

Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2017.

Sigma Plus Balanced

Ein OGAW-Sondervermögen deutschen Rechts.



Deka
Investments

Bericht der Geschäftsführung.

Juli 2017

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 2017 bis zum 30. Juni 2017.

In den ersten beiden Quartalen des Jahres gaben trotz politischer und wirtschaftlicher Belastungsfaktoren die Optimisten den Ton an den internationalen Finanzmärkten an. Sowohl in den USA als auch in Europa nahm die konjunkturelle Erholung Fahrt auf. Die US-Notenbank erhöhte in diesem Umfeld im März und Juni erwartungsgemäß die Leitzinsen um jeweils 25 Basispunkte, während in Europa Mario Draghi an der sehr expansiven Geldpolitik festhielt. Gute Finanzierungsbedingungen für Unternehmen, sinkende Arbeitslosenquoten und die Umschiffung einer Reihe politischer Klippen in Europa durch die Wahlsiege der europafreundlichen Kräfte in den Niederlanden und Frankreich versetzten die Märkte in Kauflaune. Mit gleichzeitig abnehmender Angst vor einem ausufernden US-Protektionismus bildete dies die Basis für ein freundliches Aktienmarkthalbjahr.

Die Renditen an den Anleihemärkten diesseits und jenseits des Atlantiks tendierten in den vergangenen sechs Monaten unter Schwankungen seitwärts. 10-jährige US-Treasuries gaben im Stichtagsvergleich leicht auf 2,3 Prozent nach. Laufzeitgleiche Bundesanleihen rentierten zum 30. Juni 2017 mit knapp 0,5 Prozent und lagen damit merklich über dem Ausgangsniveau.

Das Gros der Aktienmärkte wies stichtagsbezogen trotz des Rücksetzers in der letzten Juniwoche solide Wertsteigerungen auf. Zum Ende des Berichtszeitraums konnten einige Aktienindizes wie etwa der DAX sogar neue Rekordmarken setzen. Im regionalen Vergleich schnitten die Börsen in den USA etwas besser ab als in Europa.

In diesem Marktumfeld verzeichnete Ihr Fonds Sigma Plus Balanced im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 1,6 Prozent.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wichtige Informationen an die Anteilhaber im Internet unter www.deka.de bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitgehendes 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



Steffen Selbach

Inhalt.

Anlagepolitik. Sigma Plus Balanced	5
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2017. Sigma Plus Balanced	6
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2017. 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 beigefügt 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 betrug zum Stichtag 53,7 Prozent, wobei die Engagements überwiegend in Euroland, den USA und Großbritannien bestanden. Im Stichtagsvergleich wurde die Netto-Rentenquote des Fonds weitgehend beibehalten. Zur partiellen Absicherung des Rentenportfolios wurden Zinsterminkontrakte im wirtschaftlichen Gegenwert von 4,0 Prozent des Fondsvermögens eingesetzt. Die größten Positionen auf der Rentenseite bildeten Anleihen halbstaatlicher Emittenten (z.B. Länderschatzanweisungen), gefolgt von Staatstiteln, Unternehmensanleihen, Rentenfondsanteilen sowie besicherten Papieren.

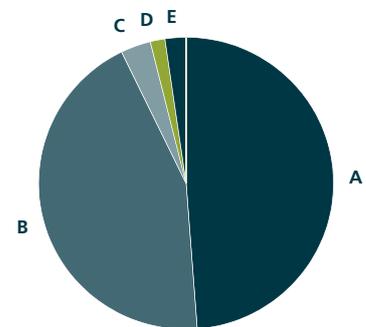
Der Aktienanteil in Wertpapieren lag zuletzt bei 44,0 Prozent und wurde ausschließlich durch Einzelwerte abgebildet. Die USA, Kanada und Großbritannien bildeten zuletzt die größten Länderpositionen. Die Branchengewichtungen ergaben sich implizit aus der Länderallokation und Einzelaktien-

Wichtige Kennzahlen Sigma Plus Balanced

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre
Performance*	1,6%	3,2%	1,2%
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	48,8%
B	Aktien	44,0%
C	Rentenfonds	3,3%
D	Wertpapiere mit besonderer Ausstattung	1,6%
E	Barreserve, Sonstiges	2,3%

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

auswahl. Durch Aktienindexfutures und -optionen wurde der Investitionsgrad in Aktien um 2,5 Prozentpunkte verringert.

Die Wertpapierpositionen in Fremdwährung waren zum Stichtag überwiegend durch Devisentermingeschäfte währungsgesichert.

Das Sondervermögen Sigma Plus Balanced verzeichnete im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von plus 1,6 Prozent. Zum Stichtag betrug der Anteilpreis 44,51 Euro, das Fondsvolumen lag bei 118,9 Mio. Euro.

Sigma Plus Balanced

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2017.

Gliederung nach Anlageart - Land

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	51.081.720,41	42,95
Australien	4.641.706,46	3,90
Bermuda	246.012,80	0,21
Dänemark	2.601.724,62	2,19
Deutschland	2.446.899,10	2,05
Frankreich	3.354.647,61	2,83
Großbritannien	6.485.974,56	5,45
Irland	498.213,10	0,41
Italien	287.288,50	0,24
Japan	675.200,25	0,57
Kanada	7.161.563,28	6,02
Niederlande	1.990.695,19	1,66
Österreich	203.613,00	0,17
Schweden	1.223.223,12	1,04
Schweiz	3.772.976,33	3,17
Singapur	249.203,26	0,21
Spanien	920.992,46	0,78
USA	14.321.786,77	12,05
2. Anleihen	59.434.441,33	50,00
Australien	946.276,50	0,80
Deutschland	33.729.954,00	28,36
Frankreich	1.949.415,00	1,65
Großbritannien	6.732.106,58	5,66
Irland	622.291,50	0,53
Luxemburg	315.885,00	0,27
Mexiko	328.215,00	0,28
Niederlande	1.048.871,50	0,89
Norwegen	203.184,00	0,17
Österreich	1.776.710,50	1,49
Panama	312.859,50	0,26
Schweden	937.807,50	0,79
Spanien	959.799,00	0,81
USA	9.571.065,75	8,04
3. Investmentanteile	3.898.507,73	3,28
Deutschland	2.357.058,00	1,98
Irland	1.541.449,73	1,30
4. Sonstige Wertpapiere	1.030.293,81	0,87
Schweiz	1.018.032,23	0,86
Spanien	12.261,58	0,01
5. Derivate	267.778,08	0,23
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	3.007.685,92	2,51
7. Sonstige Vermögensgegenstände	615.900,44	0,51
II. Verbindlichkeiten	-415.047,76	-0,35
III. Fondsvermögen	118.921.279,96	100,00

Gliederung nach Anlageart - Währung

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	51.081.720,41	42,95
AUD	4.775.255,06	4,01
CAD	7.161.563,28	6,02
CHF	3.772.976,33	3,17
DKK	2.601.724,62	2,19
EUR	9.469.507,88	7,95
GBP	6.585.267,04	5,53
JPY	675.200,25	0,57
SEK	1.223.223,12	1,04
USD	14.817.002,83	12,47
2. Anleihen	59.434.441,33	50,00
EUR	43.776.164,00	36,84
GBP	6.087.211,58	5,12
USD	9.571.065,75	8,04
3. Investmentanteile	3.898.507,73	3,28
EUR	2.357.058,00	1,98
USD	1.541.449,73	1,30
4. Sonstige Wertpapiere	1.030.293,81	0,87
CHF	1.018.032,23	0,86
EUR	12.261,58	0,01
5. Derivate	267.778,08	0,23
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	3.007.685,92	2,51
7. Sonstige Vermögensgegenstände	615.900,44	0,51
II. Verbindlichkeiten	-415.047,76	-0,35
III. Fondsvermögen	118.921.279,96	100,00

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

Sigma Plus Balanced

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2017.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)
Börsengehandelte Wertpapiere								97.053.861,85	81,63
Aktien								51.081.720,41	42,95
EUR								9.469.507,88	7,95
NL0000235190	Airbus SE Aandelen op naam	STK		5.142	5.142	0	EUR 72,640	373.514,88	0,31
DE0008404005	Allianz SE vink.Namens-Aktien	STK		2.744	1.968	0	EUR 174,150	477.867,60	0,40
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK		19.813	0	0	EUR 14,500	287.288,50	0,24
DE000BAY0017	Bayer AG Namens-Aktien	STK		4.216	4.216	0	EUR 113,200	477.251,20	0,40
DE0005200000	Beiersdorf AG Inhaber-Aktien	STK		1.513	0	0	EUR 92,590	140.088,67	0,12
FR0000125338	Capgemini SE Actions Port.	STK		4.677	4.677	0	EUR 90,350	422.566,95	0,36
ES0126775032	Distribuidora Intl de Alim.SA Acciones Port. ¹⁾	STK		61.677	57.905	36.571	EUR 5,517	340.272,01	0,29
AT0000652011	Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien	STK		6.078	6.078	0	EUR 33,500	203.613,00	0,17
NL0012059018	EXOR N.V. Aandelen aan toonder	STK		9.496	9.496	0	EUR 48,200	457.707,20	0,38
FR0000121147	Faurecia S.A. Actions Port.	STK		8.089	0	0	EUR 44,640	361.092,96	0,30
IE0004906560	Kerry Group PLC Reg.Shares A	STK		3.513	0	0	EUR 75,540	265.372,02	0,22
ES0124244E34	Mapfre S.A. Acciones Nom. ¹⁾	STK		52.789	142.338	89.549	EUR 3,090	163.118,01	0,14
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien	STK		3.960	2.222	0	EUR 177,900	704.484,00	0,59
FR0000121501	Peugeot S.A. Actions Port.(C.R.)	STK		24.639	24.639	0	EUR 17,640	434.631,96	0,37
NL0006144495	Relx N.V. Aandelen op naam	STK		33.621	18.455,81	0,81	EUR 18,105	608.708,21	0,51
FR0000131906	Renault S.A. Actions Port.	STK		2.810	0	0	EUR 80,140	225.193,40	0,19
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK		30.808	30.808	0	EUR 13,555	417.602,44	0,35
DE0007037129	RWE AG Inhaber-Stammaktien	STK		36.721	36.721	0	EUR 17,625	647.207,63	0,54
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK		9.657	9.657	0	EUR 85,150	822.293,55	0,69
FR0000120271	Total S.A. Actions au Porteur	STK		17.536,06	9.127,75	0,69	EUR 43,835	768.693,19	0,65
NL0000009355	Unilever N.V. Cert.v.Aandelen	STK		11.270	0	0	EUR 48,870	550.764,90	0,46
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK		4.252	0	0	EUR 75,300	320.175,60	0,27
AUD								4.775.255,06	4,01
AU000000AMC4	Amcor Ltd. Reg.Shares	STK		41.991	0	0	AUD 16,210	457.899,25	0,39
AU000000ALL7	Aristocrat Leisure Ltd. Reg.Shares	STK		41.524	41.524	0	AUD 22,560	630.186,34	0,53
AU000000BLD2	Boral Ltd. Reg.Shares	STK		58.098	0	19.264	AUD 6,950	271.629,35	0,23
AU000000CTX1	Caltex Australia Ltd. Reg.Shares	STK		23.105	23.105	13.265	AUD 31,610	491.316,30	0,41
AU000000CBA7	Commonwealth Bank of Australia Reg.Shares	STK		17.957	11.372	0	AUD 82,810	1.000.339,16	0,84
AU000000CSL8	CSL Ltd. Reg.Shares	STK		1.572	0	1.220	AUD 138,030	145.967,69	0,12
AU000000FMG4	Fortescue Metals Group Ltd. Reg.Shares	STK		170.376	170.376	0	AUD 5,220	598.287,08	0,50
AU000000JHX1	James Hardie Industries PLC Reg.Shares (CUFS)	STK		9.684	0	0	AUD 20,500	133.548,60	0,11
AU000000ORG5	Origin Energy Ltd. Reg.Shares	STK		82.312	0	0	AUD 6,860	379.855,11	0,32
AU000000TAH8	Tabcorp Holdings Ltd. Reg.Shares	STK		67.310	0	0	AUD 4,370	197.875,37	0,17
AU000000WES1	Wesfarmers Ltd. Reg.Shares	STK		12.090	0	0	AUD 40,120	326.300,64	0,27
AU000000WBC1	Westpac Banking Corp. Reg.Shares	STK		6.921	0	0	AUD 30,510	142.050,17	0,12
CAD								7.161.563,28	6,02
CA0636711016	Bank of Montreal Reg.Shares	STK		3.100	0	0	CAD 95,500	199.744,29	0,17
CA0553487604	BCE Inc. Reg.Shares new	STK		3.800	0	0	CAD 58,600	150.241,71	0,13
CA1360691010	Canadian Imperial Bank of Commerce Reg.Shares	STK		5.100	0	0	CAD 105,940	364.535,18	0,31
CA13645T1003	Canadian Pacific Railway Ltd. Reg.Shares	STK		2.900	0	0	CAD 208,510	407.975,60	0,34
CA1249003098	CCL Industries Inc. Reg.Shares Cl.B	STK		13.500	10.800	0	CAD 65,020	592.229,51	0,50
CA39945C1095	CGI Group Inc. Reg.Shs Cl.A (Sub.Vtg)	STK		7.000	0	0	CAD 66,360	313.410,63	0,26
CA21037X1006	Constellation Software Inc. Reg.Shares	STK		1.000	0	0	CAD 683,690	461.284,15	0,39
CA25675T1075	Dollarama Inc. Reg.Shares	STK		2.436	0	0	CAD 122,790	201.813,21	0,17
CA3495531079	Fortis Inc. Reg.Shares	STK		8.200	0	0	CAD 45,820	253.500,16	0,21
CA39138C1068	Great-West Lifeco Inc. Reg.Shares	STK		8.400	0	0	CAD 35,010	198.417,83	0,17
CA4495861060	IGM Financial Inc. Reg.Shares	STK		5.800	5.800	0	CAD 40,440	158.251,72	0,13
CA45833V1094	Inter Pipeline Ltd. Reg.Shares	STK		17.164	0	5.500	CAD 25,450	294.724,07	0,25
CA5394811015	Loblaws Companies Ltd. Reg.Shares	STK		3.200	0	0	CAD 72,180	155.839,00	0,13
CA59162N1096	Metro Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		14.400	0	0	CAD 42,500	412.915,07	0,35
CA6837151068	Open Text Corp. Reg.Shares	STK		8.900	8.100	7.300	CAD 40,420	242.714,44	0,20
CA7063271034	Pembina Pipeline Corp. Reg.Shares	STK		3.700	0	0	CAD 42,910	107.119,75	0,09
CA7392391016	Power Corporation of Canada Reg.Shares(Sub.Vtg)	STK		6.500	0	0	CAD 29,610	129.855,72	0,11
CA73927C1005	Power Financial Corp. Reg.Shares	STK		8.000	0	0	CAD 33,210	179.253,72	0,15
CA7800871021	Royal Bank of Canada Reg.Shares	STK		6.400	0	0	CAD 94,700	408.920,85	0,34
CA87971M1032	TELUS Corp. Reg.Shares	STK		7.600	0	0	CAD 44,730	229.362,17	0,19
CA0641491075	The Bank of Nova Scotia Reg.Shares	STK		3.300	0	0	CAD 78,390	174.535,55	0,15
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares	STK		29.300	1.900	0	CAD 65,470	1.294.253,26	1,09
CA9528451052	West Fraser Timber Co. Ltd. Reg.Shares	STK		5.500	5.500	0	CAD 62,160	230.665,69	0,19
CHF								3.772.976,33	3,17
CH0012221716	ABB Ltd. Namens-Aktien	STK		8.577	0	0	CHF 23,850	187.101,17	0,16
CH0363463438	Idorsia AG Namens-Aktien	STK		1.521	1.521	0	CHF 17,650	24.554,25	0,02
CH0013841017	Lonza Group AG Namens-Aktien	STK		1.730	0	0	CHF 204,500	323.587,79	0,27
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien	STK		12.920	784	0	CHF 84,300	996.191,42	0,84
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien	STK		15.653	6.186	0	CHF 80,550	1.153.229,75	0,97
CH0024638212	Schindler Holding AG Namens-Aktien	STK		1.163	0	0	CHF 199,700	212.427,38	0,18
CH0000587979	Sika AG Inhaber-Aktien	STK		70	0	0	CHF 6.175,000	395.355,43	0,33
CH0244767585	UBS Group AG Namens-Aktien	STK		32.074	0	0	CHF 16,380	480.529,14	0,40
DKK								2.601.724,62	2,19
DK0010274414	Danske Bank AS Navne-Aktier	STK		14.626	2.549	0	DKK 249,900	491.496,38	0,41
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B	STK		9.854	9.854	0	DKK 276,900	366.913,77	0,31
DK0060477503	Topdanmark AS Navne-Aktier	STK		10.656	4.534	0	DKK 207,100	296.758,25	0,25
DK0060636678	Tryg AS Navne-Aktier	STK		19.806	19.806	0	DKK 142,200	378.725,78	0,32
DK0010268606	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier	STK		11.177	11.177	0	DKK 593,500	892.019,75	0,75
DK0060738599	William Demant Hldg AS Navne Aktier A	STK		7.750	0	0	DKK 168,700	175.810,69	0,15

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens *)	
GBP									6.585.267,04	5,53
GB0000456144	Antofagasta PLC Reg.Shares	STK		24.550	24.550	0	GBP 8,015	224.363,89	0,19	
GB0000536739	Ashtead Group PLC Reg.Shares	STK		25.117	5.973	0	GBP 16,020	458.805,07	0,39	
GB000BVYVW23	Auto Trader Group PLC Reg.Shares	STK		28.223	28.223	0	GBP 3,814	122.738,78	0,10	
GB0007980591	BP PLC Reg.Shares	STK		54.811	0	0	GBP 4,454	278.365,79	0,23	
GB000744838	Bunzl PLC Reg.Shares	STK		4.257	0	0	GBP 23,150	112.370,57	0,09	
GB000BD6K4575	Compass Group PLC Reg.Shares	STK		17.136,538	17.136,538	0	GBP 16,390	320.257,99	0,27	
IE0002424939	DCC PLC Reg.Shares	STK		1.244	0	0	GBP 70,000	99.292,48	0,08	
GB00071N6K86	Evrax PLC Reg.Shares	STK		51.269	51.269	0	GBP 2,083	121.770,49	0,10	
GB0005405286	HSBC Holdings PLC Reg.Shares	STK		53.179	0	0	GBP 7,124	431.978,38	0,36	
GB000BGLP8L22	IMI PLC Reg.Shares	STK		10.914	0	0	GBP 12,010	149.459,97	0,13	
GB0004544929	Imperial Brands PLC Reg.Shares	STK		2.105	0	0	GBP 34,790	83.503,46	0,07	
GB000BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC Reg.Shares	STK		3.895	0	4.569	GBP 29,110	129.284,84	0,11	
GB000BQY7BX88	Micro Focus International PLC Reg.Shares	STK		14.469	4.511	0	GBP 22,720	374.839,00	0,32	
GB0001CRLC47	Mondi PLC Reg.Shares	STK		11.583	11.583	0	GBP 19,950	263.488,63	0,22	
GB000BDR05C01	National Grid PLC Reg.Shares	STK		19.492	19.492	0	GBP 9,587	213.077,23	0,18	
GB0006825383	Persimmon PLC Reg.Shares	STK		9.056	9.056	0	GBP 22,480	232.129,67	0,20	
GB000B0H2K534	Petrofac Ltd. Reg.Shares ¹⁾	STK		40.546	15.005	0	GBP 4,539	209.848,62	0,18	
GB000B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Reg.Shares	STK		4.131	0	0	GBP 77,420	364.675,25	0,31	
GB000B2B0D97	Relx PLC Reg.Shares	STK		36.012	12.009	0	GBP 16,620	682.458,41	0,57	
GB000B03MM408	Royal Dutch Shell Reg.Shares Cl.B	STK		19.849	5.666	4.634	GBP 20,715	468.836,60	0,39	
GB000BKKMKR23	RSA Insurance Group PLC Reg.Shares	STK		82.672	56.582	0	GBP 6,195	583.979,61	0,49	
GB000B1FH8J72	Severn Trent PLC Reg.Shares	STK		5.594	0	0	GBP 22,140	141.220,59	0,12	
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC Reg.Shares	STK		106.209	106.209	0	GBP 1,770	214.354,46	0,18	
GB0001367019	The British Land Co. PLC Reg.Shares	STK		14.601	47.756	33.155	GBP 6,010	100.058,73	0,08	
GB000B8C3BL03	The Sage Group PLC Reg.Shares	STK		26.132	0	0	GBP 6,850	204.108,53	0,17	
JPY									675.200,25	0,57
JP3499800005	Mitsubishi UFJ Lease&Fin.Co.Ltd Reg.Shares ¹⁾	STK		35.000	0	0	JPY 614,000	168.100,75	0,14	
JP3165650007	NTT Docomo Inc. Reg.Shares	STK		11.000	0	10.800	JPY 2.652,000	228.191,49	0,19	
JP3200450009	ORIX Corp. Reg.Shares	STK		7.660	0	0	JPY 1.740,000	104.258,45	0,09	
JP3594200002	Toshiba Plant Sys & Svcs Corp. Reg.Shares	STK		12.600	12.600	0	JPY 1.772,000	174.649,56	0,15	
SEK									1.223.223,12	1,04
SE0007100581	Assa-Abloy AB Namn-Aktier B	STK		24.000	0	0	SEK 185,700	461.201,74	0,39	
SE0000379190	Castellum AB Namn-Aktier	STK		15.404	0	0	SEK 123,400	196.705,48	0,17	
SE0000427361	Nordea Bank AB Namn-Aktier	STK		15.500	0	0	SEK 108,300	173.711,25	0,15	
SE0000667891	Sandvik AB Namn-Aktier ¹⁾	STK		13.912	0	0	SEK 133,500	192.193,47	0,16	
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria)	STK		18.800	0	0	SEK 102,500	199.411,18	0,17	
USD									14.817.002,83	12,47
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares	STK		5.234	0	0	USD 72,480	332.509,70	0,28	
US0079731008	Advanced Energy Inds Inc. Reg.Shares	STK		4.400	4.400	0	USD 65,170	251.334,91	0,21	
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares	STK		1.100	0	0	USD 172,590	166.402,84	0,14	
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares	STK		3.100	1.600	0	USD 143,680	390.400,56	0,33	
US0536111091	Avery Dennison Corp. Reg.Shares	STK		4.300	0	0	USD 88,140	332.195,64	0,28	
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares	STK		57.900	3.500	0	USD 24,320	1.234.225,61	1,04	
US1011371077	Boston Scientific Corp. Reg.Shares	STK		10.600	0	0	USD 27,820	258.473,14	0,22	
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares	STK		7.500	7.500	0	USD 33,440	219.826,45	0,18	
US1510201049	Celgene Corp. Reg.Shares	STK		1.500	1.500	0	USD 131,700	173.152,77	0,15	
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares	STK		6.800	0	3.200	USD 104,120	620.576,74	0,52	
US1729674242	Citigroup Inc. New Reg.Shares	STK		2.000	0	0	USD 66,980	117.416,08	0,10	
US1773761002	Citrix Systems Inc. Reg.Shares	STK		4.500	0	0	USD 79,510	313.607,68	0,26	
US2172041061	Copart Inc. Reg.Shares	STK		13.600	13.600	0	USD 31,410	374.420,19	0,31	
US2283681060	Crown Holdings Inc. Reg.Shares	STK		4.516	0	0	USD 59,020	233.617,60	0,20	
US2774321002	Eastman Chemical Co. Reg.Shares	STK		4.800	0	0	USD 83,400	350.880,88	0,30	
BMG3223R1088	Everest Reinsurance Group Ltd. USD Reg.Shares	STK		1.100	0	0	USD 255,160	246.012,80	0,21	
US30219G1085	Express Scripts Holding Inc. Reg.Shares	STK		21.227	18.500	0	USD 63,890	1.188.704,56	1,00	
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares	STK		12.700	800	0	USD 80,700	898.317,12	0,76	
US3142111034	Federated Investors Inc. Reg.Shares Cl.B	STK		9.000	9.000	0	USD 27,840	219.616,09	0,18	
US31428X1063	Fedex Corp. Reg.Shares	STK		1.600	0	0	USD 215,230	301.838,90	0,25	
SG9999000020	Flex Ltd. Reg.Shares	STK		17.400	0	0	USD 16,340	249.203,26	0,21	
US3448491049	Foot Locker Inc. Reg.Shares	STK		7.800	0	0	USD 48,700	332.947,67	0,28	
US4198791018	Hawaiian Holdings Inc. Reg.Shares	STK		4.800	4.800	0	USD 46,200	194.372,86	0,16	
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares	STK		5.700	5.700	0	USD 45,480	227.220,62	0,19	
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares	STK		2.700	0	0	USD 154,130	364.756,77	0,31	
US4612021034	Intuit Inc. Reg.Shares	STK		1.100	0	1.000	USD 133,100	128.328,51	0,11	
US4824801009	KLA-Tencor Corp. Reg.Shares	STK		3.200	0	0	USD 92,510	259.472,35	0,22	
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares	STK		1.300	0	0	USD 142,350	162.200,89	0,14	
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares	STK		4.100	0	0	USD 76,600	275.273,91	0,23	
US5745991068	Masco Corp. Reg.Shares	STK		6.700	0	0	USD 38,000	223.157,16	0,19	
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares	STK		4.800	0	1.600	USD 55,080	231.732,84	0,19	
US81211K1007	Sealed Air Corp. Reg.Shares	STK		4.800	0	0	USD 44,870	188.777,28	0,16	
US8243481061	Sherwin-Williams Co. Reg.Shares	STK		1.500	0	0	USD 352,640	463.633,97	0,39	
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc. Reg.Shares	STK		1.800	0	0	USD 96,130	151.664,48	0,13	
US84763R1014	Spectrum Brands Holdings Inc. Reg.Shares	STK		871	0	0	USD 124,350	94.932,82	0,08	
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares	STK		1.700	0	0	USD 152,160	226.726,27	0,19	
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares	STK		2.500	0	0	USD 86,990	190.617,06	0,16	
US8910921084	Toro Co. Reg.Shares	STK		2.000	0	2.000	USD 69,030	121.009,73	0,10	
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares Cl.A	STK		20.500	17.400	0	USD 61,570	1.106.306,42	0,93	
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares	STK		2.800	0	0	USD 109,700	269.226,05	0,23	
US92210H1059	Vantiv Inc. Reg.Shares Cl. A	STK		4.000	0	0	USD 63,130	221.334,03	0,19	

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
US9311421039	Wal-Mart Stores Inc. Reg.Shares		STK	7.400	0	0	USD 75,930	492.490,14	0,41
US9497461015	Wells Fargo & Co. Reg.Shares		STK	2.300	0	0	USD 55,780	112.449,82	0,09
US9598021098	Western Union Co. Reg.Shares		STK	10.700	0	0	USD 18,860	176.879,66	0,15
US9884981013	Yum! Brands, Inc. Reg.Shares		STK	2.000	0	1.800	USD 73,450	128.758,00	0,11
Verzinsliche Wertpapiere								44.941.847,63	37,81
EUR								37.672.626,50	31,70
FR0011076439	4,0000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 11/21	EUR		300.000	300.000	0	% 114,989	344.967,00	0,29
FR0010870949	4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20 ¹⁾	EUR		300.000	300.000	0	% 111,587	334.759,50	0,28
XS0802174044	3,0000 % América Móvil S.A.B. de C.V. Notes 12/21	EUR		300.000	300.000	0	% 109,405	328.215,00	0,28
XS1205616268	1,3750 % APT Pipelines Ltd. MTN 15/22	EUR		300.000	300.000	0	% 102,678	308.034,00	0,26
XS0953783239	2,3750 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. MTN 13/20	EUR		300.000	300.000	0	% 106,909	320.725,50	0,27
DE000A0Z1UH6	0,7500 % Bayerische Landesbodenkreditanstalt IHS 15/25	EUR		2.000.000	0	0	% 101,601	2.032.010,00	1,71
DE000A1R01Z7	1,7500 % Bundesländer Ländersch. Nr.42 13/23	EUR		2.000.000	0	0	% 109,043	2.180.860,00	1,83
DE0001102408	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26 ¹⁾	EUR		1.500.000	1.500.000	0	% 96,846	1.452.682,50	1,22
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 98,298	982.980,00	0,83
XS1232146412	0,7500 % Caterpillar Intl Finance Ltd. MTN 15/20	EUR		300.000	300.000	0	% 101,849	305.545,50	0,26
XS0944362812	2,3750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 13/20 ¹⁾	EUR		300.000	300.000	0	% 105,837	317.511,00	0,27
FR0011660596	2,6250 % Eutelsat S.A. Bonds 13/20 ¹⁾	EUR		300.000	300.000	0	% 105,222	315.666,00	0,27
DE000A13SJM6	0,8750 % Freistaat Thüringen Landessch. S.2014/02 14/24	EUR		4.000.000	0	0	% 103,565	4.142.600,00	3,48
XS0829360923	6,0000 % Gas Natural CM S.A. MTN 12/20	EUR		300.000	300.000	0	% 115,128	345.384,00	0,29
XS1379182006	1,5000 % HSBC Holdings PLC MTN 16/22	EUR		300.000	300.000	0	% 104,350	313.048,50	0,26
XS1191116174	1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22 ¹⁾	EUR		300.000	300.000	0	% 104,866	314.596,50	0,26
FR0011535764	2,5000 % Kering S.A. MTN 13/20	EUR		300.000	300.000	0	% 107,151	321.451,50	0,27
DE000A1RQCL9	0,5000 % Land Hessen Schatzanw. S.1509 15/25	EUR		3.000.000	0	0	% 100,702	3.021.060,00	2,54
DE000NRW2111	2,0000 % Land Nordrhein-Westfalen Landessch. R.1247 13/25	EUR		5.000.000	0	0	% 112,152	5.607.600,00	4,73
DE000A11P8T2	0,5000 % Land Saarland Landesschatz. R.3 16/26	EUR		1.000.000	1.000.000	0	% 99,098	990.980,00	0,83
DE000A1TNA47	1,6250 % Land Sachsen-Anhalt Landessch. 13/23	EUR		3.000.000	0	3.000.000	% 108,288	3.248.640,00	2,73
XS0670798171	2,8750 % Landwirtschaftliche Rentenbank MTN S.1043 11/21 ¹⁾	EUR		1.500.000	0	500.000	% 112,853	1.692.795,00	1,42
FR0011625441	1,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE MTN 13/20	EUR		300.000	300.000	0	% 105,435	316.303,50	0,27
DE000NWB0584	0,5000 % NRW.BANK MTN IHS Ausg.058 16/26	EUR		5.000.000	0	0	% 99,316	4.965.800,00	4,18
XS0690406243	4,2500 % OMV AG MTN 11/21	EUR		300.000	300.000	0	% 116,484	349.452,00	0,29
XS0841018004	2,8750 % Origin Energy Finance Ltd. MTN 12/19	EUR		300.000	300.000	0	% 105,839	317.517,00	0,27
FR0011798115	2,0000 % Pernod-Ricard S.A. Bonds 14/20	EUR		300.000	300.000	0	% 105,423	316.267,50	0,27
XS0976892611	3,2500 % Rentokil Initial PLC MTN 13/21	EUR		300.000	300.000	0	% 110,616	331.846,50	0,28
XS0933604943	2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 13/20 ¹⁾	EUR		300.000	300.000	0	% 106,969	320.907,00	0,27
AT0000A185T1	1,6500 % Republik Österreich Bundesobl. 14/24 ¹⁾	EUR		1.000.000	0	1.000.000	% 109,894	1.098.940,00	0,92
XS0957258212	1,7500 % Unilever N.V. MTN 13/20	EUR		100.000	100.000	0	% 105,163	105.163,00	0,09
XS0439828269	4,7500 % Verbund AG MTN 09/19	EUR		300.000	300.000	0	% 109,440	328.318,50	0,28
GBP								6.087.211,58	5,12
GB0030880693	5,0000 % Großbritannien Treasury Stock 01/25	GBP		1.500.000	0	0	% 130,151	2.226.059,14	1,87
GB00BHFH458	2,7500 % Großbritannien Treasury Stock 14/24	GBP		3.000.000	0	0	% 112,875	3.861.152,44	3,25
USD								1.182.009,55	0,99
US912810FP85	5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31	USD		1.000.000	0	0	% 134,855	1.182.009,55	0,99
Andere Wertpapiere								1.030.293,81	0,87
EUR								12.261,58	0,01
ES06735169A3	Repsol S.A. Anrechte	STK		30.808	30.808	0	EUR 0,398	12.261,58	0,01
CHF								1.018.032,23	0,86
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK		4.543	271	0	CHF 245,000	1.018.032,23	0,86
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								14.492.593,70	12,19
Verzinsliche Wertpapiere								14.492.593,70	12,19
EUR								6.103.537,50	5,14
ES03136793B0	1,7500 % Bankinter S.A. Bonos 14/19	EUR		300.000	300.000	0	% 103,247	309.741,00	0,26
XS1319820624	1,6250 % Carnival Corp. Notes 16/21	EUR		300.000	300.000	0	% 104,287	312.859,50	0,26
XS1117297942	0,6880 % Geberit International B.V. Notes 15/21	EUR		300.000	300.000	0	% 101,764	305.290,50	0,26
XS1238991480	2,0000 % Harman Finance Intern. S.C.A. Notes 15/22	EUR		300.000	300.000	0	% 105,295	315.885,00	0,27
XS1137512668	1,5000 % Mölnlycke Holding AB Notes 14/22	EUR		300.000	300.000	0	% 103,284	309.850,50	0,26
DE000A13R8H3	1,1250 % Nassauische Sparkasse Hyp.-Pfe. Em.24 14/24	EUR		3.000.000	0	0	% 103,245	3.097.350,00	2,60
XS1082660744	2,5000 % ORLEN Capital AB Notes 14/21	EUR		300.000	300.000	0	% 107,036	321.108,00	0,27
XS1082661551	1,3750 % PZU Finance AB Notes 14/19	EUR		300.000	300.000	0	% 102,283	306.849,00	0,26
XS1077584024	1,8750 % Ryanair DAC MTN 14/21	EUR		300.000	300.000	0	% 105,582	316.746,00	0,27
XS1369254310	1,0000 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19 ¹⁾	EUR		200.000	200.000	0	% 101,592	203.184,00	0,17
XS1188117391	0,9000 % Santander Consumer Finance SA MTN 15/20	EUR		300.000	300.000	0	% 101,558	304.674,00	0,26
USD								8.389.056,20	7,05
US912810FT08	4,5000 % U.S. Treasury Notes 06/36	USD		3.000.000	0	0	% 129,555	3.406.644,44	2,86
US912828KD17	2,7500 % U.S. Treasury Notes 09/19 ¹⁾	USD		2.500.000	0	0	% 102,254	2.240.641,29	1,88
US912828B667	2,7500 % U.S. Treasury Notes 14/24	USD		3.000.000	0	0	% 104,270	2.741.770,47	2,31

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Wertpapier-Investmentanteile								3.898.507,73	3,28
KVG-eigene Wertpapier-Investmentanteile								2.357.058,00	1,98
EUR								2.357.058,00	1,98
DE000ETFL375	Deka iBoxx EUR Liquid Corporates Diversified UCITS ETF		ANT	21.300	21.300	0	EUR 110,660	2.357.058,00	1,98
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								1.541.449,73	1,30
USD								1.541.449,73	1,30
IE0032895942	iShs DL Corp Bond UCITS ETF Reg.Shares		ANT	15.200	15.200	0	USD 115,700	1.541.449,73	1,30
Summe Wertpapiervermögen²⁾								EUR 115.444.963,28	97,10
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere								-96.669,74	-0,08
Wertpapier-Optionsrechte									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Optionsrechte auf Aktien								-96.669,74	-0,08
FLEX adidas AG (ADS) Put Jan. 18 134,22		XEUR	STK	-3.700			EUR 1,913	-7.079,51	-0,01
FLEX Altice N.V. (6AT) Put Mai 18 13,24		XEUR	STK	-37.200			EUR 0,393	-14.621,46	-0,01
Flex ArcelorMittal S.A. (ARRB) Put Mai 18 10,62		XEUR	STK	-46.333,287			EUR 0,134	-6.190,91	-0,01
FLEX Assicurazioni Gen. (ASG) Put Dez. 17 11,65		XEUR	STK	-42.200			EUR 0,130	-5.479,75	-0,00
FLEX Essilor Intl -Cie Génle(ESL)Put März 18 96,17		XEUR	STK	-5.100			EUR 2,352	-11.993,96	-0,01
FLEX Linde AG (LIN) Put Feb. 18 137,43		XEUR	STK	-3.700			EUR 2,418	-8.944,81	-0,01
Flex NN Group N.V. (2NN) Put Jan. 18 25		XEUR	STK	-19.700			EUR 0,300	-5.914,93	-0,00
FLEX UCB S.A. (UNC) Put Dez. 17 55,58		XEUR	STK	-8.900			EUR 1,878	-16.715,29	-0,01
FLEX Unilever N.V. (UNI3) Put Feb. 18 43,19		XEUR	STK	-11.400			EUR 1,139	-12.985,57	-0,01
FLEX Vivendi S.A. (VVU) Put März 18 13,48		XEUR	STK	-36.600			EUR 0,184	-6.743,55	-0,01
Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere								EUR -96.669,74	-0,08
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								-22.029,70	-0,03
DJ Euro Stoxx 50 Future (SX5E) Sep. 17		XEUR	EUR	Anzahl 11				-8.300,00	-0,01
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 17		IFEU	GBP	Anzahl 9				-13.204,04	-0,01
OMX Index Future (O30) Juli 17		XNDX	SEK	Anzahl -24				7.388,67	0,01
S&P 500 ST Future (SP) Sep. 17		XIOM	USD	Anzahl -2				2.760,98	0,00
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Sep. 17		XMOD	CAD	Anzahl -2				1.792,00	0,00
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 17		XEUR	CHF	Anzahl -6				-6.365,93	-0,01
Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Sep. 17		XOSE	JPY	Anzahl -4				-6.101,38	-0,01
Optionsrechte								78.750,00	0,07
Optionsrechte auf Aktienindices								78.750,00	0,07
DJ Euro Stoxx50 Ind.(SX5E) Put Juni 17 3.525 W3006		XEUR		Anzahl 175			EUR 45,000	78.750,00	0,07
Summe Aktienindex-Derivate								EUR 56.720,30	0,04
Zins-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte								81.808,40	0,07
EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 17		XEUR	EUR	-4.000.000				47.840,00	0,04
EURO Bund Future (FGBL) Sep. 17		XEUR	EUR	-2.300.000				47.600,00	0,04
EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 17		XEUR	EUR	-4.000.000				11.800,00	0,01
Five-Year US Treasury Note Future (FV) Sep. 17		XCBT	USD	4.700.000				-6.621,68	-0,01
Long Gilt Future (FLG) Sep. 17		IFEU	GBP	600.000				-13.249,64	-0,01
Ten-Year US Treasury Note Future (TY) Sep. 17		XCBT	USD	3.000.000				-11.873,85	-0,01
Two-Year US Treasury Note Future (TU) Sep. 17		XCBT	USD	5.000.000				-5.354,85	-0,00
US Treasury Long Bond Future (US) Sep. 17		XCBT	USD	1.000.000				11.668,42	0,01
Optionsrechte								23.231,13	0,02
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte								23.231,13	0,02
EURO Bund Future (FGBL) Put Sep. 17 162,50		XEUR	EUR	Anzahl 79			EUR 0,294	23.231,13	0,02
Summe Zins-Derivate								EUR 105.039,53	0,09
Devisen-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)								-100.566,91	-0,08
Offene Positionen									
USD/EUR 7.000.000,00		OTC						-100.566,91	-0,08
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								303.254,90	0,26
Offene Positionen									
AUD/EUR 5.000.000,00		OTC						-44.181,18	-0,04
CAD/EUR 10.700.000,00		OTC						-155.298,50	-0,13
CHF/EUR 1.000.000,00		OTC						7.647,31	0,01
GBP/EUR 11.400.000,00		OTC						79.514,18	0,07
JPY/EUR 86.000.000,00		OTC						24.470,32	0,02
SEK/EUR 13.000.000,00		OTC						-11.292,98	-0,01
USD/EUR 36.300.000,00		OTC						402.395,75	0,34
Summe Devisen-Derivate								EUR 202.687,99	0,18

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	1.841.624,66			% 100,000	1.841.624,66	1,55
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		DKK	196.135,27			% 100,000	26.374,50	0,02
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	238.377,12			% 100,000	271.808,17	0,23
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	10.094,69			% 100,000	1.055,47	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		SEK	1.190.799,41			% 100,000	123.227,15	0,10
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		AUD	202.972,52			% 100,000	136.542,53	0,11
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CAD	202.231,90			% 100,000	136.445,42	0,11
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	83.958,55			% 100,000	76.792,29	0,06
	DekaBank Deutsche Girozentrale		HKD	38.950,22			% 100,000	4.373,90	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	20.970.034,00			% 100,000	164.033,43	0,14
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	257.168,44			% 100,000	225.408,40	0,19
Summe Bankguthaben							EUR	3.007.685,92	2,51
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	3.007.685,92	2,51
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	474.638,94				474.638,94	0,40
	Dividendenansprüche		EUR	86.640,01				86.640,01	0,07
	Forderungen aus Wertpapier-Darlehen		EUR	2.161,43				2.161,43	0,00
	Forderungen aus Anteilschneidgeschäften		EUR	223,35				223,35	0,00
	Forderungen aus Fondsausschüttung		EUR	13.051,03				13.051,03	0,01
	Forderungen aus Quellensteuerrückstattung		EUR	39.185,68				39.185,68	0,03
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	615.900,44	0,51
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Wertpapier-Darlehen		EUR	-1.059,10				-1.059,10	-0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneidgeschäften		EUR	-19.922,82				-19.922,82	-0,02
	Allgemeine Fondsverwaltungsverbindlichkeiten		EUR	-94.065,84				-94.065,84	-0,08
	Verbindlichkeiten aus Cash Collateral		EUR	-300.000,00				-300.000,00	-0,25
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-415.047,76	-0,35
Fondsvermögen							EUR	118.921.279,96	100,00
Umlaufende Anteile							STK	2.671.836	
Anteilwert							EUR	44,51	

*) 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:				
Distribuidora Intl de Alim.SA Acciones Port.	STK	5.308	29.284,24	
Mapfre S.A. Acciones Nom.	STK	2.159	6.671,31	
Mitsubish.UFJ Lease&Fin.Co.Ltd Reg.Shares	STK	3.127	15.018,60	
Petrofac Ltd. Reg.Shares	STK	2.598	13.446,13	
Sandvik AB Namn-Aktier	STK	4.938	68.218,18	
4,5000 % Alstom S.A. Notes 10/20	EUR	300.000	334.759,50	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26	EUR	1.500.000	1.452.682,50	
2,3750 % Coca Cola HBC Finance B.V. MTN 13/20	EUR	200.000	211.674,00	
2,6250 % Eutelsat S.A. Bonds 13/20	EUR	200.000	210.444,00	
1,5000 % Infineon Technologies AG Anl. 15/22	EUR	300.000	314.596,50	
2,8750 % Landwirtschaftliche Rentenbank MTN S.1043 11/21	EUR	879.000	991.977,87	
2,6250 % Repsol Intl Finance B.V. MTN 13/20	EUR	300.000	320.907,00	
1,6500 % Republik Österreich Bundesobl. 14/24	EUR	1.000.000	1.098.940,00	
1,0000 % Santander Consumer Bank AS MTN 16/19	EUR	100.000	101.592,00	
2,7500 % U.S. Treasury Notes 09/19	USD	2.500.000	2.240.641,29	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen:	EUR		7.410.853,12	7.410.853,12

Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Sicherheit dienen: EUR 9.610.728,08

Sigma Plus Balanced

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2017

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87701	= 1 Euro (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43655	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	9,56420	= 1 Euro (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	9,66345	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	1,09332	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,14090	= 1 Euro (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,48215	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	127,84000	= 1 Euro (EUR)
Hongkong, Dollar	(HKD)	8,90515	= 1 Euro (EUR)
Australien, Dollar	(AUD)	1,48652	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

IFEU	London - ICE Futures Europe
XEUR	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XOSE	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XIOM	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Option Market (IOM)
XCBT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
XMOD	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				
AU000000BHP4	BHP Billiton Ltd. Reg.Shares	STK	0	23.011
AU000000BXB1	Brambles Ltd. Reg.Shares	STK	0	19.482
AU000000DXS1	DEXUS Reg.Stapled Secs (Units)	STK	0	21.029
AU000000HVN7	Harvey Norman Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	106.006
AU000000IAG3	Insurence Australia Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	33.692
AU000000MGR9	Mirvac Group Reg.Stapled Units	STK	0	151.499
AU000000WPL2	Woodside Petroleum Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.192
AU000000WOW2	Woolworths Ltd. Reg.Shares	STK	0	13.052
CAD				
CA0089161081	Agrium Inc. Reg.Shares	STK	0	2.600
CA0467894006	ATCO Ltd. Reg.Shares	STK	0	5.235
CA1247651088	CAE Inc. Reg.Shares	STK	0	15.900
CA8283361076	Silver Wheaton Corp. Reg.Shares	STK	0	4.681
CHF				
CH0355794022	Actelion Ltd. Nam.-Akt. 2. Lin. 03/17	STK	1.521	1.521
CH0010532478	Actelion Ltd. Namens-Aktien	STK	0	2.161
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien	STK	0	2.221
CH0012214059	LafargeHolcim Ltd. Namens-Aktien	STK	0	8.178
EUR				
DE0005565204	Dürr AG Inhaber-Aktien	STK	0	1.628
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK	3.780	3.780
ES0178165017	Tecnicas Reunidas S.A. Acciones Port.	STK	2.949	2.949
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A. Azioni Port.Risp.Non Cnv.	STK	513.539	513.539
GBP				
GB0007365546	Carillion PLC Reg.Shares	STK	0	41.148
GB0002374006	Diageo PLC Reg.Shares	STK	0	5.521
GB0034264548	Paysafe Group PLC Reg.Shares	STK	0	37.910
GB0001500809	Tullow Oil PLC Reg.Shares	STK	0	96.591
IE0033024807	UDG Healthcare PLC Reg.Shares	STK	0	12.448
JPY				
JP3566800003	Central Japan Railway Co. Reg.Shares	STK	0	1.200
JP3486800000	Daito Trust Construction Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	800
JP3726800000	Japan Tobacco Inc. Reg.Shares	STK	0	2.852
JP3546800008	Terumo Corp. Reg.Shares	STK	0	2.500
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	3.871
SEK				
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B	STK	0	12.800
CA46016U1084	International Petroleum Corp. Reg.Shares	STK	2.094,66666666	2.094,66666666
SE0000825820	Lundin Petroleum AB Namn-Aktier	STK	6.284	6.284
USD				
US0138721065	Alcoa Corp. Reg.Shares	STK	0	4.855
US0325111070	Anadarko Petroleum Corp. Reg.Shares	STK	0	1.900
US03965L1008	Arconic Inc. Reg.Shares	STK	0	14.566
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New	STK	0	4.910
SG9999014823	Broadcom Ltd. Reg.Shares	STK	0	1.911

Sigma Plus Balanced

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US4601461035	International Paper Co. Reg.Shares	STK	0	7.400
US54142L1098	LogMeln Inc. Reg.Shares	STK	773,2	773,2
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares	STK	0	1.800
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares	STK	0	2.000
NL0009538784	NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder	STK	0	3.842
US68389X1054	Oracle Corp. Reg.Shares	STK	0	8.300
US8715031089	Symantec Corp. Reg.Shares	STK	0	10.700
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR				
DE0001102309	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23	EUR	0	3.000.000
DE0001102317	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23	EUR	0	1.000.000
DE000A0WMBG2	3,5000 % Deutsche Postbank AG Öff.-Pfe. MTN S.DIP067 10/20	EUR	0	500.000
DE000A1R0527	1,5000 % Dt. Pfandbriefbank AG MTN Hyp.-Pfe. R.15196 13/20	EUR	0	1.000.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
GBP				
GB00BLNN3L44	Compass Group PLC Reg.Shares	STK	0	17.822
Verzinsliche Wertpapiere				
USD				
US912828RR30	2,0000 % U.S. Treasury Notes 11/21	USD	0	7.000.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
GBP				
GB00808SNH34	National Grid PLC Reg.Shares New	STK	0	21.264
Andere Wertpapiere				
CHF				
CH0351063620	Lonza Group AG Anrechte	STK	1.730	1.730

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	10.024
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 INDEX, OMXC20 CAP, S&P 500 INDEX, S&P ASX 200 INDEX, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), TOPIX Index (Price))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	12.056
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), OMX Stockholm 30 Index, OMXC20 CAP, S&P 500 INDEX, S&P ASX 200 INDEX, S&P/TSX 60 Index (Price) (CAD), SMI SWISS MARKET INDEX, TOPIX Index (Price))		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	27.546
(Basiswert(e): 10 Year US Treasury Notes (10,0), 2 Year US Treasury Notes (2,0), 30 Year US Treasury Bonds (30,0), 5 Year US Treasury Notes (5,0), Euro Schatz (2,0), Long Gilt (10,0))		
Verkaufte Kontrakte:	EUR	31.907
(Basiswert(e): 10 Year US Treasury Notes (10,0), Euro Bobl (5,5), Euro Bund (10,0), Euro Schatz (2,0), Long Gilt (10,0))		
Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	52
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	37.311
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), S&P 500 INDEX)		
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	10.710
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR))		
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):	EUR	26.553
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))		
Verkaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	13.855
(Basiswert(e): EURO Bund Future (FGBL))		
Devisentermingeschäfte		
Devisenterminkontrakte (Verkauf)		
Verkauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	3.849
CAD/EUR	EUR	8.407
CHF/EUR	EUR	1.077
GBP/EUR	EUR	14.582
JPY/EUR	EUR	1.473
SEK/EUR	EUR	1.627
USD/EUR	EUR	40.230

Sigma Plus Balanced

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Devisenterminkontrakte (Kauf)		
Kauf von Devisen auf Termin:		
AUD/EUR	EUR	6.915
CAD/EUR	EUR	14.933
CHF/EUR	EUR	2.935
GBP/EUR	EUR	25.795
JPY/EUR	EUR	2.139
SEK/EUR	EUR	3.691
USD/EUR	EUR	63.923
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):		
unbefristet	EUR	34.788
(Basiswert(e): 1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23, 1,6250 % Carnival Corp. Notes 16/21, 2,0000 % U.S. Treasury Notes 11/21, 2,7500 % U.S. Treasury Notes 09/19, 2,7500 % U.S. Treasury Notes 14/24, 2,8750 % Landwirtschaftliche Rentenbank MTN S.1043 11/21, 4,5000 % U.S. Treasury Notes 06/36, 5,3750 % U.S. Treasury Bonds 01/31, ABB Ltd. Namens-Aktien, Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom., Capgemini SE Actions Port., Carillion PLC Reg.Shares, Castellum AB Namn-Aktier, Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien, Distribuidora Intl de Alim.SA Acciones Port., Faurecia S.A. Actions Port., H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B, International Petroleum Corp. Reg.Shares, LafargeHolcim Ltd. Namens-Aktien, Lundin Petroleum AB Namn-Aktier, Mapfre S.A. Acciones Nom., Nestlé S.A. Namens-Aktien, Novartis AG Namens-Aktien, Petrofac Ltd. Reg.Shares, Repsol S.A. Acciones Port., Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine, Sandvik AB Namn-Aktier, Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria), Tecnicas Reunidas S.A. Acciones Port., The British Land Co. PLC Reg.Shares, Tullow Oil PLC Reg.Shares)		

Sigma Plus Balanced

Anhang.

Umlaufende Anteile	STK	2.671.836
Anteilwert	EUR	44,51

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 Umsatzvolumina an einer anderen Börse mit gleicher Kursnotierungswährung nicht höher sind. Für Aktien, aktienähnliche Genussscheine und Unternehmensbeteiligungen, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden die Verkehrswerte, 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

Verzinsliche Wertpapiere, rentenähnliche Genussscheine und Zertifikate, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden 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	132.638,46	0,11
Verzinsliche Wertpapiere	7.278.214,66	6,12

10 größte Gegenparteien

Wertpapier-Darlehen (besichert)

	Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR	Sitzstaat
DekaBank Deutsche Girozentrale	4.951.434,46	Deutschland
Organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme	2.459.418,66	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	7.410.853,12

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.

Art(en) und Qualität(en) der über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme erhaltenen Sicherheiten

Die Sicherheiten, die der Fonds erhält, können in Form von Aktien- und Rentenpapieren geleistet werden. Die Qualität der dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte wird von Clearstream Banking AG (Frankfurt) gewährleistet und überwacht. Bei Aktien wird als Qualitätsmerkmal die Zugehörigkeit zu einem wichtigen EU-Aktienindizes (z.B. DAX 30, Dow Jones Euro STOXX 50 Index etc.) angesehen. Rentenpapiere müssen entweder Bestandteil des GC Pooling ECB Basket oder des GC Pooling ECB EXTended Basket sein. Weitere Informationen bezüglich dieser Rentenbaskets können unter www.eurexrepo.com entnommen werden.

Von den dem Sondervermögen gestellten Sicherheiten werden Wertabschläge (Haircuts) abgezogen, die je nach Art der Wertpapiere, der Bonität der Emittenten, sowie ggf. nach der Restlaufzeit variieren. Bei Aktien wird ein Wertabschlag in Höhe von 10% abgezogen; bei Rentenpapieren wird ein Wertabschlag anhand der von der EZB veröffentlichten Liste bezüglich zulässiger Vermögenswerte (Eligible Asset Database) vorgenommen. Einzelheiten zu der EAD-Liste finden Sie unter <https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/assets/html/list-MID.en.html>.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapier-Darlehen

EUR

Sigma Plus Balanced

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

Wertpapier-Darlehen

Restlaufzeit 1-7 Tage
unbefristet

Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

2.601.702,08
8.935.341,28

Die über organisierte Wertpapier-Darlehenssysteme bereitgestellten Sicherheiten werden je Arbeitstag neu berechnet und entsprechend bereitgestellt. Daher erfolgt ein Ausweis dieser Sicherheiten unter Restlaufzeit 1-7 Tage.

Ertrags- und Kostenanteile

Wertpapier-Darlehen

Ertragsanteil des Fonds
Kostenanteil des Fonds
Ertragsanteil der KVG

absolute Beträge in EUR

16.211,72
7.943,78
7.943,78

in % der Bruttoerträge des Fonds

100,00
49,00
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 Wertpapierleihebesätzen 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 Bruttoleihebesatz.

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

6,42% (EUR der gesamten Wertpapierleihe im Verhältnis zur "Summe Wertpapiervermögen - exklusive Geldmarktfonds")

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

Wertpapier-Darlehen

Schneider Electric SE
Dexia Kommunalbank Deutschland AG
VINCI S.A.
Saarland
Nordrhein-Westfalen, Land
Landes Kreditbank Baden-Württemberg - Förderbank
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. [BFCM]
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE
FMS Wertmanagement

absolutes Volumen der empfangenen Sicherheiten in EUR

2.374.156,20
1.899.993,95
1.024.548,30
1.020.417,12
638.102,67
606.191,12
461.106,43
406.666,81
401.672,00
379.517,70

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
Clearstream Banking Frankfurt
Clearstream Banking Frankfurt KAGPlus
J.P.Morgan AG Frankfurt

3
3.926.356,68 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
2.601.702,08 EUR (absolut/verwahrter Betrag)
5.008.984,60 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 gegebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

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

Frankfurt am Main, den 3. Juli 2017

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 verschiedenen Varianten wählen:

- Deka-ZukunftsPlan: Die individuelle Vorsorgelösung mit intelligentem Anlagekonzept – auch mit Riester-Förderung.
- Deka-BonusRente: Bietet Ihnen alle Vorteile einer Riester-Lösung und eröffnet zudem zusätzliche Renditechancen an den Wertpapiermärkten.
- 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 2016)

Alleingeschäftlerin

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 Landesbank Berlin Investment 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 Landesbank Berlin Investment 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

Mitglieder

Dr. Fritz Becker

Mitglied des Aufsichtsrates der Augsburger Aktienbank AG,
Augsburg

Joachim Hoof

Vorsitzender des Vorstandes der Ostsächsischen Sparkasse Dresden,
Dresden

und der

Sachsen-Finanzgruppe,
Dresden

Jörg Munning

Vorsitzender des Vorstandes der LBS Westdeutsche Landesbausparkasse,
Münster

Heinz-Jürgen Schäfer
Offenbach

(Stand 9. Januar 2017)

Geschäftsführung

Stefan Keitel (Vorsitzender)

Thomas Ketter

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

und der

International Fund Management S.A.,
Luxemburg

und der

Dealis Fund Operations 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

Mitglied des Aufsichtsrates der Landesbank Berlin Investment GmbH,
Berlin

Steffen Selbach

Mitglied des Aufsichtsrates der bevestor GmbH,
Frankfurt am Main

(Stand 1. Januar 2017)

Abschlussprüfer der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
The Squire
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 447,9 Mio.

Eigenmittel: EUR 5.366 Mio.

(Stand: 31. Dezember 2016)

Haupttätigkeit

Giro-, Einlagen- und Kreditgeschäft
sowie Wertpapiergeschäft

**Zahl- und Informationsstelle in
Österreich**

Vorarlberger Landes- und
Hypotheckenbank Aktiengesellschaft
Hypo-Passage 1
6900 Bregenz
Österreich

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