corp. Reg.Shares		STK	2.200	0	1.200	USD 100,640	190.433,92	0,37
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares		STK	11.900	0	39.400	USD 28,670	293.444,29	0,57
US0970231058	Boeing Co. Reg.Shares		STK	900	900	0	USD 334,650	259.050,45	0,50
US1011371077	Boston Scientific Corp. Reg.Shares		STK	6.800	0	3.800	USD 32,500	190.083,00	0,37
US1220171060	Burlington Stores Inc. Reg.Shares		STK	900	900	0	USD 151,980	117.646,76	0,23
US1270971039	Cabot Oil & Gas Corp. Reg.Shares		STK	7.300	7.300	0	USD 23,660	148.555,46	0,29
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares		STK	4.800	0	2.700	USD 43,100	177.938,33	0,34
US1344291091	Campbell Soup Co. Reg.Shares		STK	3.900	3.900	0	USD 40,750	136.692,04	0,26
US12504L1098	CBRE Group Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	4.100	0	5.400	USD 47,350	166.976,30	0,32
US12514G1085	CDW Corp. Reg.Shares		STK	1.300	1.300	0	USD 81,720	91.374,02	0,18
US1510201049	Celgene Corp. Reg.Shares		STK	2.700	1.700	500	USD 76,660	178.026,06	0,34
US15189T1079	CenterPoint Energy Inc. Reg.Shares		STK	6.200	6.200	0	USD 27,560	146.967,70	0,28
US1729674242	Citigroup Inc. Reg.Shares		STK	2.300	0	1.300	USD 66,880	132.304,65	0,26
US1746101054	Citizens Financial Group Inc. Reg.Shares		STK	5.400	5.400	0	USD 39,510	183.506,64	0,35
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares Cl.A		STK	8.100	8.100	0	USD 32,630	227.328,09	0,44
US2003401070	Comerica Inc. Reg.Shares		STK	2.000	2.000	0	USD 91,340	157.123,81	0,30
US20825C1045	ConocoPhillips Reg.Shares		STK	3.900	3.900	0	USD 68,410	229.474,91	0,44
US2166484020	Cooper Companies Inc. Reg.Shares		STK	1.000	1.500	500	USD 234,790	201.943,84	0,39
US2283681060	Crown Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.916	0	1.600	USD 44,550	111.734,23	0,22
US2435371073	Deckers Outdoor Corp. Reg.Shares		STK	900	900	0	USD 116,010	89.802,61	0,17
US2774321002	Eastman Chemical Co. Reg.Shares		STK	2.100	0	2.700	USD 99,700	180.079,99	0,35
US30219G1085	Express Scripts Holding Inc. Reg.Shares		STK	3.100	3.100	0	USD 77,620	206.959,96	0,40
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares		STK	2.700	2.700	0	USD 81,970	190.357,37	0,37
US30303M1027	Facebook Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	800	800	0	USD 196,230	135.022,58	0,26
US3142111034	Federated Investors Inc. Reg.Shares Cl.B		STK	5.800	0	3.200	USD 23,240	115.935,15	0,22
US3167731005	Fifth Third Bancorp Reg.Shares		STK	6.500	6.500	0	USD 28,740	160.676,04	0,31
US3377381088	Fiserv Inc. Reg.Shares		STK	1.900	1.900	2.300	USD 73,930	120.816,24	0,23
US34959E1091	Fortinet Inc. Reg.Shares		STK	2.300	2.300	0	USD 62,450	123.541,05	0,24
US4198791018	Hawaiian Holdings Inc. Reg.Shares		STK	3.100	0	1.700	USD 36,050	96.120,93	0,19
US40416M1053	HD Supply Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.200	2.200	0	USD 43,120	81.592,91	0,16
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares		STK	3.300	3.300	0	USD 49,250	139.788,41	0,27
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	2.000	2.000	0	USD 104,930	180.501,44	0,35
US4943681035	Kimberly-Clark Corp. Reg.Shares		STK	1.700	1.700	0	USD 104,530	152.841,35	0,30
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares		STK	800	0	500	USD 170,870	117.572,79	0,23
US5218652049	Lear Corp. Reg.Shares		STK	1.100	2.300	3.100	USD 188,550	178.389,89	0,34
US5261071071	Lennox International Inc. Reg.Shares		STK	800	0	400	USD 193,890	133.412,46	0,26
NL0009434992	Lyonellbasell Industries NV Reg.Shares A		STK	2.100	2.100	0	USD 109,350	197.510,00	0,38
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares		STK	4.300	0	2.400	USD 37,140	137.360,34	0,27
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A		STK	600	600	0	USD 197,100	101.715,91	0,20
US58155Q1031	McKesson Corp. Reg.Shares		STK	1.100	1.100	0	USD 135,800	128.482,35	0,25
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	200	200	0	USD 572,680	98.512,88	0,19
US5951121038	Micron Technology Inc. Reg.Shares		STK	4.500	0	12.900	USD 53,140	205.676,69	0,40
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	1.500	1.500	0	USD 98,630	127.248,10	0,25
US6512901082	Newfield Exploration Co. Reg.Shares		STK	4.700	4.700	0	USD 30,300	122.487,42	0,24
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc. Reg.Shares		STK	800	800	0	USD 149,900	103.143,68	0,20
US6821891057	ON Semiconductor Corp. Reg.Shares		STK	6.000	6.000	0	USD 22,280	114.978,71	0,22
US6937181088	Paccar Inc. Reg.Shares		STK	2.300	2.300	0	USD 62,040	122.729,97	0,24
IE00BGH1M568	Perrigo Co. PLC Reg.Shares		STK	1.200	1.200	0	USD 73,130	75.479,29	0,15
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares		STK	9.600	9.600	0	USD 36,360	300.224,49	0,58
US7591EP1005	Regions Financial Corp. Reg.Shares		STK	6.500	6.500	0	USD 17,990	100.576,27	0,19
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares		STK	1.300	1.300	0	USD 203,690	227.752,98	0,44
IE00B58JVZ52	Seagate Technology PLC Reg.Shares		STK	3.900	3.900	0	USD 56,360	189.054,32	0,37
US8243481061	Sherwin-Williams Co. Reg.Shares		STK	500	0	500	USD 404,870	174.115,17	0,34
US8454671095	Southwestern Energy Co. Reg.Shares		STK	24.800	24.800	0	USD 5,350	114.118,61	0,22
US8807701029	Teradyne Inc. Reg.Shares		STK	4.500	4.500	0	USD 37,670	145.800,54	0,28
US8807791038	Terex Corp. Reg.Shares		STK	2.400	2.400	0	USD 41,120	84.881,95	0,16
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares		STK	1.800	1.800	0	USD 91,350	141.426,91	0,27
US1689051076	The Children's Place Inc. Reg.Shares		STK	1.700	0	4.500	USD 124,600	182.187,24	0,35
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares		STK	1.800	1.800	0	USD 94,180	145.808,28	0,28
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	1.100	0	600	USD 195,210	184.691,01	0,36
US8894781033	Toll Brothers Inc. Reg.Shares		STK	3.400	3.400	0	USD 36,460	106.621,94	0,21
US8919061098	Total System Services Inc. Reg.Shares		STK	2.400	2.400	0	USD 84,270	173.954,33	0,34
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A		STK	3.500	0	13.000	USD 69,260	208.497,83	0,40
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares		STK	600	0	2.200	USD 147,470	76.103,73	0,15
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	700	700	0	USD 244,900	147.447,64	0,28
US92343E1029	Verisign Inc. Reg.Shares		STK	1.700	0	2.500	USD 137,650	201.268,65	0,39
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares Cl.A ¹⁾		STK	2.100	2.100	0	USD 132,740	239.757,45	0,46
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc. Reg.Shares		STK	3.400	3.400	0	USD 59,700	174.583,92	0,34
US94946T1060	WellCare Health Plans Inc. Reg.Shares		STK	400	400	0	USD 245,380	84.420,93	0,16
US9581021055	Western Digital Corp. Reg.Shares		STK	2.800	4.100	3.000	USD 76,930	185.269,86	0,36
US98310W1080	Wyndham Destinations Inc. Reg.Shares		STK	3.000	3.000	0	USD 44,280	114.256,23	0,22

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteil bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Verzinsliche Wertpapiere								19.729.325,24	38,07
EUR								14.059.729,50	27,13
FR0011076439	4,0000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 11/21	EUR		300.000	0	0	% 111,959	335.875,50	0,65
FR0010870949	4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20	EUR		300.000	0	0	% 108,031	324.093,00	0,63
XS0802174044	3,0000 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 12/21 ¹⁾	EUR		300.000	0	0	% 108,265	324.795,00	0,63
XS0789283792	2,7500 % Anglo American Capital PLC MTN 12/19	EUR		250.000	250.000	0	% 102,555	256.386,25	0,49
XS1205616268	1,3750 % APT Pipelines Ltd. MTN 15/22	EUR		300.000	0	0	% 103,088	309.262,50	0,60
XS0953783239	2,3750 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 13/20	EUR		300.000	0	0	% 104,905	314.713,50	0,61
FR0010957662	3,6410 % Bouygues S.A. Obl. 10/19	EUR		450.000	450.000	0	% 104,830	471.732,75	0,91
XS0800572454	2,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 12/19	EUR		350.000	350.000	0	% 102,603	359.108,75	0,69
XS1232146412	0,7500 % Caterpillar Intl Finance Ltd. MTN 15/20	EUR		300.000	0	0	% 101,989	305.965,50	0,59
XS0944362812	2,3750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 13/20	EUR		300.000	0	0	% 104,238	312.712,50	0,60
XS1198115898	0,5000 % Essity AB MTN 15/20	EUR		500.000	500.000	0	% 100,814	504.070,00	0,97
FR0011660596	2,6250 % Eutelsat S.A. Bonds 13/20	EUR		300.000	0	0	% 103,172	309.516,00	0,60
XS0482908091	4,7500 % Experian Finance PLC MTN 10/20	EUR		450.000	450.000	0	% 107,760	484.917,75	0,94
XS0723509104	5,2500 % FMC Finance VIII S.A. Notes 12/19 Reg.S	EUR		250.000	250.000	0	% 105,679	264.196,25	0,51
DE000A135JM6	0,8750 % Freistaat Thüringen Landessch. S.2014/02 14/24	EUR		3.000.000	0	0	% 103,968	3.119.040,00	6,01
XS0829360923	6,0000 % Gas Natural CM S.A. MTN 12/20	EUR		300.000	0	0	% 109,459	328.377,00	0,63
XS0834382151	2,7500 % Hammerson PLC Bonds 12/19	EUR		250.000	250.000	0	% 103,312	258.278,75	0,50
XS0875513268	2,3750 % Hella GmbH & Co. KGaA Anl. 13/20	EUR		350.000	350.000	0	% 103,713	362.993,75	0,70
XS1379182006	1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22	EUR		300.000	0	0	% 103,268	309.802,50	0,60
XS1191116174	1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22 ¹⁾	EUR		300.000	0	0	% 105,191	315.571,50	0,61
FR0011535764	2,5000 % Kering S.A. MTN 13/20	EUR		300.000	0	0	% 105,210	315.630,00	0,61
FR0011625441	1,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 13/20	EUR		300.000	0	0	% 104,274	312.820,50	0,60
XS0690406243	4,2500 % OMV AG MTN 11/21	EUR		300.000	0	0	% 113,653	340.959,00	0,66
XS0841018004	2,8750 % Origin Energy Finance Ltd. MTN 12/19	EUR		300.000	0	0	% 103,634	310.902,00	0,60
FR0011798115	2,0000 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 14/20	EUR		300.000	0	0	% 104,047	312.141,00	0,60
XS0976892611	3,2500 % Rentokil Initial PLC MTN 13/21	EUR		300.000	0	0	% 109,261	327.783,00	0,63
XS0933604943	2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 13/20	EUR		300.000	0	0	% 104,897	314.689,50	0,61
XS0827529198	1,8750 % SKF AB Notes 12/19	EUR		350.000	350.000	0	% 102,301	358.051,75	0,69
XS0592627003	4,2500 % Telia Company AB MTN 11/20 ¹⁾	EUR		450.000	450.000	0	% 107,053	481.736,25	0,93
XS0957258212	1,7500 % Unilever N.V. MTN 13/20	EUR		100.000	0	0	% 103,942	103.942,00	0,20
XS0439828269	4,7500 % Verbund AG MTN 09/19	EUR		300.000	0	0	% 105,021	315.061,50	0,61
FR0010830034	4,8750 % Vivendi S.A. MTN 09/19	EUR		350.000	350.000	0	% 106,932	374.260,25	0,72
XS0858089740	2,3750 % Volvo Treasury AB MTN 12/19	EUR		500.000	500.000	0	% 103,395	516.972,50	1,00
DE000A1HNW52	3,1250 % Vonovia Finance B.V. Anl. 13/19	EUR		100.000	100.000	0	% 103,372	103.371,50	0,20
USD								5.669.595,74	10,94
US002824AW02	4,1250 % Abbott Laboratories Notes 10/20	USD		550.000	0	0	% 102,086	482.925,21	0,93
US00182EAV11	2,6000 % ANZ New Zealand (Iti)(Ldn Br.) MTN 14/19 144A	USD		300.000	0	0	% 99,436	256.575,93	0,50
US15089QAC87	5,8750 % Celanese US Holdings LLC Notes 11/21	USD		300.000	0	0	% 105,838	273.095,08	0,53
US172967FF30	5,3750 % Citigroup Inc. Notes 10/20	USD		850.000	0	0	% 104,214	761.896,53	1,47
US361448AN33	4,7500 % GATX Corp. Notes 12/22	USD		300.000	0	0	% 103,637	267.415,82	0,52
US472319AF91	8,5000 % Jefferies Group LLC Notes 09/19	USD		300.000	0	0	% 105,215	271.487,55	0,52
US46625HJD35	4,5000 % JPMorgan Chase & Co. Notes 12/22	USD		550.000	0	0	% 103,636	490.257,60	0,95
US615369AA32	5,5000 % Moody's Corp. Notes 10/20	USD		300.000	0	0	% 104,825	270.481,23	0,52
US61747YCM57	5,5000 % Morgan Stanley MTN S.F 10/20	USD		550.000	0	0	% 103,776	490.919,88	0,95
US61744YAH18	2,7500 % Morgan Stanley Notes 17/22	USD		300.000	0	0	% 97,094	250.534,12	0,48
US824348AU08	2,7500 % Sherwin-Williams Co. Notes 17/22	USD		300.000	0	0	% 96,801	249.776,80	0,48
US84265VAD73	5,3750 % Southern Copper Corp. Notes 10/20	USD		300.000	0	0	% 103,586	267.284,22	0,52
US38141GG575	5,7500 % The Goldman Sachs Group Inc. Notes 12/22	USD		800.000	0	0	% 107,244	737.924,57	1,42
US887317AF27	4,8750 % Time Warner Inc. Notes 10/20	USD		300.000	0	0	% 102,728	265.070,31	0,51
US98310WAI71	4,2500 % Wyndham Destinations Inc. Notes 12/22	USD		400.000	0	0	% 97,067	333.950,89	0,64
Sonstige Beteiligungswertpapiere								302.559,82	0,58
CHF								302.559,82	0,58
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK		1.599	461	3.170	CHF 218,950	302.559,82	0,58
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								6.135.216,68	11,86
Verzinsliche Wertpapiere								6.135.216,68	11,86
EUR								3.309.066,50	6,40
ES0211845252	4,7500 % Abertis Infraestructuras S.A. Obl. 12/19	EUR		300.000	300.000	0	% 106,210	318.630,00	0,62
ES0313679380	1,7500 % Bankinter S.A. Bonos 14/19 ¹⁾	EUR		300.000	0	0	% 101,599	304.795,50	0,59
XS1319820624	1,6250 % Carnival Corp. Notes 16/21	EUR		300.000	0	0	% 103,989	311.967,00	0,60
XS1117297942	0,6880 % Geberit International B.V. Notes 15/21	EUR		300.000	0	0	% 101,831	305.493,00	0,59
XS1238991480	2,0000 % Harman Finance Intern. S.C.A. Notes 15/22	EUR		300.000	0	0	% 105,590	316.770,00	0,61
XS11137512668	1,5000 % Mölnlycke Holding AB Notes 14/22	EUR		300.000	0	0	% 103,433	310.297,50	0,60
XS1082660744	2,5000 % ORLEN Capital AB Notes 14/21	EUR		300.000	0	0	% 106,042	318.126,00	0,61
XS1082661551	1,3750 % PZU Finance AB Notes 14/19	EUR		300.000	0	0	% 101,260	303.780,00	0,59
XS1077584024	1,8750 % Ryanair DAC MTN 14/21	EUR		300.000	0	0	% 104,531	313.593,00	0,61
XS1369254310	1,0000 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19 ¹⁾	EUR		200.000	0	0	% 100,755	201.509,00	0,39
XS1188117391	0,9000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20	EUR		300.000	0	0	% 101,369	304.105,50	0,59

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
USD								2.826.150,18	5,46
US03027XAH35	3,3000 % American Tower Corp. Notes 16/21		USD	300.000	0	0	% 99,768	257.432,59	0,50
US05946KAD37	3,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. Notes 15/20		USD	600.000	0	0	% 98,953	510.659,27	0,99
US44987CAN83	2,3000 % ING Bank N.V. MTN 16/19 144A		USD	400.000	0	0	% 99,649	342.835,76	0,66
US449786BJ07	2,0500 % ING Bank N.V. Notes 16/21 144A		USD	200.000	0	0	% 95,685	164.598,12	0,32
US67066GAD60	2,2000 % NVIDIA Corp. Notes 16/21		USD	300.000	0	0	% 97,206	250.820,54	0,48
US714264AA62	5,7500 % Pernod-Ricard S.A. Notes 11/21 144A		USD	300.000	0	0	% 106,083	273.727,26	0,53
US74834LAU44	2,7000 % Quest Diagnostics Inc. Notes 14/19		USD	300.000	0	0	% 99,923	257.831,25	0,50
US761713BE57	3,2500 % Reynolds American Inc. Notes 15/20		USD	300.000	0	0	% 99,844	257.628,69	0,50
US761713BF23	4,0000 % Reynolds American Inc. Notes 15/22		USD	300.000	0	0	% 100,747	259.958,72	0,50
US8672EMAG91	2,8000 % Suncorp-Metway Ltd. MTN 17/22 144A		USD	300.000	0	0	% 97,143	250.657,98	0,48
Nichtnotierte Wertpapiere								654.506,40	1,26
Verzinsliche Wertpapiere								654.506,40	1,26
EUR								399.120,00	0,77
XS1821532493	0,0200 % Toyota Industries Fin. Intl AB MTN 18/21		EUR	400.000	400.000	0	% 99,780	399.120,00	0,77
USD								255.386,40	0,49
US81180WAV37	4,2500 % Seagate HDD Cayman Notes 17/22		USD	300.000	300.000	0	% 98,975	255.386,40	0,49
Summe Wertpapiervermögen²⁾								EUR 47.709.887,49	92,15
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere									
Wertpapier-Optionsrechte								-328,85	-0,00
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Optionsrechte auf Aktien									
FLEX E.ON SE (EOAN) Put Aug. 18 6,63		XEUR	STK	-74.300			EUR 0,004	-328,85	-0,00
Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere								EUR -328,85	-0,00
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								129.544,15	0,24
AEX Future (AEX) Juli 18		XAMS	EUR	Anzahl 1				-1.950,00	-0,00
CAC 40-Index Future (FCE) Juli 18		XPAR	EUR	Anzahl -17				21.590,00	0,04
DAX-Index Future (FDAX) Sep. 18		XEUR	EUR	Anzahl 2				-26.878,13	-0,05
DJ Euro Stoxx 50 Future (SX5E) Sep. 18		XEUR	EUR	Anzahl -22				15.120,61	0,03
FTSE 100 Index Future (FIF) Sep. 18		IFEU	GBP	Anzahl -3				778,54	0,00
FTSE MIB INDEX Future (IFS) Sep. 18		XMIL	EUR	Anzahl -3				5.475,00	0,01
OMX Index Future (O30) Juli 18		XNDX	SEK	Anzahl -7				1.612,93	0,00
OMXC25 Index Future (OMWV) Juli 18		XNDX	DKK	Anzahl -22				7.573,21	0,01
S&P 500 ST Future (SP) Sep. 18		XIOM	USD	Anzahl -7				101.675,05	0,20
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 18		XMOD	CAD	Anzahl -1				150,92	0,00
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 18		XSFE	AUD	Anzahl -3				-8.483,76	-0,02
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 18		XEUR	CHF	Anzahl -2				985,20	0,00
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 18		XOSE	JPY	Anzahl -3				11.894,58	0,02
Optionsrechte								-46.544,38	-0,09
Optionsrechte auf Aktienindices								-46.544,38	-0,09
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Call Juli 18 3.575		XEUR		Anzahl -92			EUR 1,400	-1.288,00	-0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Dez. 18 2.850		XEUR		Anzahl -33			EUR 37,100	-12.243,00	-0,02
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juli 18 2.900		XEUR		Anzahl 161			EUR 1,100	1.771,00	0,00
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Juli 18 3.250		XEUR		Anzahl -184			EUR 13,500	-24.840,00	-0,05
DJ Euro Stoxx50 Index (SX5E) Put Sep. 18 2.850		XEUR		Anzahl -35			EUR 14,700	-5.145,00	-0,01
Russell 2000 Index (RTY) Put Dez. 18 1.150		XCBO		Anzahl -9			USD 6,200	-4.799,38	-0,01
Summe Aktienindex-Derivate								EUR 82.999,77	0,15
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								1.532,28	0,00
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 18		XEUR	EUR	-2.600.000				-14.556,86	-0,03
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 18		XEUR	EUR	800.000				11.840,00	0,02
EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 18		XEUR	EUR	-4.500.000				-3.375,00	-0,01
EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 18		XEUR	EUR	500.000				-5.300,00	-0,01
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 18		XCBT	USD	-600.000				-2.136,83	-0,00
Long Gilt Future (FLG) Sep. 18		IFEU	GBP	200.000				2.121,25	0,00
Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep. 18		XEUR	EUR	700.000				10.010,00	0,02
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 18		XCBT	USD	600.000				4.434,91	0,01
Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 18		XCBT	USD	-2.800.000				-1.505,19	-0,00
Summe Zins-Derivate								EUR 1.532,28	0,00
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								-348.666,18	-0,67
Offene Positionen									
AUD/EUR 2.100.000,00		OTC						18.181,51	0,04
CAD/EUR 1.300.000,00		OTC						1.341,33	0,00
CHF/EUR 800.000,00		OTC						-3.392,80	-0,01

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
GBP/EUR 1.350.000,00		OTC						7.776,13	0,02	
JPY/EUR 220.000.000,00		OTC						-15.868,28	-0,03	
SEK/EUR 1.100.000,00		OTC						2.004,49	0,00	
USD/EUR 25.000.000,00		OTC						-358.708,56	-0,69	
Summe Devisen-Derivate							EUR	-348.666,18	-0,67	
Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds										
Bankguthaben										
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle										
DekaBank Deutsche Girozentrale			EUR	1.952.966,97			%	100,000	1.952.966,97	3,76
EUR-Guthaben bei										
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	33.348,99			%	100,000	33.348,99	0,06
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			DKK	351.999,38			%	100,000	47.234,29	0,09
DekaBank Deutsche Girozentrale			GBP	111.399,17			%	100,000	125.694,39	0,24
DekaBank Deutsche Girozentrale			NOK	10.115,17			%	100,000	1.067,48	0,00
DekaBank Deutsche Girozentrale			SEK	162.084,40			%	100,000	15.561,40	0,03
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DekaBank Deutsche Girozentrale			AUD	684.765,64			%	100,000	435.160,03	0,84
DekaBank Deutsche Girozentrale			CAD	320.435,99			%	100,000	208.455,00	0,40
DekaBank Deutsche Girozentrale			CHF	73.399,83			%	100,000	63.432,66	0,12
DekaBank Deutsche Girozentrale			HKD	39.598,87			%	100,000	4.339,44	0,01
DekaBank Deutsche Girozentrale			JPY	58.762.195,00			%	100,000	456.831,18	0,88
DekaBank Deutsche Girozentrale			USD	361.148,07			%	100,000	310.624,93	0,60
Summe Bankguthaben							EUR	3.654.716,76	7,03	
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahen Fonds										
							EUR	3.654.716,76	7,03	
Sonstige Vermögensgegenstände										
Zinsansprüche			EUR	323.391,63				323.391,63	0,62	
Dividendenansprüche			EUR	50.434,57				50.434,57	0,10	
Forderungen aus Wertpapier-Darlehen			EUR	153,76				153,76	0,00	
Forderungen aus Anteilscheingeschäften			EUR	1.792,93				1.792,93	0,00	
Forderungen aus Quellensteuerrückerstattung			EUR	40.359,60				40.359,60	0,08	
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	330.000,00				330.000,00	0,64	
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	746.132,49	1,44	
Sonstige Verbindlichkeiten										
Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen			EUR	-75,33				-75,33	-0,00	
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-9.008,38				-9.008,38	-0,02	
Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten			EUR	-41.894,88				-41.894,88	-0,08	
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-50.978,59	-0,10	
Fondsvermögen										
Umlaufende Anteile							EUR	51.795.295,17	100,00	
Anteilwert							STK	1.183.772		
							EUR	43,75		

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

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

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Nominal in Währung	Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR		
		befristet	unbefristet	gesamt
Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen (besichert)				
Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen:				
VISA Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	2.100		239.757,45
3,0000 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 12/21	EUR	77.000		83.364,05
1,7500 % Bankinter S.A. Bonos 14/19	EUR	300.000		304.795,50
1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22	EUR	300.000		315.571,50
1,0000 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19	EUR	200.000		201.509,00
4,2500 % Telia Company AB MTN 11/20	EUR	190.000		203.399,75
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		1.348.397,25	1.348.397,25

Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 3.119.040,00

Sigma Plus Balanced

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.06.2018

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88627	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45220	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,47575	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	10,41580	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,15713	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,16265	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,53720	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	128,63000	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	9,12535	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,57360	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XSFE	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XPAR	Paris - Euronext Paris - Derivatives
XMIL	Mailand - Borsa Italiana
XAMS	Amsterdam - Euronext Amsterdam - Derivatives
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XIOM	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Option Market (IOM)
XCBO	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
XMOT	Montreal - Montreal Exchange (ME) - Futures and Options
XNDX	Stockholm - Nasdaq Stockholm - Derivatives

OTC Over-the-Counter

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
AUD				
AU000000AMC4	Amcor Ltd. Reg.Shares	STK	0	41.991
AU000000CBA7	Commonwealth Bank of Australia Reg.Shares	STK	0	5.565
CAD				
CA39945C1095	CGI Group Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK	0	3.400
CA4495861060	IGM Financial Inc. Reg.Shares	STK	0	5.800
CA59162N1096	Metro Inc. Reg.Shares	STK	0	5.900
CA73927C1005	Power Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	8.000
CHF				
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK	0	1.953
CH0024638212	Schindler Holding AG Namens-Aktien	STK	0	1.163
DKK				
DK0010268606	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier	STK	0	11.177
EUR				
NL0011540547	ABN AMRO Group N.V. Aand.op naam Dep.Rec	STK	0	32.170
BE0974264930	AGEAS SA/NV Actions Nominatives	STK	0	5.014
FR0000031122	Air France-KLM S.A. Actions Port.	STK	0	81.676
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam	STK	681	681
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK	0	22.320
DE0008AY0017	Bayer AG Namens-Aktien	STK	0	5.520
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien	STK	0	1.513
ES0140609019	Caixabank S.A. Acciones Port.	STK	42.243	42.243
FR0000125338	Capgemini SE Actions Port.	STK	0	10.544
DE0005439004	Continental AG Inhaber-Aktien	STK	0	2.977
FR0000045072	Crédit Agricole S.A. Actions Port.	STK	0	44.007
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien	STK	0	14.306
ES0126775032	Distribuidora Intl de Alim.SA Acciones Port.	STK	0	132.106
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port.	STK	0	12.914
IE0000669501	Glanbia PLC Reg.Shares	STK	0	8.418
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK	0	2.425
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom.	STK	0	58.362
IT0003027817	Iren S.p.A. Azioni nom.	STK	0	146.278
BE0003565737	KBC Groep N.V. Parts Sociales au Port.	STK	0	3.273
IE0004906560	Kerry Group PLC Reg.Shares A	STK	0	3.513
FR0000121964	Klépierre S.A. Actions Port.	STK	0	6.442
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom.	STK	0	122.127
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK	0	4.578
FR0000121501	Peugeot S.A. Actions Port.(C.R.)	STK	0	61.745
NL0006144495	Relx N.V. Aandelen op naam	STK	0	40.876
FR0000131906	Renault S.A. Actions Port.	STK	0	10.990
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK	1.045	41.801
DE0007037129	RWE AG Inhaber-Stammaktien	STK	0	36.721
FR0000130809	Société Générale S.A. Actions Port.	STK	0	9.933

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A. Azioni Port.Risp.Non Cnv.	STK	0	593.533
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom.	STK	0	55.278
NL0000009355	Unilever N.V. Cert.v.Aand.	STK	0	11.270
IT0004810054	Unipol Gruppo S.p.A. Azioni nom.	STK	0	74.062
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK	0	4.252
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien	STK	0	7.324
GBP				
GB0030913577	BT Group PLC Reg.Shares	STK	27.094	27.094
JPY				
JP3499800005	Mitsubish.UFJ Lease&Fin.Co.Ltd Reg.Shares	STK	0	35.000
JP3888250002	Modec Inc. Reg.Shares	STK	0	6.600
JP3758190007	Nexon Co. Ltd Reg.Shares	STK	0	9.600
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares	STK	0	7.660
JP3594200002	Toshiba Plant Sys & Svcs Corp. Reg.Shares	STK	0	12.600
SEK				
SE0000379190	Castellum AB Namn-Aktier	STK	0	15.404
USD				
US0258161092	American Express Co. Reg.Shares	STK	4.400	4.400
US29272W1099	Energizer Holdings Inc. Reg.Shares	STK	1.000	1.000
BMG3223R1088	Everest Reinsurance Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.100
US3448491049	Foot Locker Inc. Reg.Shares	STK	0	7.800
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares	STK	0	5.700
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares	STK	600	600
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares	STK	1.700	1.700
GB00BFBMBT84	Sensata Technologies HLDG PLC Reg.Shares	STK	1.200	1.200
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc. Reg.Shares	STK	0	1.800
US91529Y1064	UNUM Group Reg.Shares	STK	1.800	1.800
US92210H1059	Vantiv Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	4.000
US9311421039	Walmart Inc. Reg.Shares	STK	0	5.400
US9815581098	Worldpay Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	4.000	4.000
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE000A0Z1UH6	0,7500 % Bayerische Landesbodenkreditanstalt IHS 15/25	EUR	0	2.000.000
DE000A11P8T2	0,5000 % Land Saarland Landesschatz. R.3 16/26	EUR	0	1.000.000
DE000MHB2259	0,0000 % Münchener Hyp.Bank FLR MTN Hyp.-Pfe. R.1651 14/19	EUR	0	1.000.000
DE000NWB0584	0,5000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.058 16/26	EUR	0	3.000.000
GBP				
GB0030880693	5,0000 % Großbritannien Treasury Stock 01/25	GBP	0	1.500.000
GB00BHFH458	2,7500 % Großbritannien Treasury Stock 14/24	GBP	0	3.000.000
Andere Wertpapiere				
EUR				
ES06735169B1	Repsol S.A. Anrechte	STK	0	40.756
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
USD				
US81180WAU53	4,2500 % Seagate HDD Cayman Notes 17/22 144A	USD	0	300.000
US912828B667	2,7500 % U.S. Treasury Notes 14/24	USD	0	1.000.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
DKK				
DK0060228559	TDC A/S Navne-Aktier	STK	54.680	54.680
USD				
NL0009324904	Sensata Technologies Hldg N.V.Aandelen aan toonder	STK	1.200	1.200
Wertpapier-Investmentanteile				
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile				
EUR				
DE000ETFL375	Deka iBoxx EUR Liquid Corporates Diversified UCITS ETF	ANT	0	23.500
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
USD				
IE0032895942	iShs DL Corp Bond UCITS ETF Reg.Shares	ANT	0	15.200

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	6.066
(Basiswert(e): Amsterdam EXchanges (AEX) Index, DAX Performance-Index, FTSE 100 Index, OMX Copenhagen 25 Index (Price) (DKK) (OMXC25), S&P 500 Index)		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	27.702
(Basiswert(e): CAC 40 INDEX, EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, FTSE MIB 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))		

Sigma Plus Balanced

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 10 Year Euro Spanish Bonos (10,0), 10 Year US Treasury Notes (10,0), 2 Year US Treasury Notes (2,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bund (10,0), EuroBTP Italian Gov. (10,0), EuroOAT French Gov. Bond (10,0), Long Gilt (10,0))	EUR	7.254
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 2 Year US Treasury Notes (2,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Bobl (5,5), Euro Schatz (2,0))	EUR	33.861
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	14.078
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	9.573
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 Index)	EUR	17.649
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	7.712
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))	EUR	12.832
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	1.205
CAD/EUR	EUR	1.216
CHF/EUR	EUR	650
GBP/EUR	EUR	1.465
JPY/EUR	EUR	2.690
SEK/EUR	EUR	94
USD/EUR	EUR	20.917
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	1.238
CAD/EUR	EUR	2.839
CHF/EUR	EUR	3.486
GBP/EUR	EUR	10.027
JPY/EUR	EUR	7.561
SEK/EUR	EUR	413
USD/EUR	EUR	44.355
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet (Basiswert(e): 1,0000 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19, 1,3750 % PZU Finance AB Notes 14/19, 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, 2,5000 % ORLEN Capital AB Notes 14/21, 2,6250 % Eutelsat S.A. Bonds 13/20, 2,7500 % U.S. Treasury Notes 14/24, 4,2500 % OMV AG MTN 11/21, 4,2500 % Telia Company AB MTN 11/20, 4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20, Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A, ASML Holding N.V. Aandelen op naam, Castellum AB Namn-Aktier, Distribuidora Intl de Alim.SA Acciones Port., Iren S.p.A. Azioni nom., Micron Technology Inc. Reg.Shares, Telecom Italia S.p.A. Azioni Port.Risp.Non Cnv., Unipol Gruppo S.p.A. Azioni nom.)	EUR	5.616

Sigma Plus Balanced

Anhang.

Umlaufende Anteile
Anteilwert

STK 1.183.772
EUR 43,75

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, Einlagenzertifikaten und ausstehenden Forderungen, Bardividenden und Zinsansprüchen entspricht grundsätzlich dem jeweiligen nominalen Betrag.

Derivate

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

Sonstiges

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

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

Verwendete Vermögensgegenstände

Wertpapier-Darlehen (besichert)

	Marktwert in EUR	in % des Fondsvermögens
Aktien	239.757,45	0,46
Verzinsliche Wertpapiere	1.108.639,80	2,14

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	1.348.397,25	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	1.348.397,25

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	2.854.587,10

Sigma Plus Balanced

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

	absolute Beträge in EUR	in % der Bruttoerträge des Fonds
Ertragsanteil des Fonds	1.144,72	100,00
Kostenanteil des Fonds	560,93	49,00
Ertragsanteil der KVG	560,93	49,00

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.

Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

2,83% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds")

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

Wertpapier-Darlehen

	absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR
Apple Inc.	1.013.103,01
Nordrhein-Westfalen, Land	607.923,12
Vodafone Group PLC	411.145,04
Berlin, Land	304.820,84
Danone S.A.	302.132,68
LfA Förderbank Bayern	215.462,41

Wiedergelegte 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	1.128.206,37 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
J.P.Morgan AG Frankfurt	1.726.380,73 EUR (absolut/verwahrter Betrag)

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

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten/Depots	0,00%
Sammelkonten/Depots	0,00%
andere Konten/Depots	0,00%
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 2. Juli 2018
Deka Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Informationen der Verwaltung.

Das DekaBank Depot – Service rund um Ihre Investmentfonds –

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

- Für Investmentfonds-Anleger, die regelmäßig sparen möchten, eignet sich der individuell zu gestaltende Deka-FondsSparplan ab einer Mindestanlage von 25,- Euro. Im Rahmen eines auf die eigenen Bedürfnisse abgestimmten Deka-Auszahlplans lässt sich das so aufgebaute Vermögen später gezielt nutzen.
- Für alle, die regelmäßig für ein Kind sparen möchten, ist der Deka-JuniorPlan besonders geeignet. Mit Beträgen ab monatlich 25,- Euro wird für den Vermögensaufbau chancenreich und breit gestreut in Investmentfonds angelegt und dank eines professionellen Anlagemanagements langfristig hohe Ertragsmöglichkeiten genutzt sowie Risiken im Vergleich zu Anlagen in Einzeltiteln spürbar reduziert.
- Für den systematischen und flexiblen Vermögensaufbau – insbesondere im Rahmen der privaten Altersvorsorge – können Sie zwischen zwei Varianten wählen:
 - Deka-ZukunftsPlan: Die individuelle Vorsorgelösung mit intelligentem Anlagekonzept – auch mit Riester-Förderung.
 - Deka-BasisRente: Kombiniert als Rürup-Lösung die Vorteile einer staatlich geförderten Investmentanlage mit dem Wachstumspotenzial einer optimierten Vermögensstruktur.

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

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

Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

Verwaltungsgesellschaft

Deka Investment GmbH
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Rechtsform

Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Sitz

Frankfurt am Main

Gründungsdatum

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

Eigenkapitalangaben

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10,2 Mio.
Eigenmittel: EUR 93,2 Mio.
(Stand: 31. Dezember 2017)

Alleingesellschafterin

DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Rüdiger
Vorsitzender des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,
Frankfurt am Main
Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Vermögensmanagement GmbH, Berlin
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, Berlin
und der
Deka Immobilien GmbH, Frankfurt am Main
und der
Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main
und der
WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf
und der
S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;

Mitglied des Verwaltungsrates der DekaBank
Deutsche Girozentrale Luxembourg S.A., Luxemburg;
Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,
Wiesbaden

Mitglieder

Dr. Fritz Becker, Wehrheim

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsischen Sparkasse Dresden,
Dresden

Jörg Münning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse, Münster

Peter Scherkamp, München

(Stand 10. April 2018)

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deka Vermögensmanagement GmbH, Berlin

Thomas Ketter

Stellvertretender Vorsitzender des Verwaltungsrates der
Deka International S.A., Luxemburg
und der
International Fund Management S.A., Luxemburg

Dr. Ulrich Neugebauer

Mitglied des Aufsichtsrates der S-PensionsManagement GmbH,
Köln
und der
Sparkassen Pensionsfonds AG, Köln
und der
Sparkassen Pensionskasse AG, Köln

Michael Schmidt

Thomas Schneider

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,
Luxemburg
Mitglied des Aufsichtsrates der International Fund Management S.A.,
Luxemburg

(Stand 1. Juli 2018)

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

Rechtsform

Anstalt des öffentlichen Rechts

Sitz

Frankfurt am Main und Berlin

Eigenkapital

gezeichnetes und eingezahltes Kapital:	EUR 270,5 Mio.
Eigenmittel:	EUR 5.492 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2017)

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft sowie Wertpapiergeschäft

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



Deka Investment GmbH

Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt
Postfach 11 05 23
60040 Frankfurt

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