DB platinum IV®

Société d'investissement à capital variable

R.C.S. Luxembourg B-85.828

Ungeprüfter Halbjahresbericht

zum 31. Juli 2017

Deutsche Bank

Zeichnungen auf Grundlage der Finanzberichte können nicht akzeptiert werden. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Basis des jeweils gültigen Prospekts in Verbindung mit dem zuletzt erschienenen Jahresbericht sowie dem zuletzt erschienenen Halbjahresbericht, sofern dieser nach dem Jahresbericht veröffentlicht wurde, erfolgen.

Die Gesellschaft ist als Umbrella-Fonds strukturiert. Sie hat die Absicht, Anteile einiger der Teilfonds in der Bundesrepublik Deutschland zu vertreiben. Der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht wurde dies für diese einzelnen Teilfonds der Gesellschaft angezeigt. Für alle anderen Teilfonds der Gesellschaft ist keine Anzeige bei der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht erstattet worden. Die Anteile solcher Teilfonds dürfen an Anleger in der Bundesrepublik Deutschland nicht vertrieben werden.

Bei den nicht zum Vertrieb angezeigten Anteilsklassen handelt es sich zum 31. Juli 2017 namentlich um:

- **DB Platinum IV CROCI US – Anteilsklasse R2C-E**
- **DB Platinum IV SYSTEMATIC ALPHA – Anteilsklassen R5C-U, R5C-G, R6C-U und R6C-G**
- **DB Platinum IV GAM ABSOLUTE RETURN EUROPE EQUITY – Anteilsklassen R1C-U, R1C-C, I1C-G, I1C-U, I1C-C, I2C-G, I3C-G, I3C-U und I3C-C)**

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Geschäftsführung und Verwaltung	4
Vermögensaufstellung	6
Kennzahlen zum 31. Juli 2017	10
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens	14
Statistik	18
Anlagebestand *	
DB Platinum IV Sovereign Plus	25
DB Platinum IV CROCI Euro	26
DB Platinum IV CROCI US	28
DB Platinum IV CROCI Japan	30
DB Platinum IV Systematic Alpha	31
DB Platinum IV CROCI Europe	33
DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	35
DB Platinum IV Basso	36
DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	40
DB Platinum IV Platow	41
DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control	43
Anhang zum Abschluss	46
Informationen an die Anteilsinhaber	162

* Strukturbedingt liegen für DB Platinum IV Institutional Fixed Income zum 31. Juli 2017 keine Angaben zum Anlagebestand vor.

DB Platinum IV

Geschäftsführung und Verwaltung

Sitz

DB Platinum IV
11-13, boulevard de la Foire
L-1528 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat

- Freddy Brausch, unabhängiges Verwaltungsratsmitglied, per Adresse Linklaters LLP, 35 avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg
- Alexander McKenna (Vorsitzender des Verwaltungsrats), Leiter der "Product Platform Passive Europe & Asia", Deutsche Bank AG, Niederlassung London, Winchester House, 1 Great Winchester Street, London EC2N 2DB, Vereinigtes Königreich
- Philippe Ah-Sun, Chief Operating Officer für Exchange Traded Funds (ETF) und Systematic UCITS, Deutsche Bank AG, Niederlassung London, Winchester House, 1 Great Winchester Street, London EC2N 2DB, Vereinigtes Königreich
- Petra Hansen, Director, Deutsche Asset Management S.A., 2, boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg
- Manooj Mistry, Leiter "Passive Asset Management EMEA", Deutsche Bank AG, Niederlassung London, Winchester House, 1 Great Winchester Street, London EC2N 2DB, Vereinigtes Königreich.

Verwahrstelle
RBC Investor Services Bank S.A.
14, Porte de France
L-4360 Esch-sur-Alzette
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungs-, Zahl- und Domiziliarstelle und Börsenzulassungsbeauftragte
RBC Investor Services Bank S.A.
14, Porte de France
L-4360 Esch-sur-Alzette
Großherzogtum Luxemburg

Register- und Transferstelle
RBC Investor Services Bank S.A.
14, Porte de France
L-4360 Esch-sur-Alzette
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft
Deutsche Asset Management S.A.
2, boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg
GroßherzogtumLuxemburg
(R.C.S. Luxembourg B-25.754)

Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

Anlageverwalter [1]
State Street Global Advisors Limited
20 Churchill Place, Canary Wharf
London E14 5HJ
Vereinigtes Königreich

GAM Investment Management (Switzerland) Ltd
Hardstrasse 201
CH-8037 Zürich
Schweiz

Basso Capital Management, L.P.
1266 East Main Street
Stamford, Connecticut 06902
Vereinigte Staaten von Amerika

Clinton Group, Inc.
510 Madison Avenue, 9th floor
New York City, New York 10022
Vereinigte Staaten von Amerika

Veritas Institutional GmbH
Messberg 4
D-20095 Hamburg
Deutschland

Portfoliomanager [2]
Winton Capital Management Limited
Grove House
27 Hammersmith Grove
London W6 ONE
Vereinigtes Königreich

Unabhängiger Abschlussprüfer (Réviseur d'Entreprises) der Gesellschaft
Ernst & Young S.A.
35E, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater der Gesellschaft
Linklaters LLP
35, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Alle hierin verwendeten Begriffe haben die ihnen im aktuellen Prospekt zugewiesene Bedeutung.

[1] Nur in Bezug auf bestimmte Teilfonds, wie in diesem Bericht näher beschrieben.
[2] Nur in Bezug auf den Teilfonds DB Platinum IV Systematic Alpha, wie in diesem Bericht näher beschrieben.

DB Platinum IV

Vermögensaufstellung
zum 31. Juli 2017

	Erläuterung	DB Platinum IV Sovereign Plus	DB Platinum IV CROCI Euro	DB Platinum IV CROCI US	DB Platinum IV CROCI Japan
		EUR	EUR	USD	JPY
AKTIVA					
Anlagebestand zum Marktwert		75.726.422	335.810.797	478.822.860	2.307.883.774
Optionen (Long-Position) zum Marktwert		0	0	0	0
Bankguthaben		543.385	1.896.758	561.515	36.148.106
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		0	0	1.499.467	0
Forderungen aus Zeichnungen		0	599.772	1.243	0
Forderungen aus Swap-Transaktionen	(8)	0	0	0	0
Zins- und Dividendenforderungen, netto		359.939	0	245.649	2.610.873
Zinsforderungen aus CFD		0	0	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	(9)	0	0	809.658	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	(10)	0	0	2.078	279.619
Nicht realisierter Nettogewinn aus CFD	(11)	0	0	0	0
Sonstige Aktiva		0	234.609	565	0
SUMME AKTIVA		**76.629.746**	**338.541.936**	**481.943.035**	**2.346.922.372**
PASSIVA					
Kontokorrentkredite		296	22.662	2.078	279.619
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		78.427	233.635	1.223.150	0
Zinsverbindlichkeiten		6	19	0	307
Zinsverbindlichkeiten aus CFD		0	0	0	0
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	(9)	0	43.921	0	1.120.654
Nicht realisierter Nettoverlust aus Futures	(10)	0	18.230	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	(8)	1.583.733	0	0	0
Verwaltungsgebühr	(5)	75.960	195.016	324.423	1.247.905
Anlageerfolgsprämie	(7)	0	0	0	0
Steuern und Aufwendungen		22.377	92.038	137.360	610.425
Sonstige Passiva		0	0	0	0
SUMME PASSIVA		**1.760.799**	**605.521**	**1.687.011**	**3.258.910**
NETTOVERMÖGEN INSGESAMT		**74.868.947**	**337.936.415**	**480.256.024**	**2.343.663.462**

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV

Vermögensaufstellung (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017

	Erläuterung	DB Platinum IV Systematic Alpha	DB Platinum IV Institutional Fixed Income	DB Platinum IV CROCI Europe	DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity
		USD	USD	EUR	EUR
AKTIVA					
Anlagebestand zum Marktwert		1.202.024.677	0	27.778.865	1.812.343
Optionen (Long-Position) zum Marktwert		0	0	0	0
Bankguthaben		363.677.631	17.170	68.316	424.566
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		0	0	0	0
Forderungen aus Zeichnungen		2.441.981	0	0	0
Forderungen aus Swap-Transaktionen	(8)	0	577.710.000	0	0
Zins- und Dividendenforderungen, netto		3.686.124	0	49.631	5
Zinsforderungen aus CFD		0	0	0	17
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	(9)	21.798.174	0	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	(10)	0	0	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus CFD	(11)	0	0	0	17
Sonstige Aktiva		33.311.530	0	22.068	123.863
SUMME AKTIVA		**1.626.940.117**	**577.727.170**	**27.918.880**	**2.360.811**
PASSIVA					
Kontokorrentkredite		221	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		84.646.126	0	23.769	0
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		24.587.713	0	0	0
Zinsverbindlichkeiten		0	0	0	1
Zinsverbindlichkeiten aus CFD		155.657	0	0	1.382
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	(9)	0	0	0	1.052
Nicht realisierter Nettoverlust aus Futures	(10)	2.143.143	0	1.069	0
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	(8)	0	64.080.088	0	0
Verwaltungsgebühr	(5)	1.768.164	22.491	12.562	2.112
Anlageerfolgsprämie	(7)	0	0	0	0
Steuern und Aufwendungen		629.234	128.883	7.752	1.652
Sonstige Passiva		33.077.146	0	0	76.961
SUMME PASSIVA		**147.007.404**	**64.231.462**	**45.152**	**83.160**
NETTOVERMÖGEN INSGESAMT		**1.479.932.713**	**513.495.708**	**27.873.728**	**2.277.651**

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV

Vermögensaufstellung (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017

	Erläuterung	DB Platinum IV Basso	DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	DB Platinum IV Platow	DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control
		USD	USD	EUR	EUR
AKTIVA					
Anlagebestand zum Marktwert		42.294.561	71.338.645	126.012.730	42.131.400
Optionen (Long-Position) zum Marktwert		2.772.591	0	0	0
Bankguthaben		26.136.114	8.522.757	7.876.222	5.093.399
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.599.295	0	904.357	0
Forderungen aus Zeichnungen		0	0	107.660	0
Forderungen aus Swap-Transaktionen	(8)	0	0	0	0
Zins- und Dividendenforderungen, netto		478.959	0	0	80.495
Zinsforderungen aus CFD		0	0	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	(9)	428.202	103.441	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	(10)	62.702	0	0	2.075
Nicht realisierter Nettogewinn aus CFD	(11)	696.873	20.547	0	0
Sonstige Aktiva		7.259.192	436.931.164	173.819	11.388
SUMME AKTIVA		**81.728.489**	**516.916.554**	**135.074.788**	**47.318.757**
PASSIVA					
Kontokorrentkredite		98.976	0	0	3.435
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		0	0	778.634	0
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		18.151.615	692.313	157.170	0
Zinsverbindlichkeiten		0	8	88	42
Zinsverbindlichkeiten aus CFD		404.634	238.706	0	0
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	(9)	0	0	0	0
Nicht realisierter Nettoverlust aus Futures	(10)	0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	(8)	0	0	0	0
Verwaltungsgebühr	(5)	63.540	147.104	99.955	39.404
Anlageerfolgsprämie	(7)	135.780	0	0	0
Steuern und Aufwendungen		28.481	52.674	105.476	18.639
Sonstige Passiva		8.877.089	434.189.562	0	18
SUMME PASSIVA		**27.760.115**	**435.320.367**	**1.141.323**	**61.538**
NETTOVERMÖGEN INSGESAMT		**53.968.374**	**81.596.187**	**133.933.465**	**47.257.219**

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV

Vermögensaufstellung (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017

		Gesamt
	Erläuterung	**EUR**
AKTIVA		
Anlagebestand zum Marktwert		2.149.023.373
Optionen (Long-Position) zum Marktwert		2.351.645
Bankguthaben		354.530.405
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.532.652
Forderungen aus Zeichnungen		2.779.716
Forderungen aus Swap-Transaktionen	(8)	489.999.757
Zins- und Dividendenforderungen, netto		4.251.189
Zinsforderungen aus CFD		17
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	(9)	19.626.347
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	(10)	59.167
Nicht realisierter Nettogewinn aus CFD	(11)	608.515
Sonstige Aktiva		405.571.867
SUMME AKTIVA		**3.432.334.650**
PASSIVA		
Kontokorrentkredite		114.438
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		72.597.216
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		38.344.355
Zinsverbindlichkeiten		166
Zinsverbindlichkeiten aus CFD		679.071
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	(9)	53.575
Nicht realisierter Nettoverlust aus Futures	(10)	1.837.061
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	(8)	55.934.925
Verwaltungsgebühr	(5)	2.407.209
Anlageerfolgsprämie	(7)	115.166
Steuern und Aufwendungen		1.080.974
Sonstige Passiva		403.930.722
SUMME PASSIVA		**577.094.878**
NETTOVERMÖGEN INSGESAMT		**2.855.239.772**

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV

Kennzahlen zum 31. Juli 2017

	DB Platinum IV Sovereign Plus	DB Platinum IV CROCI Euro	DB Platinum IV CROCI US	DB Platinum IV CROCI Japan
	EUR	EUR	USD	JPY
Nettoinventarwert je Anteil				
R1C	139,17	258,14	276,06	16.617,10
R1C-A	96,35	22,59	26,30	-
R1C-B	-	163,18	198,37	11.262,93
R1C-E (EUR)	-	-	163,34	196,82
R1C-U (USD)	-	96,32	-	-
R1D	91,90	134,62	-	-
R2C	-	243,07	264,91	16.137,93
R2C-E (EUR)	-	-	114,58	-
I1C	-	276,88	302,74	18.374,67
I1C-E (EUR)	-	-	138,41	148,61
I1C-U (USD)	-	-	-	152,14
I2C	-	27.681,33	30.276,77	-
R0C-E	-	152,57	-	-
R0C-G (GBP)	-	-	163,17	160,26
R0C-U	-	-	135,06	-
Anzahl der Anteile im Umlauf				
R1C	282.937,13	285.994,09	791.587,13	14.214,89
R1C-A	765,55	125.086,36	146.960,26	-
R1C-B	-	55.700,59	14.386,43	3.411,49
R1C-E	-	-	120.882,54	6.293,93
R1C-U	-	16.310,00	-	-
R1D	385.413,58	24.765,50	-	-
R2C	-	19.492,66	4.571,47	151,49
R2C-E	-	-	2.148,85	-
I1C	-	804.446,32	673.545,15	90.889,13
I1C-E	-	-	0,64	7.128,00
I1C-U	-	-	-	4.438,49
I2C	-	543,91	826,32	-
R0C-E	-	32.755,21	-	-
R0C-G	-	-	602,11	965,38
R0C-U	-	-	8.656,43	-

DB Platinum IV

Kennzahlen zum 31. Juli 2017 (Fortsetzung)

	DB Platinum IV Systematic Alpha	DB Platinum IV Institutional Fixed Income	DB Platinum IV CROCI Europe	DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity
	USD	USD	EUR	EUR
Nettoinventarwert je Anteil				
R1C-A (EUR)	10.520,01	-	-	-
R1C-C (CHF)	10.360,83	-	-	-
R1C-E (EUR)	11.762,99	-	-	-
R1C-E	-	-	103,05	-
R1C-G (GBP)	11.332,02	-	-	-
R1C-N (NOK)	91.531,76	-	-	-
R1C-S (SGD)	22.226,58	-	-	-
R1C-U	12.149,21	-	-	-
R5C-G (GBP)	9.997,59	-	-	-
R5C-U	9.989,41	-	-	-
R6C-C (CHF)	9.387,93	-	-	-
R6C-E (EUR)	9.974,45	-	-	-
R6C-G (GBP)	10.223,08	-	-	-
R6C-U	10.194,35	-	-	-
I1C-C (CHF)	108,66	-	-	-
I1C-E (EUR)	124,44	-	-	-
I1C-E	-	-	-	100,46
I1C-G (GBP)	118,12	-	-	94,41
I1C-U	126,35	-	-	-
I1C-U (USD)	-	-	-	102,21
I1D-G (GBP)	105,25	-	-	-
I1D-U	105,00	-	-	-
I2C-E	-	-	107,99	102,18
I4D (EUR)	-	98.627,71	-	-
I5C-E (EUR)	99,87	-	-	-
I5C-G (GBP)	95,22	-	-	-
I5C-U	102,05	-	-	-
I5D (EUR)	-	98.627,71	-	-
I5D-G (GBP)	95,60	-	-	-
I6D (EUR)	-	91.055,46	-	-
I7D (EUR)	-	82.834,72	-	-
I8D (EUR)	-	89.720,87	-	-
R0C-E	-	-	104,42	-
R0C-E (EUR)	10.937,04	-	-	-
R0C-G (GBP)	10.586,41	-	-	-
R0C-U	9.845,85	-	-	-

DB Platinum IV

Kennzahlen zum 31. Juli 2017 (Fortsetzung)

	DB Platinum IV Systematic Alpha	DB Platinum IV Institutional Fixed Income	DB Platinum IV CROCI Europe	DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity
Anzahl der Anteile im Umlauf				
R1C-A	50,77	-	-	-
R1C-C	1.208,38	-	-	-
R1C-E	3.613,06	-	-	-
R1C-E	-	-	52.729,50	-
R1C-G	266,17	-	-	-
R1C-N	2.292,20	-	-	-
R1C-S	218,22	-	-	-
R1C-U	6.867,70	-	-	-
R5C-G	21,46	-	-	-
R5C-U	602,91	-	-	-
R6C-C	12,19	-	-	-
R6C-E	884,77	-	-	-
R6C-G	3.611,69	-	-	-
R6C-U	2.423,52	-	-	-
I1C-C	155.944,72	-	-	-
I1C-E	3.265.489,60	-	-	-
I1C-E	-	-	-	10.512,00
I1C-G	795.452,32	-	-	315,39
I1C-U	676.475,87	-	-	-
I1C-U	-	-	-	1.055,00
I1D-G	22.432,46	-	-	-
I1D-U	18.530,87	-	-	-
I2C-E	-	-	193.980,27	10.735,00
I4D	-	200,00	-	-
I5C-E	1.963.273,25	-	-	-
I5C-G	43.828,14	-	-	-
I5C-U	563.800,82	-	-	-
I5D	-	200,00	-	-
I5D-G	1.280.660,04	-	-	-
I6D	-	2.000,00	-	-
I7D	-	1.500,00	-	-
I8D	-	1.000,00	-	-
R0C-E	-	-	14.291,96	-
R0C-E	1.104,11	-	-	-
R0C-G	1.294,84	-	-	-
R0C-U	964,57	-	-	-

DB Platinum IV

Kennzahlen zum 31. Juli 2017 (Fortsetzung)

	DB Platinum IV Basso	DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	DB Platinum IV Platow	DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control
	USD	USD	EUR	EUR
Nettoinventarwert je Anteil				
R1C	-	-	279,31	-
R1C-C (CHF)	-	7.920,34	-	-
R1C-E (EUR)	-	7.972,60	-	-
R1C-U	-	8.607,81	-	-
R3C-E (EUR)	9.978,84	-	-	-
R3C-U	10.220,12	-	-	-
R4C-E (EUR)	10.060,53	-	-	-
R4C-G (GBP)	10.141,76	-	-	-
R4C-U	10.311,53	-	-	-
I1C	-	-	3.692,96	-
I1C-C (CHF)	-	80,50	-	-
I1C-E (EUR)	100,42	81,84	-	-
I1C-G (GBP)	-	83,18	-	-
I1C-U	103,37	87,40	-	-
I1D	-	-	-	110,59
I2C-C (CHF)	-	84,30	-	-
I2C-E (EUR)	101,98	86,24	-	-
I2C-G (GBP)	-	85,80	-	-
I2C-U	-	89,52	-	-
I2D	-	-	-	107,73
I3C-E (EUR)	101,18	87,01	-	-
I3C-U	-	89,87	-	-
I4C-U	102,89	-	-	-
R0C-C (CHF)	-	8.063,42	-	-
R0C-E (EUR)	-	8.198,63	-	-
R0C-G (GBP)	-	8.268,29	-	-
R0C-U	-	8.433,94	-	-
Anzahl der Anteile im Umlauf				
R1C	-	-	267.798,43	-
R1C-C	-	23,92	-	-
R1C-E	-	384,28	-	-
R1C-U	-	3.444,36	-	-
R3C-E	1,00	-	-	-
R3C-U	1,00	-	-	-
R4C-E	130,96	-	-	-
R4C-G	11,24	-	-	-
R4C-U	35,64	-	-	-
I1C	-	-	16.012,75	-
I1C-C	-	35.457,13	-	-
I1C-E	176.578,13	25.155,02	-	-
I1C-G	-	3.134,00	-	-
I1C-U	46.824,74	251.649,85	-	-
I1D	-	-	-	304.082,00
I2C-C	-	146,00	-	-
I2C-E	101.907,16	28.554,78	-	-
I2C-G	-	98,86	-	-
I2C-U	-	40.136,31	-	-
I2D	-	-	-	126.500,00
I3C-E	56.161,35	2.333,83	-	-
I3C-U	-	83.463,73	-	-
I4C-U	69.763,83	-	-	-
R0C-C	-	32,63	-	-
R0C-E	-	138,04	-	-
R0C-G	-	17,44	-	-
R0C-U	-	516,85	-	-

DB Platinum IV

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für den am 31. Juli 2017 endenden Berichtszeitraum

	Erläuterung	DB Platinum IV Sovereign Plus EUR	DB Platinum IV CROCI Euro EUR	DB Platinum IV CROCI US USD	DB Platinum IV CROCI Japan JPY
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS		**85.121.768**	**284.432.894**	**541.789.932**	**4.026.030.823**
ERTRÄGE					
Dividenden aus Anteilen, netto		0	5.924.769	3.705.422	22.926.926
Zinsen aus Anleihen/Anleihen-CFD, netto		437.978	0	0	0
Zinsen aus Bankguthaben		0	1	2.264	1.102
Sonstige Erträge		0	0	0	0
ERTRÄGE INSGESAMT		**437.978**	**5.924.770**	**3.707.686**	**22.928.028**
AUFWENDUNGEN					
Verwaltungsgebühr	(5)	473.779	1.067.785	2.025.353	8.204.995
Anlageerfolgsprämie	(7)	0	0	0	0
Allokationsgebühr	(4)	0	0	0	0
Abonnementsteuer (Taxe d'Abonnement)	(3)	19.718	36.579	84.898	208.097
Bankgebühren		0	1.496	108	6.599
Zinsen		1.479	2.958	64	38.014
Zinsen aus CFD		0	0	0	0
Dividenden aus CFD, netto		0	0	0	0
Sonstige Gebühren		0	0	0	0
Fixgebühr	(6)	39.435	161.022	257.420	1.362.134
AUFWENDUNGEN INSGESAMT		**534.411**	**1.269.840**	**2.367.843**	**9.819.839**
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN		**(96.433)**	**4.654.930**	**1.339.843**	**13.108.189**
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wertpapierverkäufen		(2.164.924)	9.853.660	31.093.231	366.085.910
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus CFD		0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps		396.040	0	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen		0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften		0	(21.973)	1.753.903	11.204.629
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Futures		0	56.030	27.643	2.617.767
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) im Zusammenhang mit Fremdwährungen		568	4.484	(3.848)	(54.729)
REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST)		**(1.864.749)**	**14.547.131**	**34.210.772**	**392.961.766**
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Wertpapieren, netto		(3.372.360)	17.714.022	10.043.678	(177.119.921)
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Futures, netto		0	(16.840)	873	(116.631)
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Devisentermingeschäften, netto		0	(43.921)	(338.139)	5.355.330
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus CFD, netto		0	0	0	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Swaps, netto		3.103.559	0	0	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Optionen, netto		0	0	0	0
NETTOERHÖHUNG / (NETTOMINDERUNG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT		**(2.133.550)**	**32.200.392**	**43.917.184**	**221.080.544**
KAPITALENTWICKLUNG					
Zeichnungen von Anteilen		25.101	65.452.910	8.202.415	38.960.000
Rücknahmen von Anteilen		(8.144.372)	(44.099.103)	(113.653.507)	(1.942.407.905)
Gezahlte Ausschüttungen	(16)	0	(50.678)	0	0
Währungsumrechnung		0	0	0	0
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS		**74.868.947**	**337.936.415**	**480.256.024**	**2.343.663.462**

Eventuelle Inkonsistenzen bei den Zahlen zur Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts), netto, sind auf Rundungsabweichungen zurückzuführen.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens (Fortsetzung) für den am 31. Juli 2017 endenden Berichtszeitraum

	Erläuterung	DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 (zum 06.04.2017 vollständing zurück-genommen) EUR	DB Platinum IV Systematic Alpha USD	DB Platinum IV Institutional Fixed Income USD	DB Platinum IV CROCI Europe EUR
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS		**103.043.233**	**1.853.768.420**	**1.286.444.588**	**21.572.527**
ERTRÄGE					
Dividenden aus Anteilen, netto		0	0	0	509.771
Zinsen aus Anleihen/Anleihen-CFD, netto		0	7.818.479	49.825	0
Zinsen aus Bankguthaben		0	1.538.531	0	8
Sonstige Erträge		0	0	0	440
ERTRÄGE INSGESAMT		**0**	**9.357.010**	**49.825**	**510.219**
AUFWENDUNGEN					
Verwaltungsgebühr	(5)	21.223	13.127.090	139.193	70.111
Anlageerfolgsprämie	(7)	0	0	0	0
Allokationsgebühr	(4)	0	0	0	0
Abonnementsteuer (Taxe d'Abonnement)	(3)	0	143.430	0	3.069
Bankgebühren		0	602.767	0	25
Zinsen		169	174.750	191	197
Zinsen aus CFD		0	1.376.128	0	0
Dividenden aus CFD, netto		0	128.843	0	0
Sonstige Gebühren		0	724	0	0
Fixgebühr	(6)	8.489	1.234.050	286.114	13.719
AUFWENDUNGEN INSGESAMT		**29.881**	**16.787.782**	**425.498**	**87.121**
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN		**(29.881)**	**(7.430.772)**	**(375.673)**	**423.098**
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wertpapierverkäufen		0	(34.079.065)	0	1.251.985
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus CFD		0	17.524.190	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps		22.396.449	0	319.227.962	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen		0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften		0	101.174.890	0	(242)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Futures		0	34.970.833	0	5.233
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) im Zusammenhang mit Fremdwährungen		(65.528)	(229.384)	33.992.014	(3.914)
REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST)		**22.301.040**	**111.930.692**	**352.844.303**	**1.676.160**
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Wertpapieren, netto		0	7.613.962	0	64.002
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Futures, netto		0	(4.734.533)	0	391
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Devisentermingeschäften, netto		0	(23.341.472)	0	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus CFD, netto		0	0	0	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Swaps, netto		(20.505.184)	0	(328.365.227)	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Optionen, netto		0	0	0	0
NETTOERHÖHUNG / (NETTOMINDERUNG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT		**1.795.856**	**91.468.649**	**24.479.076**	**1.740.553**
KAPITALENTWICKLUNG					
Zeichnungen von Anteilen		0	236.819.107	46.574.000	5.702.030
Rücknahmen von Anteilen		(104.328.589)	(702.123.463)	(844.001.956)	(1.141.382)
Gezahlte Ausschüttungen	(16)	(510.500)	0	0	0
Währungsumrechnung		0	0	0	0
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS		**0**	**1.479.932.713**	**513.495.708**	**27.873.728**

Eventuelle Inkonsistenzen bei den Zahlen zur Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts), netto, sind auf Rundungsabweichungen zurückzuführen.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens (Fortsetzung) für den am 31. Juli 2017 endenden Berichtszeitraum

	Erläuterung	DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	DB Platinum IV Basso	DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	DB Platinum IV Platow
		EUR	USD	USD	EUR
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS		**25.998.241**	**131.669.782**	**422.008.578**	**114.731.269**
ERTRÄGE					
Dividenden aus Anteilen, netto		0	10.852	0	1.527.220
Zinsen aus Anleihen/Anleihen-CFD, netto		5.330	1.884.391	0	0
Zinsen aus Bankguthaben		2.318	43.315	97.158	1
Sonstige Erträge		0	0	0	0
ERTRÄGE INSGESAMT		**7.648**	**1.938.558**	**97.158**	**1.527.221**
AUFWENDUNGEN					
Verwaltungsgebühr	(5)	44.115	437.368	2.377.744	554.326
Anlageerfolgsprämie	(7)	0	3.950	0	0
Allokationsgebühr	(4)	0	0	0	383.179
Abonnementsteuer (Taxe d'Abonnement)	(3)	162	4.482	22.987	20.520
Bankgebühren		46.968	3.648	448.949	0
Zinsen		257	1.241	0	11.420
Zinsen aus CFD		21.288	1.686.349	4.501.626	0
Dividenden aus CFD, netto		76.112	1.357.883	1.166.028	0
Sonstige Gebühren		24.948	0	0	0
Fixgebühr	(6)	5.752	61.795	184.233	62.515
AUFWENDUNGEN INSGESAMT		**219.602**	**3.556.716**	**8.701.567**	**1.031.960**
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN		**(211.954)**	**(1.618.158)**	**(8.604.409)**	**495.261**
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wertpapierverkäufen		(143.123)	1.982.138	812.995	8.082.929
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus CFD		391.246	817.696	(17.034.637)	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps		0	(10.354)	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen		0	(84.086)	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften		(79.913)	4.261.307	1.998.226	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Futures		0	(239.639)	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) im Zusammenhang mit Fremdwährungen		(21.298)	(84.554)	161.004	(64)
REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST)		**(65.042)**	**5.024.350**	**(22.666.821)**	**8.578.126**
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Wertpapieren, netto		118.344	(1.019.281)	(205.216)	12.832.945
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Futures, netto		0	91.004	0	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Devisentermingeschäften, netto		32.258	(573.758)	(781.714)	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus CFD, netto		(253)	60.011	1.750.235	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Swaps, netto		0	0	0	0
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Optionen, netto		0	438.233	0	0
NETTOERHÖHUNG / (NETTOMINDERUNG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT		**85.307**	**4.020.559**	**(21.903.516)**	**21.411.071**
KAPITALENTWICKLUNG					
Zeichnungen von Anteilen		1.105.125	5.495.110	6.415.497	11.349.422
Rücknahmen von Anteilen		(24.911.022)	(87.217.077)	(324.924.372)	(13.558.297)
Gezahlte Ausschüttungen	(16)	0	0	0	0
Währungsumrechnung		0	0	0	0
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS		**2.277.651**	**53.968.374**	**81.596.187**	**133.933.465**

Eventuelle Inkonsistenzen bei den Zahlen zur Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts), netto, sind auf Rundungsabweichungen zurückzuführen.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens (Fortsetzung) für den am 31. Juli 2017 endenden Berichtszeitraum

	Erläuterung	DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control EUR	Gesamt EUR
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS		**36.582.593**	**4.623.962.533**
ERTRÄGE			
Dividenden aus Anteilen, netto		687.762	11.977.562
Zinsen aus Anleihen/Anleihen-CFD, netto		0	8.715.309
Zinsen aus Bankguthaben		567	1.428.915
Sonstige Erträge		0	440
ERTRÄGE INSGESAMT		**688.329**	**22.122.226**
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	(5)	236.657	17.888.684
Anlageerfolgsprämie	(7)	0	3.350
Allokationsgebühr	(4)	0	383.179
Abonnementsteuer (Taxe d'Abonnement)	(3)	2.533	301.139
Bankgebühren		1.060	944.826
Zinsen		8.993	175.252
Zinsen aus CFD		0	6.436.979
Dividenden aus CFD, netto		0	2.326.115
Sonstige Gebühren		0	25.562
Fixgebühr	(6)	36.754	2.054.522
AUFWENDUNGEN INSGESAMT		**285.997**	**30.539.608**
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN		**402.332**	**(8.417.382)**
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wertpapierverkäufen		1.917.951	21.446.806
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus CFD		0	1.500.023
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps		0	293.545.204
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen		0	(71.320)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften		0	92.594.797
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Futures		473.267	30.036.236
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) im Zusammenhang mit Fremdwährungen		(113.248)	28.498.812
REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST)		**2.680.302**	**459.133.176**
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Wertpapieren, netto		(1.370.734)	38.564.843
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Futures, netto		(10.500)	(3.965.633)
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Devisentermingeschäften, netto		0	(21.204.712)
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus CFD, netto		0	1.535.154
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Swaps, netto		0	(295.913.130)
Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (Wertverlustes) aus Optionen, netto		0	371.698
NETTOERHÖHUNG / (NETTOMINDERUNG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT		**1.299.068**	**178.521.396**
KAPITALENTWICKLUNG			
Zeichnungen von Anteilen		17.231.806	358.592.066
Rücknahmen von Anteilen		(6.601.038)	(1.975.046.862)
Gezahlte Ausschüttungen	(16)	(1.255.210)	(1.816.388)
Währungsumrechnung		0	(328.972.973)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS		**47.257.219**	**2.855.239.772**

Eventuelle Inkonsistenzen bei den Zahlen zur Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts), netto, sind auf Rundungsabweichungen zurückzuführen.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

DB Platinum IV
Statistik

	DB Platinum IV Sovereign Plus	DB Platinum IV CROCI Euro	DB Platinum IV CROCI US	DB Platinum IV CROCI Japan
	EUR	EUR	USD	JPY
Gesamtnettoinventarwert				
31. Juli 2017	74.868.947	337.936.415	480.256.024	2.343.663.462
31. Januar 2017	85.121.768	284.432.894	541.789.932	4.026.030.823
31. Januar 2016	98.649.504	243.253.934	817.742.870	11.748.585.408
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Juli 2017				
R1C	139,17	258,14	276,06	16.617,10
R1C-A	96,35	22,59	26,30	-
R1C-B	-	163,18	198,37	11.262,93
R1C-E (EUR)	-	-	163,34	196,82
R1C-U (USD)	-	96,32	-	-
R1D	91,90	134,62	-	-
R2C	-	243,07	264,91	16.137,93
R2C-E (EUR)	-	-	114,58	-
I1C	-	276,88	302,74	18.374,67
I1C-E (EUR)	-	-	138,41	148,61
I1C-U (USD)	-	-	-	152,14
I2C	-	27.681,33	30.276,77	-
R0C-E	-	152,57	-	-
R0C-G (GBP)	-	-	163,17	160,26
R0C-U	-	-	135,06	-
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Januar 2017				
R1C	142,84	232,58	254,64	15.591,61
R1C-A	99,52	20,38	24,29	-
R1C-B	-	147,61	183,71	10.609,84
R1C-E (EUR)	-	-	152,11	185,72
R1D	94,32	123,75	-	-
R2C	-	219,54	244,96	15.179,58
R2C-E (EUR)	-	-	115,70	-
I1C	-	248,80	278,51	17.195,25
I1C-E (EUR)	-	-	140,66	139,75
I1C-U (USD)	-	-	-	141,70
I1D-E (EUR)	-	-	103,12	-
I2C	-	24.873,70	27.853,00	-
R0C-E	-	137,13	-	-
R0C-G (GBP)	-	-	157,32	154,28
R0C-U	-	-	124,27	-
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Januar 2016				
R1C	142,69	206,84	204,68	13.563,99
R1C-A	100,73	18,18	19,58	-
R1C-B	-	132,33	148,84	9.303,52
R1C-E (EUR)	-	-	124,35	164,28
R1D	94,22	112,06	-	-
R2C	-	196,23	197,88	13.270,57
R2C-E (EUR)	-	-	93,54	-
I1C	-	220,06	222,65	14.879,18
I1C-E (EUR)	-	-	113,98	122,44
I1C-U (USD)	-	-	-	122,61
I1D-E (EUR)	-	-	85,30	-
I2C	-	22.000,29	22.265,46	-
R0C-E	-	121,34	-	-
R0C-G (GBP)	-	-	111,58	110,13
R0C-U	-	-	99,38	-

DB Platinum IV

Statistik (Fortsetzung)

	DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 (zum 06.04.2017 vollständing zurück-genommen)	DB Platinum IV Systematic Alpha	DB Platinum IV Institutional Fixed Income	DB Platinum IV CROCI Europe
	EUR	USD	USD	EUR
Gesamtnettoinventarwert				
31. Juli 2017	-	1.479.932.713	513.495.708	27.873.728
31. Januar 2017	103.043.233	1.853.768.420	1.286.444.588	21.572.527
31. Januar 2016	132.847.634	2.102.393.068	1.071.444.607	18.551.570
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Juli 2017				
R1C-A (EUR)	-	10.520,01	-	-
R1C-C (CHF)	-	10.360,83	-	-
R1C-E (EUR)	-	11.762,99	-	-
R1C-E	-	-	-	103,05
R1C-G (GBP)	-	11.332,02	-	-
R1C-N (NOK)	-	91.531,76	-	-
R1C-S (SGD)	-	22.226,58	-	-
R1C-U	-	12.149,21	-	-
R5C-G (GBP)	-	9.997,59	-	-
R5C-U	-	9.989,41	-	-
R6C-C (CHF)	-	9.387,93	-	-
R6C-E (EUR)	-	9.974,45	-	-
R6C-G (GBP)	-	10.223,08	-	-
R6C-U	-	10.194,35	-	-
I1C-C (CHF)	-	108,66	-	-
I1C-E (EUR)	-	124,44	-	-
I1C-G (GBP)	-	118,12	-	-
I1C-U	-	126,35	-	-
I1D-G (GBP)	-	105,25	-	-
I1D-U	-	105,00	-	-
I2C-E	-	-	-	107,99
I4D (EUR)	-	-	98.627,71	-
I5C-E (EUR)	-	99,87	-	-
I5C-G (GBP)	-	95,22	-	-
I5C-U	-	102,05	-	-
I5D (EUR)	-	-	98.627,71	-
I5D-G (GBP)	-	95,60	-	-
I6D (EUR)	-	-	91.055,46	-
I7D (EUR)	-	-	82.834,72	-
I8D (EUR)	-	-	89.720,87	-
R0C-E	-	-	-	104,42
R0C-E (EUR)	-	10.937,04	-	-
R0C-G (GBP)	-	10.586,41	-	-
R0C-U	-	9.845,85	-	-

DB Platinum IV
Statistik (Fortsetzung)

	DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 (zum 06.04.2017 vollständing zurück-genommen) EUR	DB Platinum IV Systematic Alpha USD	DB Platinum IV Institutional Fixed Income USD	DB Platinum IV CROCI Europe EUR
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Januar 2017				
R1C-A (EUR)	-	10.635,52	-	-
R1C-C (CHF)	-	10.485,59	-	-
R1C-E (EUR)	-	11.867,88	-	-
R1C-G (GBP)	-	11.399,05	-	-
R1C-N (NOK)	-	91.706,27	-	-
R1C-S (SGD)	-	22.298,60	-	-
R1C-U	-	12.169,62	-	-
R5C-C (CHF)	-	9.370,09	-	-
R5C-E (EUR)	-	9.452,94	-	-
R5C-G (GBP)	-	10.044,38	-	-
R5C-U	-	9.999,70	-	-
R6C-C (CHF)	-	9.457,81	-	-
R6C-E (EUR)	-	10.012,85	-	-
R6C-G (GBP)	-	10.234,48	-	-
R6C-U	-	10.166,24	-	-
I1C-C (CHF)	-	109,49	-	-
I1C-E (EUR)	-	124,95	-	-
I1C-G (GBP)	-	118,20	-	-
I1C-U	-	126,06	-	-
I1D (EUR)	-	-	110.694,32	-
I1D-G (GBP)	-	105,34	-	-
I1D-S (SEK)	112.737,68	-	-	-
I1D-U	-	104,76	-	-
I2C-E	-	-	-	100,54
I2D (EUR)	-	-	286.971,29	-
I2D-E	132.180,06	-	-	-
I4D (EUR)	-	-	189.919,52	-
I5C-E (EUR)	-	100,30	-	-
I5C-G (GBP)	-	95,30	-	-
I5C-U	-	101,75	-	-
I5D (EUR)	-	-	187.604,25	-
I5D-G (GBP)	-	95,59	-	-
I6D (EUR)	-	-	90.544,43	-
I7D (EUR)	-	-	85.395,74	-
I8D (EUR)	-	-	88.534,19	-
R0C-E	-	-	-	97,29
R0C-E (EUR)	-	10.989,11	-	-
R0C-G (GBP)	-	10.602,33	-	-
R0C-U	-	9.825,53	-	-

DB Platinum IV
Statistik (Fortsetzung)

	DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 (zum 06.04.2017 vollständing zurück-genommen) EUR	DB Platinum IV Systematic Alpha USD	DB Platinum IV Institutional Fixed Income USD	DB Platinum IV CROCI Europe EUR
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Januar 2016				
R1C-A (EUR)	-	11.664,95	-	-
R1C-C (CHF)	-	11.538,45	-	-
R1C-E (EUR)	-	12.978,84	-	-
R1C-G (GBP)	-	12.280,00	-	-
R1C-N (NOK)	-	98.841,92	-	-
R1C-S (SGD)	-	24.018,00	-	-
R1C-U	-	13.126,68	-	-
R5C-C (CHF)	-	10.297,43	-	-
R5C-E (EUR)	-	10.320,68	-	-
R5C-G (GBP)	-	10.821,40	-	-
R5C-U	-	10.767,93	-	-
R6C-C (CHF)	-	10.316,06	-	-
R6C-E (EUR)	-	10.844,17	-	-
R6C-G (GBP)	-	10.935,91	-	-
R6C-U	-	10.866,53	-	-
I1C-C (CHF)	-	119,47	-	-
I1C-E (EUR)	-	135,43	-	-
I1C-G (GBP)	-	126,44	-	-
I1C-U	-	134,89	-	-
I1D (EUR)	-	-	104.998,91	-
I1D-G (GBP)	-	112,65	-	-
I1D-S (SEK)	108.301,12	-	-	-
I1D-U	-	112,10	-	-
I2C-E	-	-	-	88,25
I2D (EUR)	-	-	297.802,98	-
I2D-E	132.250,15	-	-	-
I4D (EUR)	-	-	185.387,68	-
I5C-E (EUR)	-	108,53	-	-
I5C-U	-	108,72	-	-
I5D (EUR)	-	-	198.831,73	-
I5D-G (GBP)	-	102,30	-	-
I6D (EUR)	-	-	97.730,40	-
R0C-E	-	-	-	85,52
R0C-E (EUR)	-	11.935,33	-	-
R0C-G (GBP)	-	11.348,95	-	-
R0C-U	-	10.518,09	-	-

DB Platinum IV
Statistik (Fortsetzung)

	DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	DB Platinum IV Basso	DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	DB Platinum IV Platow
	EUR	USD	USD	EUR
Gesamtnettoinventarwert				
31. Juli 2017	2.277.651	53.968.374	81.596.187	133.933.465
31. Januar 2017	25.998.241	131.669.782	422.008.578	114.731.269
31. Januar 2016	121.832.232	161.330.369	304.595.768	106.657.065
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Juli 2017				
R1C	-	-	-	279,31
R1C-C (CHF)	-	-	7.920,34	-
R1C-E (EUR)	-	-	7.972,60	-
R1C-U	-	-	8.607,81	-
R3C-E (EUR)	-	9.978,84	-	-
R3C-U	-	10.220,12	-	-
R4C-E (EUR)	-	10.060,53	-	-
R4C-G (GBP)	-	10.141,76	-	-
R4C-U	-	10.311,53	-	-
I1C	-	-	-	3.692,96
I1C-C (CHF)	-	-	80,50	-
I1C-E (EUR)	-	100,42	81,84	-
I1C-E	100,46	-	-	-
I1C-G (GBP)	94,41	-	83,18	-
I1C-U	-	103,37	87,40	-
I1C-U (USD)	102,21	-	-	-
I2C-C (CHF)	-	-	84,30	-
I2C-E (EUR)	-	101,98	86,24	-
I2C-E	102,18	-	-	-
I2C-G (GBP)	-	-	85,80	-
I2C-U	-	-	89,52	-
I3C-E (EUR)	-	101,18	87,01	-
I3C-U	-	-	89,87	-
I4C-U	-	102,89	-	-
R0C-C (CHF)	-	-	8.063,42	-
R0C-E (EUR)	-	-	8.198,63	-
R0C-G (GBP)	-	-	8.268,29	-
R0C-U	-	-	8.433,94	-

DB Platinum IV
Statistik (Fortsetzung)

	DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	DB Platinum IV Basso	DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	DB Platinum IV Platow
	EUR	USD	USD	EUR
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Januar 2017				
R1C	-	-	-	234,55
R1C-C (CHF)	-	-	8.733,75	-
R1C-E (EUR)	-	10.047,51	8.746,15	-
R1C-E	9.762,54	-	-	-
R1C-U (USD)	9.869,46	-	-	-
R1C-U	-	10.255,67	9.368,26	-
R3C-E (EUR)	-	10.112,42	-	-
R3C-U	-	10.242,41	-	-
R4C-E (EUR)	-	10.145,91	-	-
R4C-G (GBP)	-	10.208,09	-	-
R4C-U	-	10.302,82	-	-
I1C	-	-	-	3.100,53
I1C-C (CHF)	93,32	-	88,43	-
I1C-E (EUR)	-	101,46	89,50	-
I1C-E	98,93	-	-	-
I1C-G (GBP)	92,90	-	90,72	-
I1C-U	-	103,47	94,77	-
I1C-U (USD)	99,98	-	-	-
I2C-C (CHF)	-	-	92,87	-
I2C-E (EUR)	-	102,76	94,09	-
I2C-E	100,39	-	-	-
I2C-G (GBP)	-	-	93,24	-
I2C-U	-	-	96,82	-
I3C-C (CHF)	-	100,70	-	-
I3C-E (EUR)	-	102,04	94,98	-
I3C-U	-	104,46	97,11	-
I4C-E (EUR)	-	101,17	-	-
I4C-U	-	102,86	-	-
R0C-C (CHF)	-	-	8.861,24	-
R0C-E (EUR)	-	-	8.967,10	-
R0C-G (GBP)	-	-	9.020,01	-
R0C-U	-	-	9.146,27	-
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
31. Januar 2016				
R1C	-	-	-	212,89
R1C-C (CHF)	-	-	10.435,96	-
R1C-E (EUR)	-	9.849,91	10.402,37	-
R1C-E	10.379,43	-	-	-
R1C-U (USD)	10.381,99	-	-	-
R1C-U	-	9.918,47	10.913,00	-
I1C	-	-	-	2.813,06
I1C-C (CHF)	99,44	-	104,48	-
I1C-E (EUR)	-	98,86	105,12	-
I1C-E	104,39	-	-	-
I1C-G (GBP)	98,00	-	105,23	-
I1C-U	-	99,49	109,55	-
I1C-U (USD)	104,45	-	-	-
I2C-C (CHF)	103,85	-	108,88	-
I2C-E (EUR)	-	99,51	109,59	-
I2C-E	105,28	-	-	-
I2C-G (GBP)	105,05	-	107,42	-
I2C-U	-	-	110,48	-
I2C-U (USD)	105,16	-	-	-
I3C-C (CHF)	-	98,41	-	-
I3C-E (EUR)	-	98,92	110,53	-
I3C-U	-	99,92	110,75	-
I4C-E (EUR)	-	98,28	-	-
I4C-U	-	98,64	-	-
R0C-C (CHF)	-	-	10.522,67	-
R0C-E (EUR)	-	-	10.552,63	-
R0C-G (GBP)	-	-	10.574,48	-
R0C-U	-	-	10.582,09	-

DB Platinum IV
Statistik (Fortsetzung)

	DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control
	EUR
Gesamtnettoinventarwert	
31. Juli 2017	47.257.219
31. Januar 2017	36.582.593
31. Januar 2016	21.648.905
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums	
31. Juli 2017	
I1D	110,59
I2D	107,73
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums	
31. Januar 2017	
I1D	110,07
I2D	107,24
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums	
31. Januar 2016	
I1D	101,74
I2D	99,06

DB Platinum IV

DB Platinum IV Sovereign Plus

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Anleihen					
Belgien					
Belgium 0.8% 17-22.06.27 Regs	5.000.000	EUR	4.940.500	4.990.000	6,66
			4.940.500	**4.990.000**	**6,66**
Deutschland					
Germany 0% 94-25 /int.strip	8.900.000	EUR	8.908.670	9.026.692	12,06
Germany 0% 97-4.7.23 Strip Io	14.800.000	EUR	14.478.201	14.729.700	19,68
Germany 0.5% 16-15.02.26	1.000.000	EUR	1.025.300	1.015.320	1,36
			24.412.171	**24.771.712**	**33,10**
Frankreich					
Credit Agr Cov 4% 10-16.7.25	500.000	EUR	585.844	630.790	0,84
Crh 3.6 % 12-08.03.24	4.000.000	EUR	4.526.300	4.841.380	6,47
Dexia Clf 2.125% 15-12.02.25	1.700.000	GBP	2.252.617	1.968.677	2,63
France 3.5% 10-25.04.26 Oat	6.000.000	EUR	7.605.000	7.488.000	10,00
			14.969.761	**14.928.847**	**19,94**
Italien					
Db Milan 0% 12-01.10.19	700.000	EUR	634.550	689.990	0,92
			634.550	**689.990**	**0,92**
Japan					
Japan 0.1% 15-15.09.17	570.100.000	JPY	4.379.945	4.377.048	5,85
Japan 0.1% 15-15.12.17	1.500.000.000	JPY	11.641.759	11.522.284	15,39
Japan 0.2% 12-20.09.17	160.950.000	JPY	1.212.316	1.235.970	1,65
			17.234.020	**17.135.302**	**22,89**
Niederlande					
Bng 2.25% 05-14.10.20	13.800.000	CHF	14.782.370	13.210.571	17,64
			14.782.370	**13.210.571**	**17,64**
Anleihen - Insgesamt			**76.973.372**	**75.726.422**	**101,15**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**76.973.372**	**75.726.422**	**101,15**
SUMME ANLAGEBESTAND			**76.973.372**	**75.726.422**	**101,15**

DB Platinum IV

DB Platinum IV CROCI Euro

Anlagebestand zum 31. Juli 2017

(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Aktien					
Belgien					
Ucb	183.844	EUR	12.040.063	11.317.437	3,35
			12.040.063	**11.317.437**	**3,35**
Deutschland					
Basf Namen-akt.	136.985	EUR	10.524.426	11.039.621	3,27
Bayer Ag	96.660	EUR	10.441.901	10.357.119	3,06
Continental Ag	57.627	EUR	9.685.987	10.977.944	3,25
Deutsche Post Ag	359.485	EUR	9.932.306	11.791.108	3,49
E.on Se	1.428.383	EUR	12.955.901	11.945.568	3,54
Fresenius Medical Care Ag	134.435	EUR	8.547.694	10.726.569	3,17
Henkel / Vorzug	91.459	EUR	9.851.769	10.952.215	3,24
Linde A.g.	66.118	EUR	9.337.891	10.697.892	3,17
Merck Kgaa	107.738	EUR	8.501.253	10.003.473	2,96
Siemens Ag /nam.	90.131	EUR	9.122.410	10.342.532	3,06
			98.901.538	**108.834.041**	**32,21**
Frankreich					
Cap Gemini Sa	124.523	EUR	9.666.089	11.456.116	3,39
Danone	173.053	EUR	10.102.909	10.917.914	3,23
Engie	845.250	EUR	13.099.961	11.499.626	3,40
Kering Act.	39.313	EUR	7.046.202	11.616.991	3,43
L Oreal	60.447	EUR	8.801.195	10.584.270	3,13
Lvmh Act.	51.095	EUR	7.527.049	10.867.907	3,22
Michelin B /nom.	100.472	EUR	8.867.213	11.488.973	3,40
Pernod-ricard	95.862	EUR	10.029.178	11.239.820	3,33
Safran Sa	145.602	EUR	9.065.565	11.637.967	3,43
Sanofi	130.852	EUR	10.077.432	10.562.373	3,13
Schneider Electric Se	170.574	EUR	10.083.068	11.317.585	3,35
Veolia Environnement	585.409	EUR	9.358.772	11.154.969	3,30
			113.724.633	**134.344.511**	**39,74**
Irland					
Crh Plc	364.664	EUR	8.902.036	10.828.697	3,20
Ryanair Holdings Plc	635.967	EUR	6.844.938	11.297.954	3,35
			15.746.974	**22.126.651**	**6,55**
Luxemburg					
Arcelormittal Sa	627.156	EUR	14.099.776	13.919.727	4,12
			14.099.776	**13.919.727**	**4,12**
Niederlande					
Akzo Nobel Nv (eur 2)	151.654	EUR	9.617.917	11.589.399	3,43
Koninklijke Dsm Nv	176.625	EUR	9.599.750	11.017.868	3,26

DB Platinum IV

DB Platinum IV CROCI Euro

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017

(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren (Fortsetzung)					
Aktien (Fortsetzung)					
Niederlande (Fortsetzung)					
Royal Philips Nv /eur 0.2	366.195	EUR	10.794.790	11.857.393	3,51
			30.012.457	**34.464.660**	**10,20**
Spanien					
Iberdrola Sa	1.621.214	EUR	7.982.883	10.803.770	3,20
			7.982.883	**10.803.770**	**3,20**
Aktien - Insgesamt			**292.508.324**	**335.810.797**	**99,37**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**292.508.324**	**335.810.797**	**99,37**
SUMME ANLAGEBESTAND			**292.508.324**	**335.810.797**	**99,37**

DB Platinum IV

DB Platinum IV CROCI US

Anlagebestand zum 31. Juli 2017

(Angaben in USD)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Aktien					
Bermudas					
Signet Jewelers Ltd	215.495	USD	13.635.301	13.179.674	2,74
			13.635.301	**13.179.674**	**2,74**
Jersey					
Delphi Automotive Plc	131.126	USD	9.253.844	11.856.413	2,47
			9.253.844	**11.856.413**	**2,47**
Niederlande					
Lyondellbasell Ind Nv -a-	146.537	USD	12.064.727	13.201.519	2,75
Mylan N.v.	299.451	USD	13.708.917	11.675.594	2,43
			25.773.644	**24.877.113**	**5,18**
Vereinigte Staaten					
Abbvie Inc	173.086	USD	10.682.323	12.100.442	2,52
Alexion Pharma Inc	114.640	USD	11.632.107	15.744.658	3,27
Amgen Inc	73.051	USD	11.361.227	12.748.130	2,65
Apple Inc	75.133	USD	6.826.136	11.174.531	2,33
Applied Materials Inc	250.037	USD	4.890.174	11.079.139	2,31
Bed Bath & Beyond Inc.	340.642	USD	14.689.182	10.185.196	2,12
Biogen Inc	45.175	USD	11.886.503	13.082.228	2,72
Borg Warner Inc	263.029	USD	10.779.223	12.293.975	2,56
Cbs Corp -b- /when Issued	191.355	USD	10.065.204	12.596.900	2,62
Celgene Corp.	99.244	USD	11.599.887	13.438.630	2,80
Cisco Systems Inc.	372.030	USD	9.162.458	11.700.344	2,44
Delta Air Lines	225.339	USD	9.269.836	11.122.733	2,32
Discovery Com Inc/-a-	441.755	USD	12.405.946	10.867.173	2,26
Dollar General Corporation	154.663	USD	11.142.779	11.624.471	2,42
Dr Horton Inc	349.191	USD	11.074.848	12.462.627	2,59
General Motors Co	341.637	USD	12.845.616	12.292.099	2,56
Gilead Sciences Inc.	179.932	USD	16.185.678	13.691.026	2,84
Goodyear Tire & Rubber	334.734	USD	9.239.996	10.547.468	2,20
Hasbro Inc.	107.899	USD	8.909.760	11.424.346	2,38
Ibm	76.323	USD	13.042.125	11.041.648	2,30
Juniper Networks Inc.	385.991	USD	9.686.457	10.788.448	2,25
Kla Tencor Corporation	107.803	USD	7.577.344	9.985.792	2,08
L Brands Inc	230.553	USD	11.591.559	10.695.354	2,23
Lam Research Corp	72.175	USD	8.540.533	11.509.026	2,40
Mckesson Corp	71.683	USD	10.434.692	11.603.327	2,42
Merck	180.729	USD	9.879.931	11.544.969	2,40
Southwest Airlines Co	192.716	USD	7.873.055	10.697.665	2,23
Target Corp	211.585	USD	13.848.932	11.990.522	2,50
Tegna Inc	813.763	USD	11.629.650	12.068.105	2,51
Time Warner	116.540	USD	8.322.863	11.936.027	2,49

DB Platinum IV

DB Platinum IV CROCI US

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren (Fortsetzung)					
Aktien (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)					
Tyson Foods Inc.-a-	195.111	USD	11.224.782	12.362.233	2,57
Valero Ener. Corp	186.141	USD	10.328.074	12.838.145	2,67
Vf Corp	217.719	USD	11.691.989	13.539.945	2,82
Viacom Inc -b-	333.541	USD	17.454.380	11.647.252	2,43
21st Century -shs A-	419.741	USD	11.013.402	12.214.463	2,54
			378.788.651	**416.639.037**	**86,75**
Virgin Inseln					
Michael Kors Holdings Ltd	336.735	USD	14.791.056	12.270.623	2,56
			14.791.056	**12.270.623**	**2,56**
Aktien - Insgesamt			**442.242.496**	**478.822.860**	**99,70**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**442.242.496**	**478.822.860**	**99,70**
SUMME ANLAGEBESTAND			**442.242.496**	**478.822.860**	**99,70**

DB Platinum IV

DB Platinum IV CROCI Japan

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in JPY)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Aktien					
Japan					
Ana Holdings Inc	191.394	JPY	53.923.500	72.442.629	3,09
Astellas Pharma Inc	54.384	JPY	75.716.687	76.572.672	3,27
Bridgestone Corp	15.924	JPY	57.387.090	74.158.068	3,16
Central Japan Railway Co	4.126	JPY	63.738.647	73.236.500	3,12
Daiichi Sankyo Co Ltd	29.939	JPY	73.511.246	72.093.112	3,08
Daikin Industries Ltd	6.574	JPY	56.361.386	76.915.800	3,28
Denso Corp	16.188	JPY	72.259.307	85.893.528	3,65
Honda Motor Co.ltd	24.700	JPY	75.867.969	76.767.600	3,28
Isuzu Motors Ltd	54.651	JPY	74.707.373	82.850.916	3,54
Itochu Corp	45.597	JPY	65.217.307	78.905.609	3,37
Jx Holdings	152.600	JPY	74.733.343	74.804.520	3,19
Kddi Corp.	12.400	JPY	37.500.768	36.208.000	1,54
Mitsubishi Chemical Hldgs Corp	83.500	JPY	58.631.605	77.571.500	3,31
Mitsubishi Electric Corp	46.748	JPY	66.803.842	79.962.454	3,41
Mitsubishi Heavy Industries	170.000	JPY	90.202.879	74.681.000	3,19
Murata Manufactur Co Ltd	4.639	JPY	63.753.694	79.698.020	3,40
Nissan Motor Co.ltd	68.706	JPY	71.973.716	75.301.776	3,21
Nitto Denko Corpo	8.341	JPY	52.050.824	82.225.578	3,51
Osaka Gas Co Ltd	163.774	JPY	76.428.820	72.306.221	3,09
Secom Ltd	8.732	JPY	69.216.317	72.274.764	3,08
Sekisui House Ltd	38.455	JPY	55.546.222	73.506.733	3,14
Seven & I Holdings Co Ltd	16.084	JPY	80.030.534	71.493.380	3,05
Smc Corp	2.273	JPY	64.260.581	79.805.030	3,41
Softbank Group Shs	4.100	JPY	37.363.171	36.727.800	1,57
Subaru Shs	20.000	JPY	93.791.351	79.880.000	3,41
Sumitomo Electric Industries	43.371	JPY	61.934.715	77.525.663	3,31
Sumitomo Metal Mining Co.ltd	52.687	JPY	79.924.051	87.908.260	3,74
Suzuki Motor Corp	14.332	JPY	48.143.891	74.956.360	3,20
Tokyo Electron Co Ltd	4.894	JPY	41.030.473	76.224.050	3,25
Tokyo Gas Co.ltd *opr*	64.755	JPY	35.233.680	37.888.151	1,62
Toyota Motor Corp	12.804	JPY	80.895.235	79.820.136	3,41
West Japan Railway Co	4.708	JPY	29.535.239	37.277.944	1,59
			2.037.675.463	**2.307.883.774**	**98,47**
Aktien - Insgesamt			**2.037.675.463**	**2.307.883.774**	**98,47**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**2.037.675.463**	**2.307.883.774**	**98,47**
SUMME ANLAGEBESTAND			**2.037.675.463**	**2.307.883.774**	**98,47**

DB Platinum IV

DB Platinum IV Systematic Alpha

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Anleihen					
Deutschland					
Deut Bk 0% 13-19.12.23/bskt	38.170.000	USD	44.770.503	19.277.955	1,30
			44.770.503	**19.277.955**	**1,30**
Finnland					
Finland 3.875% 06-15.09.17	77.400.000	EUR	89.850.263	91.760.150	6,20
			89.850.263	**91.760.150**	**6,20**
Luxemburg					
Pallad Sec 1 0%13-19.12.23/ Straigh Bond	118.143.000	USD	96.185.446	59.668.731	4,03
			96.185.446	**59.668.731**	**4,03**
Niederlande					
Netherlands 0% 15-15.04.18	48.928.000	EUR	52.360.600	57.946.276	3,92
Netherlands 1.25% 12-15.01.18	75.000.000	EUR	84.027.698	89.206.678	6,03
			136.388.298	**147.152.954**	**9,95**
Anleihen - Insgesamt			**367.194.510**	**317.859.790**	**21,48**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**367.194.510**	**317.859.790**	**21,48**
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere					
Finanzinstrumente					
Belgien					
Kbc Bk 0% 17-15.09.17 Cd	50.000.000	USD	49.826.824	49.913.412	3,37
			49.826.824	**49.913.412**	**3,37**
Deutschland					
Dgz Dekabk 0% 17-23.10.17 Cp	40.000.000	USD	39.857.421	39.872.589	2,69
			39.857.421	**39.872.589**	**2,69**
Finnland					
Op Corp 0% 17-18.01.18 Cp	33.500.000	USD	33.258.268	33.267.774	2,25
			33.258.268	**33.267.774**	**2,25**
Frankreich					
Acoss 0% 17-14.08.17 Cp	25.000.000	USD	24.971.976	24.987.740	1,69
Acoss 0% 17-19.10.17 Cp	25.000.000	USD	24.911.255	24.922.830	1,68
Bfcm 0% 17-02.10.17 Cp	25.000.000	USD	24.896.541	24.940.746	1,69
Bfcm 0% 17-15.11.17 Cp	25.000.000	USD	24.818.604	24.894.514	1,68
Bqe Postale 0% 17-02.08.17 Cp	60.000.000	USD	59.801.326	59.995.682	4,06
Bqe Postale 0% 17-02.11.17 Cp	45.000.000	USD	44.835.007	44.835.007	3,03

DB Platinum IV

DB Platinum IV Systematic Alpha

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)					
Finanzinstrumente (Fortsetzung)					
Frankreich (Fortsetzung)					
Bred Bp 0% 17-10.10.17 Cd	25.000.000	USD	24.914.047	24.933.666	1,68
			229.148.756	**229.510.185**	**15,51**
Großbritannien					
Barclays 0% 17-10.11.17 Cd	25.000.000	USD	24.802.244	24.890.374	1,68
Land Secur 0% 17-17.08.17 Cp	20.000.000	USD	19.974.887	19.986.228	1,35
Land Secur 0% 17-24.08.17 Cp	28.000.000	USD	27.964.842	27.972.781	1,89
Lbk Bw Ln 0% 17-11.09.17 Cp	25.000.000	USD	24.941.581	24.960.426	1,69
Lbk Bw Ln 0% 17-23.08.17 Cp	25.000.000	USD	24.919.124	24.979.781	1,69
Mizuho B Ln 0% 17-01.08.17 Cd	40.000.000	USD	39.878.150	39.998.615	2,70
Mizuho B Ln 0% 17-01.12.17 Cd	40.000.000	USD	39.811.118	39.811.118	2,69
Nat Bui Soc 0% 17-20.11.17 Cp	50.000.000	USD	49.626.930	49.775.355	3,36
Norin Bk Ln 0% 17-15.08.17 Cd	50.000.000	USD	49.895.635	49.973.910	3,38
Ubs Ln 0% 17-22.12.17 Cd	40.000.000	USD	39.697.308	39.761.816	2,69
			341.511.819	**342.110.404**	**23,12**
Luxemburg					
Dz Privatbk 0% 17-30.10.17 Cp	40.000.000	USD	39.856.384	39.860.967	2,69
			39.856.384	**39.860.967**	**2,69**
Neuseeland					
Kiwibank 0% 17-08.09.17 Cp	25.000.000	USD	24.827.819	24.960.731	1,69
			24.827.819	**24.960.731**	**1,69**
Niederlande					
Abn Amro 0% 17-06.10.17 Cp	35.000.000	USD	34.861.426	34.912.411	2,36
Alliander 0% 17-20.10.17 Cp	40.000.000	USD	39.871.845	39.880.683	2,69
			74.733.271	**74.793.094**	**5,05**
Singapur					
Ocbc 0% 17-06.10.17 Cp	50.000.000	USD	49.829.362	49.875.731	3,37
			49.829.362	**49.875.731**	**3,37**
Finanzinstrumente - Insgesamt			**882.849.924**	**884.164.887**	**59,74**
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere - Insgesamt			**882.849.924**	**884.164.887**	**59,74**
SUMME ANLAGEBESTAND			**1.250.044.434**	**1.202.024.677**	**81,22**

DB Platinum IV

DB Platinum IV CROCI Europe

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Aktien					
Belgien					
Ucb	11.692	EUR	781.635	719.760	2,58
			781.635	**719.760**	**2,58**
Dänemark					
Novo Nordisk A/s /-b-	18.925	DKK	684.675	682.264	2,45
Vestas Wind Systems As / Reg	8.579	DKK	553.186	708.312	2,54
			1.237.861	**1.390.576**	**4,99**
Deutschland					
Basf Namen-akt.	8.653	EUR	700.011	697.345	2,51
Bayer Ag	6.316	EUR	678.070	676.759	2,43
Continental Ag	3.650	EUR	734.556	695.325	2,49
Deutsche Post Ag	21.111	EUR	586.652	692.441	2,48
Fresenius Medical Care Ag	8.564	EUR	651.142	683.322	2,45
Merck Kgaa	7.032	EUR	651.199	652.921	2,34
Siemens Ag /nam.	5.993	EUR	626.400	687.697	2,47
			4.628.030	**4.785.810**	**17,17**
Frankreich					
Danone	10.735	EUR	643.621	677.271	2,43
Kering Act.	2.273	EUR	428.386	671.672	2,41
Lvmh Act.	3.184	EUR	700.343	677.237	2,43
Michelin B /nom.	5.947	EUR	554.813	680.039	2,44
Pernod-ricard	6.065	EUR	626.520	711.120	2,54
Sanofi	8.551	EUR	709.040	690.237	2,48
Schneider Electric Se	10.573	EUR	638.070	701.519	2,52
			4.300.793	**4.809.095**	**17,25**
Großbritannien					
Anglo American Plc	57.620	GBP	767.548	806.990	2,91
Bae Systems Plc	103.272	GBP	701.590	694.600	2,49
Bhp Billiton Plc	48.221	GBP	690.488	743.023	2,67
Glaxosmithkline	39.021	GBP	705.896	660.822	2,37
Imperial Brands	18.058	GBP	759.065	630.001	2,26
Kingfisher Plc	208.450	GBP	807.818	686.209	2,46
National Grid Plc	66.364	GBP	786.506	695.178	2,49
Rio Tinto Plc /reg.	18.730	GBP	688.418	737.220	2,64
Sse Plc	44.031	GBP	725.374	678.953	2,44
Whitbread Plc	16.151	GBP	768.145	694.946	2,49
			7.400.848	**7.027.942**	**25,22**
Irland					
Crh Plc	23.001	EUR	750.848	683.015	2,45

DB Platinum IV

DB Platinum IV CROCI Europe

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017

(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren (Fortsetzung)					
Aktien (Fortsetzung)					
Irland (Fortsetzung)					
Ryanair Holdings Plc	38.994	EUR	472.756	692.728	2,49
			1.223.604	**1.375.743**	**4,94**
Jersey					
Shire Plc	15.100	GBP	802.016	719.457	2,58
Wolseley Plc	13.836	GBP	762.386	700.387	2,51
			1.564.402	**1.419.844**	**5,09**
Luxemburg					
Arcelormittal Sa	32.039	EUR	686.702	711.106	2,55
			686.702	**711.106**	**2,55**
Niederlande					
Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	40.373	EUR	745.819	698.251	2,50
Koninklijke Dsm Nv	10.977	EUR	569.356	684.745	2,46
			1.315.175	**1.382.996**	**4,96**
Schweden					
Hennes & Mauritz Ab	30.852	SEK	755.388	680.964	2,44
			755.388	**680.964**	**2,44**
Schweiz					
Adecco Group Sa /act.nom.	10.834	CHF	688.165	702.864	2,53
Lafargeholcim N Namen-akt.	13.779	CHF	703.804	700.725	2,51
Novartis Ag Basel/nam.	9.635	CHF	688.635	697.920	2,50
Roche Holding Ag /genussschein	3.193	CHF	746.829	687.408	2,47
			2.827.433	**2.788.917**	**10,01**
Spanien					
Iberdrola Sa	102.958	EUR	602.059	686.112	2,46
			602.059	**686.112**	**2,46**
Aktien - Insgesamt			**27.323.930**	**27.778.865**	**99,66**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**27.323.930**	**27.778.865**	**99,66**
SUMME ANLAGEBESTAND			**27.323.930**	**27.778.865**	**99,66**

DB Platinum IV

DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017

(Angaben in EUR)

Beschreibung		Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere					
Finanzinstrumente					
Deutschland					
Rwe 31/12/2099	(400)	EUR	(7.126)	0	0,00
			(7.126)	**0**	**0,00**
Finanzinstrumente - Insgesamt			**(7.126)**	**0**	**0,00**
Schatzwechsel					
Deutschland					
Germany 0% 16-27.09.17 Tb	200.000	EUR	201.406	200.233	8,80
Germany 0% 17-13.09.17 Tb	200.000	EUR	200.928	200.219	8,79
Germany 0% 17-16.08.17 Tb	200.000	EUR	200.852	200.081	8,78
			603.186	**600.533**	**26,37**
Frankreich					
France 0% 16-11.10.17 Btf	200.000	EUR	200.448	200.243	8,79
France 0% 17-04.10.17 Btf	100.000	EUR	100.117	100.108	4,40
France 0% 17-18.10.17 Btf	60.000	EUR	60.082	60.077	2,64
France 0% 17-22.11.17 Btf	100.000	EUR	100.211	100.181	4,40
France 0% 17-25.10.17 Btf	200.000	EUR	200.496	200.290	8,78
			661.354	**660.899**	**29,01**
Niederlande					
Netherlands 0% 17-29.09.17 Tb	200.000	EUR	200.619	200.241	8,79
Netherlands 0% 17-30.11.17 Tb	100.000	EUR	100.227	100.227	4,40
Netherlands 0% 17-31.01.18 Tb	100.000	EUR	100.337	100.337	4,41
Netherlands 0% 17-31.08.17 Tb	150.000	EUR	150.579	150.106	6,59
			551.762	**550.911**	**24,19**
Schatzwechsel - Insgesamt			**1.816.302**	**1.812.343**	**79,57**
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere - Insgesamt			**1.809.176**	**1.812.343**	**79,57**
SUMME ANLAGEBESTAND			**1.809.176**	**1.812.343**	**79,57**

DB Platinum IV

DB Platinum IV Basso

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung	Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Aktien					
Marshallinseln					
Dht Holdings	40.000	USD	136.484	166.400	0,31
			136.484	**166.400**	**0,31**
Aktien - Insgesamt			**136.484**	**166.400**	**0,31**
Anleihen					
Indien					
Larsen&toub 0.675% 14-19 /cv	252.000	USD	240.391	257.267	0,48
			240.391	**257.267**	**0,48**
Jersey					
Premier O F 2.5% 12-27.07.18	795.000	USD	751.602	753.485	1,39
			751.602	**753.485**	**1,39**
Kanada					
Just Egy Gr 6.5%14-29.7.19/cv	400.000	USD	386.000	406.268	0,75
			386.000	**406.268**	**0,75**
Vereinigte Staaten					
Tesla Inc 2.375% 17-15.3.22/cv	67.000	USD	66.564	79.890	0,15
			66.564	**79.890**	**0,15**
Anleihen - Insgesamt			**1.444.557**	**1.496.910**	**2,77**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**1.581.041**	**1.663.310**	**3,08**
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere					
Anleihen					
Marshallinseln					
Aegean4.25% 16-15.12.21 /cv	556.000	USD	556.795	420.620	0,78
			556.795	**420.620**	**0,78**
Vereinigte Staaten					
Ares Cap 4.75% 13-15.01.18	117.000	USD	120.688	118.775	0,22
Blackstone 4.375% 05.05.22 /cv	246.000	USD	243.573	251.228	0,47
Dish Netwrk 2.375%15.03.24 /cv	243.000	USD	244.060	261.670	0,48
Kaman 3.25% 17-01.05.24 /cv	569.000	USD	569.474	591.760	1,10
Microchip 2.25% 15.02.37 Cv144a	628.000	USD	627.011	686.090	1,27
Twitter 1% 14-15.09.21 /cv	1.377.000	USD	1.217.792	1.267.913	2,35

DB Platinum IV

DB Platinum IV Basso

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung	Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)					
World 3.375%15.12.23 /cv	239.000	USD	240.046	260.811	0,48
			3.262.644	**3.438.247**	**6,37**
Anleihen - Insgesamt			**3.819.439**	**3.858.867**	**7,15**
Schatzwechsel					
Vereinigte Staaten					
Usa 0% 16-17.08.17 Tb	6.000.000	USD	5.986.577	5.997.606	11,11
Usa 0% 17-07.09.17 Tb	6.000.000	USD	5.984.250	5.994.285	11,11
Usa 0% 17-10.08.17 Tb	4.970.000	USD	4.959.680	4.968.965	9,21
Usa 0% 17-24.08.17 Tb	9.000.000	USD	8.979.411	8.994.679	16,67
Usa 0% 17-24.11.17 Tb	7.000.000	USD	6.974.617	6.976.614	12,93
Usa 0% 17-30.11.17 Tb	50.000	USD	49.813	49.822	0,09
			32.934.348	**32.981.971**	**61,12**
Schatzwechsel - Insgesamt			**32.934.348**	**32.981.971**	**61,12**
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere - Insgesamt			**36.753.787**	**36.840.838**	**68,27**
Sonstige Wertpapiere					
Aktien					
Vereinigte Staaten					
Crown Cas 6.875% -a- /cv Pfd	565	USD	571.744	602.983	1,12
Iridium Com /cv Pfd	4.929	USD	566.738	546.503	1,01
Mandatory 5.75% /cv Pref 144a	5.524	USD	637.927	986.918	1,82
Ncr Corp /cv Pfd	243	USD	384.718	317.115	0,59
			2.161.127	**2.453.519**	**4,54**
Aktien - Insgesamt			**2.161.127**	**2.453.519**	**4,54**
Anleihen					
Vereinigte Staaten					
Ares Cap 3.75%17-1.2.22/cv 144a	372.000	USD	371.999	377.060	0,70
Blrk Kelso 5% 17-15.06.22 /cv	176.000	USD	176.021	181.720	0,34
Ezcorp 2.875% 17-01.07.24 /cv	89.000	USD	89.000	90.891	0,17
Flexion 3.375% 01.05.24 /cv	233.000	USD	238.052	260.037	0,48
Pros Cap 4.95% 17-15.07.22 /cv	93.000	USD	91.990	93.116	0,17
Servicen 0% 17-01.06.22/cv 144a	320.000	USD	320.000	333.974	0,62
			1.287.062	**1.336.798**	**2,48**
Anleihen - Insgesamt			**1.287.062**	**1.336.798**	**2,48**

DB Platinum IV

DB Platinum IV Basso

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung	Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Sonstige Wertpapiere (Fortsetzung)					
Warrants					
Vereinigte Staaten					
Savara 14.06.18 Cw /svra	95.510	USD	2.344	96	0,00
			2.344	**96**	**0,00**
Warrants - Insgesamt			**2.344**	**96**	**0,00**
Sonstige Wertpapiere - Insgesamt			**3.450.533**	**3.790.413**	**7,02**
SUMME ANLAGEBESTAND			**41.785.361**	**42.294.561**	**78,37**

DB Platinum IV

DB Platinum IV Basso

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung	Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Optionen					
Langfristige Kapitalanlagen					
Call Frontier Communications Co	248	USD	6.200	992	0,00
Call Frontier Communications Co	165	USD	2.805	825	0,00
Call Jones Energy Inc	43	USD	447	430	0,00
Call Kandenko 0% 16-31/03/2021 0.8	40.000.000	JPY	0	66.861	0,12
Call Kans Paint 0% 16-17/06/2022 0.6 /cv	150.000.000	JPY	0	117.586	0,22
Call Keihan Elec 0% 16-30/03/2021 0.5 /cv	200.000.000	JPY	90.010	72.472	0,13
Call Star Micro 0% 16-16/06/2021 0.7 /cv	120.000.000	JPY	0	221.527	0,41
Call Suzuki Mot 0% 16-31/03/2021 0.7 /cv	300.000.000	JPY	0	951.629	1,77
Call Suzuki Mot 0% 16-31/03/2023 0.8 /cv	200.000.000	JPY	0	701.119	1,31
Call Teijn Ltd 0% 14-12/12/2018 1	150.000.000	JPY	190.610	191.375	0,35
Call Vodafone Shs/sadr 19/01/2018 40	40	USD	5.920	0	0,00
Call Whiting Petroleum Corp	85	USD	1.618	680	0,00
Call Yamaguchi Frn 15-26/03/2020 1.62 /cv	4.100.000	USD	174.921	439.508	0,82
Put Golar Lng Ltd Bermuda	48	USD	6.220	3.720	0,01
Put Golar Lng Ltd Bermuda	11	USD	1.649	1.089	0,00
Put Innoviva Inc	88	USD	1.744	1.980	0,00
Put Pattern Energy Group Inc	133	USD	2.133	798	0,00
DE-Total Options - long			**484.277**	**2.772.591**	**5,14**
Optionen auf Wertpapiere			**484.277**	**2.772.591**	**5,14**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**484.277**	**2.772.591**	**5,14**
SUMME ANLAGEBESTAND			**42.269.637**	**45.067.152**	**83,51**

DB Platinum IV

DB Platinum IV Clinton Equity Strategies

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in USD)

Beschreibung		Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere					
Schatzwechsel					
Vereinigte Staaten					
Usa 0% 16-07.12.17 Tb	7.000.000	USD	6.970.273	6.974.503	8,55
Usa 0% 16-12.10.17 Tb	10.000.000	USD	9.970.341	9.978.749	12,23
Usa 0% 16-14.09.17 Tb	11.000.000	USD	10.964.237	10.987.354	13,47
Usa 0% 17-05.10.17 Tb	13.000.000	USD	12.949.029	12.975.560	15,90
Usa 0% 17-14.12.17 Tb	8.000.000	USD	7.967.725	7.968.644	9,77
Usa 0% 17-16.11.17 Tb	7.500.000	USD	7.466.845	7.476.812	9,16
Usa 0% 17-28.09.17 Tb	15.000.000	USD	14.940.770	14.977.023	18,35
			71.229.220	**71.338.645**	**87,43**
Schatzwechsel - Insgesamt			**71.229.220**	**71.338.645**	**87,43**
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere - Insgesamt			**71.229.220**	**71.338.645**	**87,43**
SUMME ANLAGEBESTAND			**71.229.220**	**71.338.645**	**87,43**

DB Platinum IV

DB Platinum IV Platow

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Aktien					
Deutschland					
Adesso Ag Akt. Nach	67.771	EUR	1.751.265	3.456.321	2,58
Adidas Ag	3.200	EUR	418.439	617.600	0,46
All For One Steeb Ag	40.761	EUR	1.436.127	2.649.465	1,98
Basf Namen-akt.	23.000	EUR	2.003.202	1.853.570	1,38
Bechtle Ag. Gaildorf	130.772	EUR	4.608.512	7.957.475	5,95
Berentzen-gruppe Ag	66.000	EUR	759.690	739.530	0,55
Bremer Energiekontor Ag	45.286	EUR	615.813	783.448	0,58
Cancom Se	116.500	EUR	5.165.250	6.477.400	4,85
Cenit Ag	107.668	EUR	1.000.843	2.529.121	1,89
Centrotec Sustainable Ag	73.743	EUR	1.371.386	1.378.994	1,03
Cew Stiftung And Co	9.700	EUR	775.595	725.560	0,54
Covestro Ag	40.000	EUR	2.706.038	2.624.800	1,96
Datagroup Akt.	120.542	EUR	2.677.582	4.411.837	3,29
Deutz Ag	610.079	EUR	4.223.679	3.830.076	2,86
Draegerwerk Ag & Co. Kgaa/vz.a	15.972	EUR	1.641.640	1.451.855	1,08
Duerr Ag	24.000	EUR	1.852.107	2.472.000	1,85
Einhell Germany Ag/vorz.akt.	24.017	EUR	1.008.554	1.673.745	1,25
Fresenius Se & Co Kgaa	72.650	EUR	3.949.918	5.189.390	3,87
Frosta Ag	29.029	EUR	891.349	1.973.943	1,47
Helma Eigenheimbau Ag	49.742	EUR	1.665.623	2.093.889	1,56
Hochtief A.g.	16.600	EUR	2.705.826	2.506.600	1,87
Indus Holding Ag	43.821	EUR	2.341.165	2.771.678	2,07
Innotec Tss Ag	57.709	EUR	1.017.164	1.022.084	0,76
Jenoptik Ag. Jena	205.972	EUR	3.200.967	4.799.148	3,58
Jungheinrich Ag /vorz.o.st	113.328	EUR	2.890.196	3.805.554	2,84
Kion Group	59.650	EUR	2.649.728	4.374.135	3,27
Koenig + Bauer Ag	57.822	EUR	2.572.741	3.828.973	2,86
Lanxess Ag	28.200	EUR	1.803.033	1.839.204	1,37
Mensch & Maschine Software Se	208.005	EUR	2.433.499	3.982.256	2,97
Mtu Aero Engines N Namen-akt	24.000	EUR	3.009.316	2.974.800	2,22
Mut Ag	36.844	EUR	514.397	530.738	0,40
Nanogate Ag	6.703	EUR	287.576	315.108	0,24
Paragon Ag Delbrueck	7.828	EUR	255.554	480.639	0,36
Paul Hartmann Ag	1.797	EUR	757.179	804.229	0,60
Progres-werk Oberkirch	20.429	EUR	943.917	878.447	0,66
Schaeffler Ag /pfd	169.472	EUR	2.570.014	1.998.075	1,49
Sixt Vorz.akt Ohne Stimmrecht	67.430	EUR	1.998.485	3.235.966	2,42
Steico --- Akt.	157.868	EUR	2.394.913	3.450.205	2,58
Suedzucker Akt.	6.335	EUR	138.485	114.220	0,09
Takkt Ag. Stuttgart	31.207	EUR	623.880	647.077	0,48
Technotrans	140.084	EUR	3.069.175	5.832.397	4,35
Usu Software Ag. Moeglingen	42.720	EUR	324.243	1.142.760	0,85
Uzin Utz Ag. Ulm	22.106	EUR	1.286.226	1.503.208	1,12
Villeroy+boch Ag /vorz.	191.374	EUR	2.728.858	3.450.473	2,58

DB Platinum IV

DB Platinum IV Platow

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017
(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren (Fortsetzung)					
Aktien (Fortsetzung)					
Deutschland (Fortsetzung)					
Vtg Ag	8.143	EUR	319.354	344.978	0,26
Washtec Ag	34.068	EUR	1.185.832	2.313.558	1,73
Zooplus	25.552	EUR	3.042.525	4.121.538	3,08
			87.586.860	**117.958.067**	**88,08**
Luxemburg					
Stabilus Sa	37.939	EUR	1.700.516	2.666.353	1,99
			1.700.516	**2.666.353**	**1,99**
Österreich					
S&t Ag	364.938	EUR	3.375.503	5.388.310	4,02
			3.375.503	**5.388.310**	**4,02**
Aktien - Insgesamt			**92.662.879**	**126.012.730**	**94,09**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**92.662.879**	**126.012.730**	**94,09**
SUMME ANLAGEBESTAND			**92.662.879**	**126.012.730**	**94,09**

DB Platinum IV

DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control

Anlagebestand
zum 31. Juli 2017
(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren					
Aktien					
Australien					
Bhp Billiton Ltd	58.050	AUD	875.844	1.016.113	2,15
Wesfarmers - Shs	31.890	AUD	874.543	879.526	1,86
			1.750.387	**1.895.639**	**4,01**
Dänemark					
Novo Nordisk A/s /-b-	22.200	DKK	744.011	800.330	1,69
			744.011	**800.330**	**1,69**
Deutschland					
Deutsche Post Ag	27.410	EUR	813.253	899.048	1,90
Siemens Ag /nam.	6.940	EUR	767.637	796.365	1,69
			1.580.890	**1.695.413**	**3,59**
Frankreich					
Danone	13.570	EUR	808.440	856.131	1,81
Michelin B /nom.	7.760	EUR	784.521	887.356	1,89
Sanofi	10.450	EUR	762.570	843.524	1,78
Schneider Electric Se	12.830	EUR	808.758	851.271	1,80
			3.164.289	**3.438.282**	**7,28**
Großbritannien					
Sse Plc	49.680	GBP	863.556	766.060	1,62
			863.556	**766.060**	**1,62**
Irland					
Eaton Corporation Public Ltd	12.730	USD	780.544	844.888	1,79
Johnson Ctr Int Shs	22.650	USD	892.589	748.276	1,58
			1.673.133	**1.593.164**	**3,37**
Japan					
Astellas Pharma Inc	78.500	JPY	877.382	848.429	1,80
Bridgestone Corp	22.800	JPY	770.485	815.050	1,72
Denso Corp	23.200	JPY	871.939	944.929	1,99
Japan Tobacco Inc.	27.400	JPY	894.541	806.392	1,71
Kddi Corp.	34.500	JPY	854.023	773.295	1,64
Sekisui House Ltd	55.100	JPY	842.488	808.480	1,71
Sumitomo Electric Industries	63.100	JPY	871.879	865.802	1,83
Toyota Motor Corp	18.500	JPY	980.034	885.283	1,87
			6.962.771	**6.747.660**	**14,27**
Niederlande					
Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	53.030	EUR	878.958	917.154	1,94

DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017
(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren (Fortsetzung)					
Aktien (Fortsetzung)					
Niederlande (Fortsetzung)					
Koninklijke Dsm Nv	13.780	EUR	817.938	859.596	1,82
Lyondellbasell Ind Nv -a-	12.110	USD	943.601	925.352	1,96
			2.640.497	**2.702.102**	**5,72**
Schweden					
Hennes & Mauritz Ab	42.330	SEK	994.964	934.306	1,98
			994.964	**934.306**	**1,98**
Schweiz					
Adecco Group Sa /act.nom.	13.140	CHF	765.479	852.468	1,80
Lafargeholcim N Namen-akt.	16.050	CHF	847.786	816.216	1,73
Novartis Ag Basel/nam.	12.570	CHF	864.568	910.519	1,93
Roche Holding Ag /genussschein	3.660	CHF	803.894	787.946	1,67
			3.281.727	**3.367.149**	**7,13**
Spanien					
Iberdrola Sa	121.000	EUR	775.562	806.344	1,71
			775.562	**806.344**	**1,71**
Vereinigte Staaten					
Abbvie Inc	14.130	USD	808.726	837.853	1,77
Amgen Inc	5.620	USD	812.143	831.846	1,76
Cardinal Health Inc.	12.710	USD	883.120	832.888	1,76
Cisco Systems Inc.	30.460	USD	863.972	812.525	1,72
Coach Inc	21.230	USD	706.058	848.840	1,80
Cvs Health Corp	11.900	USD	902.584	806.757	1,71
Eastman Chemical Co	11.940	USD	790.829	842.180	1,78
Genuine Parts Co	9.990	USD	897.590	719.636	1,52
Gilead Sciences Inc.	14.790	USD	1.003.563	954.514	2,01
Hp Inc	53.650	USD	745.279	869.139	1,84
Ibm	6.260	USD	938.566	768.138	1,63
Intel Corp.	26.340	USD	880.836	792.434	1,68
Johnson & Johnson	7.400	USD	785.631	833.018	1,76
Lilly (eli) & Co	11.050	USD	789.995	774.718	1,64
Merck	14.720	USD	845.927	797.552	1,69
Pfizer Inc.	27.350	USD	819.487	769.233	1,63
Qualcomm Inc.	16.300	USD	883.798	735.366	1,56
Target Corp	19.060	USD	1.108.940	916.141	1,93
Valero Ener. Corp	14.120	USD	779.323	826.002	1,75
Vf Corp	17.260	USD	853.784	910.432	1,92

DB Platinum IV

DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control

Anlagebestand (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017

(Angaben in EUR)

Beschreibung	Menge/Nennwert	Währung	Einstands-kosten	Kurswert	% des Netto-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren (Fortsetzung)					
Aktien (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)					
Wal-mart Stores Inc	13.350	USD	851.387	905.739	1,92
			17.951.538	**17.384.951**	**36,78**
Aktien - Insgesamt			**42.383.325**	**42.131.400**	**89,15**
Übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notieren - Insgesamt			**42.383.325**	**42.131.400**	**89,15**
SUMME ANLAGEBESTAND			**42.383.325**	**42.131.400**	**89,15**

DB Platinum IV

Anhang zum Abschluss
zum 31. Juli 2017

1. Allgemeines

DB Platinum IV (die "Gesellschaft") ist im Großherzogtum Luxemburg als Organismus für gemeinsame Anlagen gemäß Teil 1 des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils geltenden Fassung (das "Gesetz") registriert. Die Gesellschaft erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren ("OGAW") gemäß Artikel 1(2) der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren in der jeweils geltenden Fassung (die "OGAW-Richtlinie") und kann somit in jedem Mitgliedstaat der Europäischen Union ("EU-Mitgliedstaat") zum Verkauf angeboten werden, sofern sie dort registriert ist.

Die Gesellschaft ist eine Investmentgesellschaft, die nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg am 8. Februar 2002 als Société d'Investissement à Capital Variable ("SICAV") auf unbestimmte Zeit gegründet wurde.

Die Satzung wurde beim Handels- und Gesellschaftsregister in Luxemburg ("*Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg*") hinterlegt und im *Recueil des Sociétés et Associations* des Großherzogtums Luxemburg (der "*Mémorial*") am 1. März 2002 veröffentlicht. Die Gesellschaft ist im Handels- und Gesellschaftsregister in Luxemburg unter der Nummer B-85.828 eingetragen. Die Satzung wurde zuletzt durch eine außerordentliche Hauptversammlung am 3. Juni 2014 geändert. Das Protokoll dieser außerordentlichen Hauptversammlung wurde im *Mémorial* am 26. Juni 2014 veröffentlicht.

Die Gesellschaft ist derzeit als Umbrella-Fonds strukturiert, um Anlegern eine Auswahl verschiedener Teilfonds zu bieten, deren Wertentwicklung vollständig oder teilweise an die Wertentwicklung eines zugrunde liegenden Basiswertes gekoppelt sein kann, wie beispielsweise eines Wertpapier-Basket oder eines Index (der "Basiswert").

Die Anteile sind in die Klassen "I" und "R" unterteilt. Anteile der Klasse "I" stehen nur Institutionellen Anlegern zur Verfügung, während Anteile der Klasse "R" in erster Linie für Private Anleger bestimmt sind. Anteile der Klassen "I" und "R" können weiter in verschiedene Anteilsklassen unterteilt werden, die sich in Bezug auf die Gebührenstruktur, Währungen oder sonstige Merkmale unterscheiden (gekennzeichnet durch eine Kombination aus Ziffern und Buchstaben), und darüber hinaus in Ausschüttende Anteile (gekennzeichnet durch den Buchstaben "D") und Thesaurierende Anteile (gekennzeichnet durch den Buchstaben "C") untergliedert sein. Anteilsklassen können an einer oder mehreren Börsen zum Handel zugelassen sein.

Zum 31. Juli 2017 hatte die Gesellschaft 12 aktive Teilfonds:

- DB Platinum IV Sovereign Plus
- DB Platinum IV CROCI Euro
- DB Platinum IV CROCI US
- DB Platinum IV CROCI Japan
- DB Platinum IV Systematic Alpha
- DB Platinum IV Institutional Fixed Income
- DB Platinum IV CROCI Europe
- DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity
- DB Platinum IV Basso
- DB Platinum IV Clinton Equity Strategies
- DB Platinum IV Platow
- DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control

Hauptereignisse während des Berichtszeitraums:

Im Laufe des Berichtszeitraums wurde der folgende Teilfonds geschlossen:

- DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 (am 6. April 2017 vollständig zurückgenommen)

Für weitere wichtige Ereignisse im Berichtszeitraum siehe Punkt A) auf Seite 162.

2. Rechnungslegungsgrundsätze

Der Abschluss der Gesellschaft wurde gemäß den in Luxemburg allgemein anerkannten und für Investmentfonds anwendbaren Rechnungslegungsgrundsätzen erstellt. Es wurden die folgenden wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze angewandt:

a) Bewertung der Anlagen

Der Nettoinventarwert ("NAV") der Teilfonds ist nach Maßgabe der folgenden Vorschriften zu ermitteln:

(i) Der Wert von Barbeständen oder Einlagen, Wechseln, Forderungen, Rechnungsabgrenzungsposten sowie erklärten oder aufgelaufenen, aber noch nicht vereinnahmten Bardividenden und Zinsen gilt als der Gesamtbetrag hiervon, es sei denn, die vollständige Zahlung oder der vollständige Erhalt sind in irgendeinem Fall unwahrscheinlich - in diesem Fall wird der Wert hiervon nach einem solchen Abschlag festgesetzt, wie dies in einem solchen Fall als angebracht erscheint, um den wahren Wert hiervon widerzuspiegeln.

(ii) Ein Differenzgeschäft (Contract for Difference, CFD) wird auf Basis des Marktwertes des Finanzinstruments zum Ende des Berichtszeitraums bewertet.

(iii) Der Wert aller Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder gehandelt werden oder an einem anderen Geregelten Markt gehandelt werden, wird auf der Grundlage ihrer zuletzt verfügbaren Kurse, die am dem Bewertungstag unmittelbar vorausgehenden Geschäftstag ermittelt werden, oder auf der Grundlage der letzten verfügbaren Kurse des Hauptmarktes bewertet, an dem die Anlagen der Teilfonds hauptsächlich gehandelt werden. Der Verwaltungsrat wird einen Dienstleister bestimmen, der die vorstehend genannten Kurse zur Verfügung stellen wird. Sollten nach Auffassung des Verwaltungsrats diese Kurse den Marktwert der betreffenden Wertpapiere nicht angemessen widerspiegeln, ermittelt der Verwaltungsrat den Wert dieser Wertpapiere nach Treu und Glauben entweder durch Bezugnahme auf andere öffentlich verfügbare Quellen oder durch Bezugnahme auf nach seinem Ermessen geeignete sonstige Quellen.
Insbesondere können die vom Verwaltungsrat der Gesellschaft angewandten Bewertungskriterien zur Schätzung der Bewertung von Wertpapieren, deren Märkte teilweise Liquiditätsmängel oder hohe Credit Spreads aufweisen, unter Aufwendung des üblichen Maßes an Sorgfalt auf Grundlage von Marktquotierungen oder anhand verschiedener Bewertungstechniken, einschließlich mathematischer Modelle, falls Marktquotierungen nicht sofort verfügbar sind bzw. als unzuverlässig eingestuft werden (d. h. wenn zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts die Marktwerte von in der Vermögensaufstellung aufgeführten Finanzinstrumenten oder Wertpapieren nicht aus aktiven Märkten abgeleitet werden können), festgelegt werden. Die Bewertungstechniken umfassen Kapitalwertmethoden, den Vergleich mit ähnlichen Instrumenten, für die beobachtbare Marktpreise existieren, Optionspreismodelle und andere einschlägige Bewertungsmodelle, einschließlich von Kontrahenten oder Dienstleistern bereitgestellte Bewertungsmodelle sowie Angaben von Brokern, anhand derer sich eine Einschätzung zum Marktwert dieser Wertpapiere zum Zeitpunkt der Portfoliobewertung ablesen lässt. Die in diese Modelle eingegebenen Daten stammen soweit möglich von beobachtbaren Märkten. Falls dies unmöglich ist, sind zur Ermittlung der Marktwerte gewisse Ermessensentscheidungen erforderlich.
Diese erstrecken sich auf Erwägungen zur Liquidität und zu den in die Modelle eingegebenen Daten, wie Korrelation und Volatilität für Instrumente mit längerer Laufzeit. Die Verwendung verfügbarer Informationen sowie Ermessensentscheidungen spielen bei Schätzungen eine wichtige Rolle. Tatsächliche künftige Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen und wesentliche Unterschiede zu den auf diese Weise erhaltenen Bewertungen aufweisen.

(iv) Nicht an einer Börse oder an einem Geregelten Markt notierte oder gehandelte Wertpapiere werden auf der Grundlage des wahrscheinlichen Verkaufspreises bewertet, wie mit der gebotenen Sorgfalt und nach Treu und Glauben durch den Verwaltungsrat festgelegt.

(v) Von offenen Investmentfonds ausgegebene Wertpapiere werden zu ihrem letzten verfügbaren Nettoinventarwert oder gemäß obigem Punkt (iii) bewertet, sofern diese Wertpapiere notiert sind.

2. Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

a) Bewertung der Anlagen (Fortsetzung)

(vi) Der Liquidationswert von Futures-, Termin- oder Optionskontrakten, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird entsprechend den vom Verwaltungsrat eingeführten und auf einheitlicher Basis angewandten Verfahren bestimmt. Der Liquidationswert von Futures-, Termin- oder Optionskontrakten, die an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Abwicklungskurses dieser Kontrakte an Börsen und organisierten Märkten festgesetzt, an denen die einzelnen Futures-, Termin- und Optionskontrakte gehandelt werden. Dies gilt mit der Maßgabe, dass, wenn ein Futures-, Termin- oder Optionskontrakt an einem Geschäftstag für den ein Nettoinventarwert ermittelt wird, nicht abgewickelt werden kann, die Grundlage für die Bestimmung des Liquidationswertes dieses Kontraktes dem Wert entspricht, der vom Verwaltungsrat als angemessen und zutreffend erachtet wird.

(vii) Liquide Mittel und Geldmarktinstrumente können zum Nominalwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen oder unter Verwendung einer Restbuchwertmethode bewertet werden. Diese Restbuchwertmethode kann zu Zeiträumen führen, während derer der Wert von dem Kurs abweicht, den der betreffende Teilfonds bei einem Verkauf der Anlage erzielen würde. Die Verwaltungsgesellschaft kann diese Bewertungsmethode von Zeit zu Zeit überprüfen und falls nötig Änderungen empfehlen, um zu gewährleisten, dass solche Vermögenswerte zu ihrem angemessenen Wert nach Treu und Glauben gemäß vom Verwaltungsrat eingeführten Verfahren bewertet werden. Ist der Verwaltungsrat der Auffassung, dass eine Abweichung vom Restbuchwert je Anteil für die Anteilsinhaber zu einem wesentlichen Wertverlust oder anderen unangemessenen Ergebnissen führen könnte, ergreift der Verwaltungsrat gegebenenfalls solche Korrekturmaßnahmen, die er für geeignet hält, um den Wertverlust oder die unangemessenen Ergebnisse soweit vernünftigerweise möglich abzuwenden oder abzufedern.

(viii) Die Swap-Transaktion wird auf einheitlicher Basis auf der Grundlage von durch den Swap-Kontrahenten zur Verfügung gestellten Bewertungen bewertet, bei denen es sich um Geld-, Brief- oder Mittelkurse handeln kann, die nach Treu und Glauben gemäß vom Verwaltungsrat erstellten Verfahren bestimmt werden. Spiegeln diese Werte nach Meinung des Verwaltungsrats den Marktwert der jeweiligen Swap-Transaktionen nicht wider, wird der Wert dieser Swap-Transaktionen nach Treu und Glauben vom Verwaltungsrat oder anhand einer anderen Methode, die er nach seinem eigenen Ermessen für geeignet hält, bestimmt.

(ix) Alle anderen Wertpapiere und anderen zulässigen Vermögenswerte sowie alle vorstehend erwähnten Vermögenswerte, für die eine Bewertung in Übereinstimmung mit den vorstehenden Unterabsätzen nicht möglich oder zweckmäßig ist oder den Wert nicht angemessen widerspiegelt, werden zum nach Treu und Glauben nach Maßgabe vom Verwaltungsrat eingeführter Verfahren ermittelten Marktwert bewertet.

b) Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapierverkäufen

Der realisierte Nettogewinn oder -verlust aus der Veräußerung von Anlagen wird auf der Grundlage der durchschnittlichen Kosten für veräußerte Anlagen bestimmt.

c) Umrechnung von Fremdwährungen

Die Bücher der verschiedenen Teilfonds werden in den folgenden Währungen geführt:

- DB Platinum IV Sovereign Plus	EUR
- DB Platinum IV CROCI Euro	EUR
- DB Platinum IV CROCI US	USD
- DB Platinum IV CROCI Japan	JPY
- DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 (am 6. April 2017 vollständig zurückgenommen)	EUR
- DB Platinum IV Systematic Alpha	USD
- DB Platinum IV Institutional Fixed Income	USD
- DB Platinum IV CROCI Europe	EUR
- DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	EUR
- DB Platinum IV Basso	USD
- DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	USD

2. Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

c) Umrechnung von Fremdwährungen (Fortsetzung)

- DB Platinum IV Platow	EUR
- DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control	EUR

Der Wert von Vermögenswerten, die auf eine andere Währung lauten als der Teilfonds, wird zu den am 31. Juli 2017 geltenden Wechselkursen in die Währung dieses Teilfonds umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung lauten als ein Teilfonds, werden zu den am Buchungstag der Transaktion geltenden Wechselkursen in die Währung dieses Teilfonds umgerechnet.

d) Konsolidierter Abschluss der Gesellschaft

Der konsolidierte Abschluss der Gesellschaft wird in Euro erstellt. Die verschiedenen Posten der Vermögensaufstellung sowie der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens der Gesellschaft zum 31. Juli 2017 entsprechen der Summe der jeweiligen Posten im Abschluss jedes einzelnen Teilfonds, die zum Schlusswechselkurs in EUR umgerechnet wurden.

Die Wechselkursdifferenz zwischen dem 31. Januar 2017 und dem 31. Juli 2017 ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter "Währungsumrechnung" angegeben.

Zum 31. Juli 2017 verwendete Wechselkurse:

1 EUR =	130,273652	JPY	1 EUR =	1,476796	AUD
1 EUR =	9,536983	SEK	1 EUR =	7,436703	DKK
1 EUR =	1,600139	SGD	1 EUR =	1,474399	CAD
1 EUR =	1,179000	USD	1 EUR =	0,894300	GBP
1 EUR =	1,137558	CHF	1 EUR =	9,315740	NOK

e) Erwerbskosten für Anlagen

Die Kosten für Anlagen, die auf eine andere Währung lauten als der Teilfonds, werden zu den am Kauftag geltenden Wechselkursen in die Währung dieses Teilfonds umgerechnet.

f) Erträge

Zinserträge fallen gemäß den Bedingungen der zugrunde liegenden Anlage an. Erträge werden nach Abzug etwaiger entsprechender Quellensteuern verzeichnet. Dividenden werden am Ex-Tag ausgewiesen.

3. Besteuerung

Nach geltendem Recht und gängiger Praxis ist die Gesellschaft in Luxemburg nicht einkommen- oder körperschaftsteuerpflichtig.

Die Gesellschaft unterliegt in Luxemburg jedoch einer Zeichnungssteuer ("*Taxe d'Abonnement*") in Höhe von 0,05 % p. a. in Bezug auf Anteile der Klasse "R" sowie in Höhe von 0,01 % p. a. in Bezug auf Anteile der Klasse "I", gemäß Artikel 174 des Gesetzes.

Anlagen, die ein Teilfonds in Anteile eines anderen Luxemburger Organismus für gemeinsame Anlagen tätigt, fließen nicht in die Berechnung des Nettoinventarwerts des Teilfonds ein, der als Grundlage für die Berechnung der von diesem Teilfonds zu entrichtenden *Taxe d'Abonnement* dient.

3. Besteuerung (Fortsetzung)

Die folgenden Teilfonds sind zudem von der *Taxe d'Abonnement* ausgenommen: Teilfonds, (i) deren Wertpapiere nur für institutionelle Anleger bestimmt sind, (ii) deren alleiniges Ziel in der gemeinsamen Anlage in Geldmarktinstrumente oder Einlagen bei Kreditinstituten besteht, (iii) deren gewichtete Restlaufzeit des Portfolios nicht mehr als 90 Tage beträgt und (iv) die das höchstmögliche Ranking einer anerkannten Ratingstelle erhalten haben. Im Falle mehrerer Anteilsklassen innerhalb eines Teilfonds, gilt die Befreiung nur für die Anteilsklassen, deren Wertpapiere nur für institutionelle Anleger bestimmt sind.

Die Befreiung gilt zudem für Teilfonds, deren Wertpapiere ausschließlich Pensionsfonds oder Unternehmen vorbehalten sind, die von einem oder mehreren Arbeitgebern zugunsten ihrer Mitarbeiter gegründet wurden, bzw. Teilfonds, deren Hauptziel in der Anlage in Institute, die Mikrokredite vergeben, besteht, bzw. Teilfonds, deren Wertpapiere (i) an mindestens einer Börse oder einem sonstigen anerkannten, öffentlich zugänglichen, regulierten Markt mit regelmäßiger Notierung notiert sind oder gehandelt werden und (ii) die ausschließlich das Ziel verfolgen, die Wertentwicklung eines oder mehrerer Indizes abzubilden (wobei diese Ausschließlichkeitsbedingung nicht bedeutet, dass der Teilfonds nicht daneben gegebenenfalls vorhandene liquide Vermögenswerte verwalten oder Techniken und Instrumente zu Zwecken der Absicherung oder einer effizienten Portfolioverwaltung einsetzen darf). Kraft einer großherzoglichen Verordnung können zusätzliche oder alternative Kriterien für die unter diese Ausnahmeregelung fallenden Indizes festgelegt werden (im Falle mehrerer Anteilsklassen innerhalb eines Teilfonds findet die Befreiung nur auf Anteilsklassen Anwendung, auf die vorstehender Unterpunkt (i) zutrifft).

Die Taxe d'Abonnement ist vierteljährlich auf der Basis des Nettoinventarwerts des Teilfonds am Ende des jeweiligen Kalenderquartals zu entrichten. Auf Basis der in Luxemburg geltenden gesetzlichen, aufsichtsrechtlichen und steuerlichen Vorschriften, wie sie der Gesellschaft zum Zeitpunkt der Aufnahme eines Anlegers in diese Anteilsklassen bekannt sind, kommt Anteilen der Klasse "I" der ermäßigte Steuersatz der *Taxe d'Abonnement* von 0,01 % zugute. Diese Einschätzung steht jedoch unter dem Vorbehalt etwaiger Änderungen der in Luxemburg geltenden Gesetze und Vorschriften sowie der jeweiligen Einordnung des Status eines für die Anteile der Klasse "I" zulässigen Anlegers durch eine zuständige Luxemburger Behörde. Infolge einer Neuklassifizierung des Status eines Anlegers durch eine Behörde kann die gesamte Anteilsklasse einer *Taxe d'Abonnement* in Höhe von 0,05 % p. a. unterliegen.

Im Zusammenhang mit der Ausgabe von Anteilen durch die Gesellschaft sind in Luxemburg weder Stempel- noch sonstige Steuern zu zahlen.

Nach geltendem Recht und gängiger Praxis ist auf den realisierten Wertzuwachs in Bezug auf die Vermögenswerte der Gesellschaft in Luxemburg keine Kapitalertragsteuer zu zahlen; gleiches gilt für Anlageerträge, die dieser aus Vermögenswerten zufließen. Auf Anlageerträge in Form von der Gesellschaft vereinnahmter Dividenden und Zinsen können in den jeweiligen Ursprungsländern Quellensteuern in unterschiedlicher Höhe erhoben werden. Diese sind nicht erstattungsfähig.

Gemäß dem belgischen Finanzgesetz vom 22. Dezember 2003 wurde eine jährliche Steuer von 0,06 % auf aus Belgien stammende Gelder erhoben, die zum 31. Dezember des Vorjahres in der Gesellschaft enthalten waren. Dieser Steuersatz wurde 2005 auf 0,07 %, 2007 auf 0,08 % und 2013 auf 0,0965 % angehoben, und ab 2014 auf 0,0925 % gesenkt.

4. Allokationsgebühr

In Übereinstimmung mit und gemäß den Bestimmungen des Produktanhangs des Prospekts kann der Teilfonds DB Platinum IV Platow an den Allokationsberater, Platow Medien GmbH, eine Allokationsgebühr von bis zu 0,50 % p. a. für die Anteilsklasse "R1C" und von bis zu 0,75 % p. a. für die Anteilsklasse "I1C" zahlen.

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr

In Übereinstimmung mit und vorbehaltlich der Bedingungen der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung läuft die jährliche Verwaltungsgesellschaftsgebühr an jedem Kalendertag auf und wird an jedem Bewertungstag auf der Grundlage eines Prozentsatzes des zuletzt verfügbaren Nettoinventarwerts/Bruttoinventarwerts jedes Teilfonds oder jeder Anteilsklasse oder des Erstausgabepreises, multipliziert mit der Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile jedes Teilfonds oder jeder Anteilsklasse (wie im maßgeblichen Produktanhang für jeden Teilfonds oder jede Anteilsklasse aufgeführt), berechnet. Die Verwaltungsgesellschaftsgebühr ist monatlich zahlbar.

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft hat darüber hinaus Anspruch auf Erstattung von Auslagen in angemessener Höhe, die im Rahmen ihrer Funktion als Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft im Zusammenhang mit der Ausführung der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung angefallen sind und im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit nach vernünftigem Ermessen nicht vorhersehbar waren.

Die Verwaltungsgesellschaft zahlt die Vergütung einiger Anlageverwalter sowie des Portfoliomanagers aus der Verwaltungsgesellschaftsgebühr.

6. Fixgebühr

Gemäß den Bestimmungen einer zwischen der Gesellschaft und der Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Niederlassung London (die "Fixgebührenstelle"), geschlossenen Vereinbarung wird die Fixgebührenstelle gegen Zahlung einer Fixgebühr, die – wie im jeweiligen Produktanhang beschrieben – anhand des durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwerts/Bruttoinventarwerts je Teilfonds oder Anteilsklasse berechnet wird und vierteljährlich zahlbar ist, bestimmte Gebühren und Aufwendungen zahlen, sofern nicht anderweitig im jeweiligen Produktanhang angegeben.

Die Gebühren und Aufwendungen, die von der Vereinbarung umfasst werden, sind:

- Transaktionsgebühren und
- Verwaltungsaufwendungen, einschließlich

  - Verwaltungsstellengebühr,
  - Verwahrstellengebühr;
  - Register- und Transferstellengebühr; und
  - sonstige Verwaltungsaufwendungen (einschließlich u. a. Wirtschaftsprüfungs- und Rechtsberatungskosten sowie gegebenenfalls Verwaltungsratshonorare).

Sofern im entsprechenden Produktanhang nicht anders festgelegt, beinhaltet die Fixgebühr nicht die folgenden Gebühren, Aufwendungen und Kosten:

- die Kosten für Marketingagenturen, die von der Gesellschaft mit der Erbringung bestimmter Marketing- und Vertriebsdienstleistungen für die Gesellschaft beauftragt sind;
- die Vertriebsgebühr;
- die (etwaige) Anlageverwaltungsgebühr;
- die Verwaltungsgesellschaftsgebühr;
- nicht abgeschriebene Gründungskosten;
- Steuern oder steuerliche Belastungen, welche die Gesellschaft gegebenenfalls zu zahlen hat, beispielsweise die jährliche Steuer in Luxemburg (die "*Taxe d'Abonnement*")* oder, soweit zutreffend, Mehrwertsteuer oder vergleichbare von der Gesellschaft zu entrichtende Vertriebs- oder Verkehrssteuern (MwSt.) (all dies fällt unter Steuern oder Abgaben), sofern im jeweiligen Produktanhang des Prospekts nicht anders bestimmt;
- etwaige an Verkaufsvermittler zu zahlende Provisionen, die in Verbindung mit dem Handel in Anteilen anfallen;
- Kosten und Aufwendungen, die nicht im Rahmen der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit der Gesellschaft angefallen sind, beispielsweise Außerordentliche Aufwendungen (z. B. Anwaltsgebühren für die Wahrung von Rechten im Falle einer Klage der oder gegen die Gesellschaft);
  und
- Kosten für Sicherheiten.

* Außer für DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 (am 6. April 2017 vollständig zurückgenommen) und DB Platinum IV Institutional Fixed Income, bei denen die *Taxe d'Abonnement* in der Fixgebühr enthalten war.

7. Anlageerfolgsprämie

Für vier Teilfonds sind Anlageerfolgsprämien (oder Erfolgsprämien) vorgesehen:

1) DB Platinum IV Systematic Alpha**

Der Teilfonds entrichtet vierteljährlich innerhalb von 20 Geschäftstagen nach jedem Anlageerfolgsprämienberechnungstag an den Portfoliomanager (Winton Capital Management Limited ("WCML")) gegebenenfalls einen aus dem Vermögen des Teilfonds zahlbaren Betrag, der 18 % des Betrags entspricht, um den der Nettoinventarwert des Teilfonds am maßgeblichen Anlageerfolgsprämienberechnungstag (nach Abzug von Basisgebühren, aber vor Abzug der Anlageerfolgsprämie) die High Watermark übersteigt.

Zur Klarstellung: Wenn der Nettoinventarwert des Teilfonds unter der High Watermark liegt, muss so lange keine Anlageerfolgsprämie an WCML entrichtet werden, bis der Nettoinventarwert des Teilfonds die High Watermark an einem Anlageerfolgsprämienberechnungstag überschritten hat. Wenn der Teilfonds einen Nettoverlust erlitten hat, erhält WCML keine Anlageerfolgsprämie in Bezug auf den Teilfonds, bis der Nettoinventarwert des Teilfonds aufgrund anschließend angefallener Nettogewinne die Nettoverlustvorträge, bereinigt um Rücknahmen und Zeichnungen, wieder übersteigt.

"Basisgebühren" bedeutet (i) im Falle von Anteilen der Klassen I1C, I1D, I5C und I5D die Summe aus der Fixgebühr und der Verwaltungsgesellschaftsgebühr, und (ii) im Falle von Anteilen der Klassen R1C, R5C, R0C und R6C die Summe aus der Fixgebühr und einem Betrag von 0,85 %.

"High Watermark" ist an einem jeweiligen Bewertungstag der höchste Nettoinventarwert des Teilfonds an einem Anlageerfolgsprämienberechnungstag (die Berechnung dieses Nettoinventarwerts erfolgt nach Abzug der in Bezug auf diesen Anlageerfolgsprämienberechnungstag zahlbaren Anlageerfolgsprämie) und, nur im Falle des ersten Anlageerfolgsprämienberechnungstags, bereinigt um zuvor aufgelaufene Anlageerfolgsprämien bzw. Verlustvorträge, die dem dbX Systematic Alpha Index zu dem Zeitpunkt, zu dem dessen Berechnung und Veröffentlichung eingestellt wird, zuzurechnen sind.

Die High Watermark berücksichtigt zu jedem Zeitpunkt die "Auswirkungen neuer Zeichnungen" und die "Auswirkungen von Rücknahmen und Ausschüttungen".

"Auswirkungen neuer Zeichnungen" bedeutet, dass neue Zeichnungen für einen Anstieg des Nettoinventarwerts des Teilfonds und der High Watermark, und zwar jeweils um den Betrag dieser neuen Zeichnungen, sorgen.

"Auswirkungen von Rücknahmen oder Ausschüttungen" bedeutet, dass durch Rücknahmen von Anteilen einer Anteilsklasse oder Ausschüttungen auf Anteile einer Anteilsklasse der Nettoinventarwert des Teilfonds um den Betrag der Rücknahme oder Ausschüttung sinkt und die High Watermark des Teilfonds sich anteilig reduziert, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. An jedem Tag, an dem Rücknahmen oder Ausschüttungen in Bezug auf eine Anteilsklasse erfolgen, reduziert sich die High Watermark des Teilfonds um einen Betrag, der dem Produkt aus (A) dieser High Watermark und (B) dem Quotienten aus (1) dem Rücknahme- oder Ausschüttungsbetrag als Zähler und (2) dem Nettoinventarwert des Teilfonds unmittelbar vor Ausführung der Rücknahme oder Ausschüttung als Nenner entspricht.

"Auflaufen der Anlageerfolgsprämie" bedeutet, dass, obwohl die Anlageerfolgsprämie am Ende eines Kalenderquartals gezahlt wird, diese Anlageerfolgsprämie an jedem Bewertungstag aufläuft. Für die Zwecke der Bestimmung des Nettoinventarwerts des Teilfonds wird die Anlageerfolgsprämie auflaufend berechnet (und als Verbindlichkeit abgezogen). Um Verluste widerzuspiegeln, werden zu jedem Bewertungstag die aufgelaufenen Beträge (als Gutschrift) zurückgebucht. Eine Rücknahme oder Ausschüttung in Bezug auf eine Anteilsklasse, die nicht an einem Anlageerfolgsprämienberechnungstag und zu einem Zeitpunkt erfolgt, an dem eine Anlageerfolgsprämie aufgelaufen ist, führt zu einer anteiligen Zahlung der Anlageerfolgsprämie an WCML in Bezug auf die zurückgenommenen Anteile bzw. eine entsprechende Ausschüttung.

** Für den Teilfonds DB Platinum IV Systematic Alpha wurde die Anlageerfolgsprämie zum 19. Juli 2017 von 20 % auf 18 % gesenkt und der bei der Berechnung der Basisgebühren für die Anteilsklassen R1C, R5C, R0C und R6C verwendete Betrag wurde von 1,59 % auf 0,85 % gesenkt.

7. Anlageerfolgsprämie (Fortsetzung)

"Anlageerfolgsprämienberechnungstag" ist entweder:
(i) der letzte Strategiegeschäftstag im März, Juni, September und Dezember eines Jahres, beginnend im Dezember 2013;
(ii) der Tag, an dem der Teilfonds beendet wird, oder
(iii) der Tag an dem die Portfolioverwaltungsvereinbarung endet.

Im Berichtszeitraum wurden keine Anlageerfolgsprämien für den DB Platinum IV Systematic Alpha erfasst.

2) DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity

Der Anspruch des Anlageverwalters (GAM Investment Management (Switzerland) Ltd) auf eine Anlageerfolgsprämie entsteht, wenn die prozentuale Rendite für eine Anteilsklasse, basierend auf dem Bruttoinventarwert je Anteil der Anteilsklasse seit Beginn des Anlageerfolgsprämienzeitraums über der des Referenzindex liegt, der am Ende jedes Quartals (am letzten Bewertungstag im März, Juni, September und Dezember) an die aktuellen Markbedingungen angepasst wird und wenn gleichzeitig der Bruttoinventarwert je Anteil über der High Watermark liegt.

Zur Klarstellung: Beide Bedingungen müssen zusammen erfüllt sein, damit der Anlageverwalter einen Anspruch auf eine Anlageerfolgsprämie hat.

"Anlageerfolgsprämienbetrag" ist ein Betrag je Anteil, der an jedem Bewertungstag berechnet wird und dem niedrigeren der beiden folgenden Beträge entspricht:

(i) 10 % des Betrages, um den der Bruttoinventarwert je Anteil den jeweiligen Referenzindex gegebenenfalls übersteigt oder
(ii) 10 % des Betrages, um den der Bruttoinventarwert je Anteil die High Watermark gegebenenfalls übersteigt.

Dabei gilt:
"Bruttoinventarwert" ist an einem Bewertungstag der Nettoinventarwert der jeweiligen Anteilsklasse, der an diesem Bewertungstag ohne Berücksichtigung eines Abzugs des Anlageerfolgsprämienbetrags berechnet wird.

"Bruttoinventarwert je Anteil" ist an einem Bewertungstag der Bruttoinventarwert, der allen ausgegebenen Anteilen der jeweiligen Anteilsklasse zuzurechnen ist, geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile der jeweiligen Anteilsklasse.

"High Watermark" ist (i) an einem Bewertungstag bis einschließlich zum ersten Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums der Erstausgabepreis und (ii) an jedem darauffolgenden Bewertungstag der höhere der beiden folgenden Werte: (a) der Nettoinventarwert je Anteil am unmittelbar vorangegangenen Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums, in Bezug auf den eine Anlageerfolgsprämie zahlbar war, und (b) der Erstausgabepreis.

"Referenzindex" richtet sich nach der Währung der Anteilsklasse wie folgt:

Anteilsklassenwährung	Referenzindex	Bloomberg Ticker
EUR	EUR 3-Monats-LIBOR	EE0003M
CHF	CHF 3-Monats-LIBOR	SF0003M
USD	USD 3-Monats-LIBOR	US0003M
GBP	GBP 3-Monats-LIBOR	BP0003M

"Anlageerfolgsprämienzeitraum" ist der Zeitraum ab ausschließlich einem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums bis einschließlich zum nächstfolgenden Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums, wobei der erste Anlageerfolgsprämienzeitraum am Auflegungstermin beginnt und am Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums im Jahr 2015 endet.

7. Anlageerfolgsprämie (Fortsetzung)

"Anlageerfolgsprämienzahltage" bedeutet, dass die Summe der während des Anlageerfolgsprämienzeitraums gegebenenfalls angefallenen Anlageerfolgsprämienbeträge jährlich innerhalb von 14 Geschäftstagen nach jedem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums aus den Vermögenswerten des Teilfonds zu zahlen ist. Wird ein Anteil in einem Anlageerfolgsprämienzeitraum und vor einem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums zurückgegeben, wird der in Bezug auf diesen Anteil am Bewertungstag, zu dem dieser Anteil zurückgegeben wird, berechnete Anlageerfolgsprämienbetrag festgestellt und am nächstfolgenden Anlageerfolgsprämienzahltag nach dieser Rückgabe zur Zahlung an den Anlageverwalter fällig.

"Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums" ist jeweils der 30. Juni eines Jahres.

Im Berichtszeitraum wurden keine Anlageerfolgsprämien für den DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity erfasst.

3) DB Platinum IV Basso

"Anlageerfolgsprämienbetrag" ist, wenn der Bruttoinventarwert je Anteil für eine Anteilsklasse über der maßgeblichen High Watermark liegt, ein an jedem Bewertungstag berechneter Betrag je Anteil, der dem Prozentualen Betrag der Täglichen Prozentualen Rendite entspricht. Jeder Anlageerfolgsprämienbetrag, ob positiv oder negativ, wird der aufgelaufenen Anlageerfolgsprämie dieser Anteilsklasse zugerechnet und spiegelt sich im Nettoinventarwert wider.

Dabei gilt:
"Tägliche Prozentuale Rendite" ist die prozentual ausgedrückte Rendite, die sich aus dem Verhältnis zwischen dem Bruttoinventarwert je Anteil und dem größeren der beiden folgenden Werte ergibt: (a) dem Nettoinventarwert je Anteil am vorangehenden Tag oder (b) der High Watermark.

"Bruttoinventarwert" ist an einem Bewertungstag der Nettoinventarwert der jeweiligen Anteilsklasse, der an diesem Bewertungstag ohne Berücksichtigung eines Abzugs des Anlageerfolgsprämienbetrags für diesen Tag berechnet wird.

"Bruttoinventarwert je Anteil" ist an einem Bewertungstag der Bruttoinventarwert, der allen ausgegebenen Anteilen einer bestimmten Anteilsklasse zuzurechnen ist, geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile der jeweiligen Anteilsklasse.

"High Watermark" ist (i) an einem Bewertungstag bis einschließlich zum ersten Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums der Erstausgabepreis und (ii) an jedem darauffolgenden Bewertungstag der höhere der beiden folgenden Werte: (a) der Nettoinventarwert je Anteil am unmittelbar vorangegangenen Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums, in Bezug auf den eine Anlageerfolgsprämie zahlbar war, und (b) der Erstausgabepreis.

"Prozentualer Betrag" ist:
(i) für alle Anteilsklassen außer I2, R3, I3 und R4 20 %;
(ii) für die Anteilsklasse I2 15 % und
(iii) für die Anteilsklassen R3, R4 und I3 17,5 %.

"Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums" ist jeweils der letzte Bewertungstag im Dezember eines Jahres.

"Anlageerfolgsprämienzeitraum" ist der Zeitraum ab ausschließlich einem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums bis einschließlich zum nächstfolgenden Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums, wobei der erste Anlageerfolgsprämienzeitraum am Auflegungstermin beginnt und am ersten Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums endet.

7. Anlageerfolgsprämie (Fortsetzung)

"Anlageerfolgsprämienzahltage" bedeutet, dass die Summe der während des Anlageerfolgsprämienzeitraums gegebenenfalls angefallenen Anlageerfolgsprämienbeträge jährlich innerhalb von 14 Geschäftstagen nach jedem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums aus den Vermögenswerten des Teilfonds zu zahlen ist.
Wird ein Anteil in einem Anlageerfolgsprämienzeitraum und vor einem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums zurückgegeben, wird der in Bezug auf diesen Anteil am Bewertungstag, zu dem dieser Anteil zurückgegeben wird, berechnete Anlageerfolgsprämienbetrag festgestellt und am nächstfolgenden Anlageerfolgsprämienzahltag nach dieser Rückgabe zur Zahlung an den Anlageverwalter fällig.

Im Berichtszeitraum wurden Anlageerfolgsprämien in Höhe von USD 3.950 für den DB Platinum IV Basso erfasst.

4) DB Platinum IV Clinton Equity Strategies

"Anlageerfolgsprämienbetrag" ist, sofern der Bruttoinventarwert je Anteil für eine Anteilsklasse über der maßgeblichen High Watermark liegt, ein an jedem Bewertungstag berechneter Betrag je Anteil, der:

(i) für alle Anteilsklassen außer den Anteilsklassen I3C, I4C, R4C und R5C 20 % der Täglichen Prozentualen Rendite entspricht;
(ii) für die Anteilsklassen I4C, R4C und R5C 25 % der Täglichen Prozentualen Rendite entspricht; und
(iii) für die Anteilsklasse I3C 17,5 % der Täglichen Prozentualen Rendite entspricht.

Jeder Anlageerfolgsprämienbetrag, ob positiv oder negativ, wird der aufgelaufenen Anlageerfolgsprämie dieser Anteilsklasse zugerechnet und spiegelt sich im Nettoinventarwert wider.

Dabei gilt:
"Tägliche Prozentuale Rendite" ist die prozentual ausgedrückte Rendite, die sich aus dem Verhältnis zwischen dem Bruttoinventarwert je Anteil und dem größeren der beiden folgenden Werte ergibt: (a) dem Nettoinventarwert je Anteil am vorangehenden Tag oder (b) der High Watermark.

"Bruttoinventarwert" ist an einem Bewertungstag der Nettoinventarwert der jeweiligen Anteilsklasse, der an diesem Bewertungstag ohne Berücksichtigung eines Abzugs des Anlageerfolgsprämienbetrags für diesen Tag berechnet wird.

"Bruttoinventarwert je Anteil" ist an einem Bewertungstag der Bruttoinventarwert, der allen ausgegebenen Anteilen einer bestimmten Anteilsklasse zuzurechnen ist, geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile der jeweiligen Anteilsklasse.

"High Watermark" ist (i) an einem Bewertungstag bis einschließlich zum ersten Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums der Erstausgabepreis und (ii) an jedem darauffolgenden Bewertungstag der höhere der beiden folgenden Werte: (a) der Nettoinventarwert je Anteil am unmittelbar vorangegangenen Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums, in Bezug auf den eine Anlageerfolgsprämie zahlbar war, und (b) der Erstausgabepreis.

"Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums" ist jeweils der letzte Bewertungstag im Dezember eines Jahres.

"Anlageerfolgsprämienzeitraum" ist der Zeitraum ab ausschließlich einem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums bis einschließlich zum nächstfolgenden Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums, wobei der erste Anlageerfolgsprämienzeitraum am Auflegungstermin beginnt und am ersten Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums endet.

"Anlageerfolgsprämienzahltage" bedeutet, dass die Summe der während des Anlageerfolgsprämienzeitraums gegebenenfalls angefallenen Anlageerfolgsprämienbeträge jährlich innerhalb von 14 Geschäftstagen nach jedem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums aus den Vermögenswerten des Teilfonds zu zahlen ist.

7. Anlageerfolgsprämie (Fortsetzung)

Wird ein Anteil in einem Anlageerfolgsprämienzeitraum und vor einem Schlusstag des Anlageerfolgsprämienzeitraums zurückgegeben, wird der in Bezug auf diesen Anteil am Bewertungstag, zu dem dieser Anteil zurückgegeben wird, berechnete Anlageerfolgsprämienbetrag festgestellt und am nächstfolgenden Anlageerfolgsprämienzahltag nach dieser Rückgabe zur Zahlung an den Anlageverwalter fällig.

Im Berichtszeitraum wurden keine Anlageerfolgsprämien für den DB Platinum IV Clinton Equity Strategies erfasst.

8. Swaps (für Teilfonds mit Indirekter Anlagepolitik)

Der in diesem Abschnitt angegebene Kontrahent der Swap-Transaktionen ist die Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Niederlassung London (Vereinigtes Königreich). Sofern keine Anteilsklassen angegeben sind, gelten die untenstehenden Nominalbeträge auf Teilfondsebene.

DB Platinum IV Sovereign Plus

Zum 31. Juli 2017 war der Teilfonds in übertragbaren Wertpapieren und liquiden Mitteln investiert. Der Teilfonds nutzte eine Art von Swap-Transaktionen, um ein Exposure in Bezug auf die Wertentwicklung des zugrunde liegenden Index zu erzielen, wobei sich der Nominalwert auf den unten aufgeführten Betrag belief:

CHF	13.800.000
EUR	40.900.000
GBP	1.700.000
JPY	2.231.050.000

Zum 31. Juli 2017 belief sich der nicht realisierte Netto-Wertverlust dieser Transaktionen auf EUR 1.583.733 (2,12 % des Nettovermögens).

DB Platinum IV Institutional Fixed Income

Der Teilfonds hat sämtliche seiner Nettoerlöse in Swap-Transaktionen einer Art investiert, um eine Rendite zu erzielen, die an die Wertentwicklung des maßgeblichen Referenzportfolios gekoppelt ist, wobei sich der Nominalwert je nach Anteilsklasse auf den unten aufgeführten Betrag belief:

EUR	20.000.000	(Klasse I4D)
EUR	20.000.000	(Klasse I5D)
EUR	200.000.000	(Klasse I6D)
EUR	150.000.000	(Klasse I7D)
EUR	100.000.000	(Klasse I8D)

Zum 31. Juli 2017 belief sich der nicht realisierte Netto-Wertverlust dieser Transaktionen auf USD 64.080.088 (12,48 % des Nettovermögens).

Diese Art von Swapvereinbarung führt zu "Forderungen aus Swap-Transaktionen", deren Höhe den theoretischen Wert widerspiegelt.

9. Devisentermingeschäfte

Zum 31. Juli 2017 stand für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI Euro das nachstehend angegebenen Devisentermingeschäft aus:

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
USD	R1C-U	1.590.000	EUR	1.391.867	11.08.2017	(43.921)
						(43.921)

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI US die nachstehend angegebenen Devisentermingeschäfte aus:

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
EUR	R1C-E	20.864.928	USD	23.764.037	11.08.2017	847,648
USD	R1C-E	1.130.862	EUR	990.928	11.08.2017	(37.990)
						809.658

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI Japan die nachstehend angegebenen Devisentermingeschäfte aus:

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) JPY
EUR	I1C-E	1.040.000	JPY	135.060.562	14.08.2017	440,374
EUR	R1C-E	1.223.000	JPY	158.826.025	14.08.2017	517.863
USD	I1C-U	663.000	JPY	75.299.643	14.08.2017	(2.078.891)
						(1.120.654)

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV Systematic Alpha die nachstehend angegebenen Devisentermingeschäfte aus:

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
EUR		300.000	HUF	91.614.000	01.08.2017	(1.236)
EUR		700.000	NOK	6.522.383	01.08.2017	(150)
EUR		500.000	PLN	2.127.705	01.08.2017	120
EUR		2.000.000	SEK	19.079.360	01.08.2017	(680)
USD		700.000	TRY	2.467.290	01.08.2017	(2)
ZAR		2.607.840	USD	200.000	01.08.2017	(2.375)
BRL		125.410.340	USD	37.600.000	02.08.2017	2.531.309
CHF		71.000	USD	74.067	02.08.2017	(472)
EUR		100.000	HUF	30.484.000	02.08.2017	(203)
EUR		100.000	PLN	425.700	02.08.2017	(18)
EUR		600.000	SEK	5.727.240	02.08.2017	(628)
EUR		17.697.000	USD	20.587.663	02.08.2017	278.922
GBP		641.000	USD	836.991	02.08.2017	8.118
NOK		550.000	USD	68.866	02.08.2017	745
USD		37.600.000	BRL	118.675.900	02.08.2017	(376.288)
USD		12.797	EUR	11.000	02.08.2017	(173)
USD		122.741	GBP	94.000	02.08.2017	(1.190)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
USD		500.000	SGD	678.935	02.08.2017	(249)
ZAR		1.311.320	USD	100.000	02.08.2017	(627)
EUR		206.524.000	USD	240.079.968	03.08.2017	3.439.296
USD		231.462.909	EUR	206.524.000	03.08.2017	(12.054.995)
CHF	I1C-C	17.630.000	USD	18.447.671	07.08.2017	(168.517)
CHF	R6C-C	116.000	USD	121.381	07.08.2017	(1.109)
CHF	R1C-C	13.682.000	USD	14.316.755	07.08.2017	(130.970)
EUR	I5C-E	205.361.000	USD	234.627.699	07.08.2017	7.565.412
EUR	I1C-E	465.553.000	USD	531.889.088	07.08.2017	17.162.239
EUR	R0C-E	12.384.000	USD	14.149.203	07.08.2017	455.904
EUR	R6C-E	9.098.000	USD	10.394.728	07.08.2017	335.026
EUR	R1C-A	632.000	USD	722.651	07.08.2017	22.700
EUR	R1C-E	45.964.000	USD	52.513.295	07.08.2017	1.694.486
GBP	I5C-G	4.243.000	USD	5.516.990	07.08.2017	77.770
GBP	I1C-G	95.007.000	USD	123.534.109	07.08.2017	1.740.791
GBP	I1D-G	2.416.000	USD	3.141.390	07.08.2017	44.314
GBP	I1D-G	192.219.000	USD	249.944.240	07.08.2017	3.513.042
GBP	R0C-G	14.042.000	USD	18.259.898	07.08.2017	255.686
GBP	R5C-G	223.000	USD	289.969	07.08.2017	4.076
GBP	R6C-G	37.764.000	USD	49.104.879	07.08.2017	690.203
GBP	R1C-G	3.115.000	USD	4.050.446	07.08.2017	56.949
NOK	R1C-N	220.093.000	USD	26.292.447	07.08.2017	1.565.605
SGD	R1C-S	5.325.000	USD	3.869.317	07.08.2017	54.228
USD	I5C-E	5.158.684	EUR	4.505.000	07.08.2017	(154.255)
USD	I1C-C	664.815	CHF	639.000	07.08.2017	2.286
USD	I1C-E	52.836.657	EUR	45.878.000	07.08.2017	(1.269.319)
USD	I1C-G	756.788	GBP	580.000	07.08.2017	(7.990)
USD	I1D-G	88.841.848	GBP	68.842.000	07.08.2017	(1.931.903)
USD	R0C-E	38.042	EUR	33.000	07.08.2017	(876)
USD	R0C-G	91.709	GBP	71.000	07.08.2017	(1.910)
USD	R5C-G	9.061	GBP	7.000	07.08.2017	(169)
USD	R6C-E	12.577	EUR	11.000	07.08.2017	(395)
USD	R6C-G	325.087	GBP	251.000	07.08.2017	(5.877)
USD	R1C-A	101.245	EUR	88.000	07.08.2017	(2.537)
USD	R1C-C	1.173.574	CHF	1.125.000	07.08.2017	7.148
USD	R1C-E	3.836.833	EUR	3.350.000	07.08.2017	(113.966)
USD	R1C-G	117.789	GBP	91.000	07.08.2017	(2.202)
USD	R1C-N	638.038	NOK	5.274.000	07.08.2017	(29.510)
USD	R1C-S	253.764	SGD	350.000	07.08.2017	(4.122)
CLP		7.438.560.000	USD	11.400.000	31.08.2017	18.190
IDR		284.083.975.00	USD	21.200.000	31.08.2017	58.004
INR		4.037.111.240	USD	62.100.000	31.08.2017	584.226
KRW		7.693.930.000	USD	6.900.000	31.08.2017	(44.708)
PHP		627.761.600	USD	12.300.000	31.08.2017	113.358
RUB		702.374.800	USD	11.700.000	31.08.2017	(104.494)
TWD		209.481.800	USD	6.900.000	31.08.2017	42.227
USD		100.000	IDR	1.338.900.00	31.08.2017	(190)
USD		600.000	INR	38.604.00 0	31.08.2017	598
USD		12.000.000	KRW	13.485.811.0	31.08.2017	(15.911)
USD		200.000	PHP	10.134.5 00	31.08.2017	(400)
USD		200.000	RUB	12.022.000	31.08.2017	1.539
USD		5.600.000	TWD	169.168.000	31.08.2017	(6.223)
BRL		177.629.793	USD	56.000.000	05.09.2017	426.235
USD		240.507.421	EUR	206.524.000	06.09.2017	(3.491.653)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
CNH		560.883.604	USD	82.000.000	20.09.2017	1.097.149
EUR		5.600.000	HUF	1.733.032.26	20.09.2017	(109.326)
EUR		29.100.000	NOK	1.276.785.328	20.09.2017	(662.506)
EUR		11.100.000	PLN	47.193.165	20.09.2017	51.293
EUR		47.600.000	SEK	464.391.272	20.09.2017	(1.298.605)
HUF		6.364.560.622	EUR	20.700.000	20.09.2017	243.388
ILS		5.639.904	USD	1.600.000	20.09.2017	(12.294)
NOK		117.991.439	EUR	12.600.000	20.09.2017	52.158
PLN		285.979.505	EUR	67.700.000	20.09.2017	(824.693)
SEK		441.832.375	EUR	46.000.000	20.09.2017	395.942
SGD		18.978.113	USD	13.800.000	20.09.2017	193.455
TRY		110.186.980	USD	30.500.000	20.09.2017	282.165
USD		14.200.000	CNH	96.467.866	20.09.2017	(92.354)
USD		1.300.000	ILS	4.606.710	20.09.2017	3.145
USD		13.000.000	SGD	17.855.848	20.09.2017	(165.835)
USD		11.200.000	TRY	40.663.917	20.09.2017	(162.533)
USD		6.600.000	ZAR	88.367.382	20.09.2017	(40.449)
ZAR		279.254.430	USD	21.400.000	20.09.2017	(416.264)
IDR		264.116.900.00	USD	19.700.000	29.09.2017	480
INR		2.188.101.570	USD	33.600.000	29.09.2017	278.377
INR		2.692.965.300	USD	41.400.000	31.10.2017	163.221
						21.798.174

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity die nachstehenden Devisentermingeschäfte aus:

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
GBP	I1C-G	29.145	EUR	32.682	31.08.2017	(112)
USD	I1C-U	105.610	EUR	90.390	31.08.2017	(940)
						(1.052)

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV Basso die nachstehend angegebenen Devisentermingeschäfte aus:

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeitstermin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
EUR	I1C-E	17.835.107	USD	20.841.928	31.08.2017	215.395
EUR	I2C-E	10.510.138	USD	12.282.042	31.08.2017	126.931
EUR	I3C-E	5.679.987	USD	6.637.576	31.08.2017	68.597
EUR	R3C-E	10.019	USD	11.708	31.08.2017	121
EUR	R4C-E	1.334.889	USD	1.559.938	31.08.2017	16.121
GBP	R4C-G	111.448	USD	146.011	31.08.2017	1.037
						428.202

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV Clinton Equity Strategies die nachstehend angegebenen Devisentermingeschäfte aus:

Kauf	Anteilsklasse		Verkauf		Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
CHF	I1C-C	2.836.988	USD	2.951.722	31.08.2017	(6.355)
CHF	I2C-C	12.004	USD	12.490	31.08.2017	(27)
CHF	R0C-C	256.653	USD	267.032	31.08.2017	(574)
CHF	R1C-C	190.298	USD	197.994	31.08.2017	(426)
EUR	I1C-E	2.061.590	USD	2.409.154	31.08.2017	24.897
EUR	I2C-E	2.415.516	USD	2.822.748	31.08.2017	29.172
EUR	I3C-E	197.993	USD	231.373	31.08.2017	2.391
EUR	R0C-E	1.114.492	USD	1.302.384	31.08.2017	13.460
EUR	R1C-E	3.069.944	USD	3.587.506	31.08.2017	37.076
GBP	I1C-G	258.704	USD	338.936	31.08.2017	2.407
GBP	I2C-G	8.435	USD	11.052	31.08.2017	77
GBP	R0C-G	144.425	USD	189.215	31.08.2017	1.343
						103.441

10. Futures

Zum 31. Juli 2017 stand für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI Euro der nachstehend angegebene Futures-Kontrakt aus:

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontraktvolum in der Währung des Futures	Fälligkeits termin	Nicht realisierterGewinn/ (Verlust) EUR
EURO STOXX 50 PR	67	EUR	2.309.490	15.09.2017	(18.230)
					(18.230)

Zum 31. Juli 2017 stand für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI US der nachstehend angegebene Futures-Kontrakt aus:

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontraktvolum in der Währung des Futures	Fälligkeits termin	Nicht realisierterGewinn/ (Verlust) USD
S&P 500 EMINI INDEX	1	USD	123.400	15.09.2017	2.078
					2.078

Zum 31. Juli 2017 stand für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI Japan der nachstehend angegebene Futures-Kontrakt aus:

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontraktvolum in der Währung des Futures	Fälligkeits termin	Nicht realisierterGewinn/ (Verlust) JPY
TOPIX INDEX (TOKYO)	2	JPY	32.390.000	07.09.2017	279.619
					279.619

10. Futures (Fortsetzung)

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV Systematic Alpha die nachstehend angegebenen Futures-Kontrakte aus:

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des Futures	Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
10 YEAR TREAS.BOND AUSTRAL.6%	315	AUD	40.620.686	15.09.2017	(464.571)
3 YEAR TREASURY BOND AUSTRALIA	379	AUD	42.351.707	15.09.2017	(44.686)
90 DAY BANK ACCEPTED BILL AUST	116	AUD	115.464.749	07.06.2018	(21.814)
90 DAY BANK ACCEPTED BILL AUST	243	AUD	241.979.709	07.09.2017	3.299
90 DAY BANK ACCEPTED BILL AUST	263	AUD	261.876.443	07.12.2017	(14.876)
90 DAY BANK ACCEPTED BILL AUST	165	AUD	164.270.908	08.03.2018	(14.443)
90 DAY BANK ACCEPTED BILL AUST	18	AUD	17.913.427	13.09.2018	58
S&P / ASX 200 INDEX	178	AUD	25.191.450	21.09.2017	38.800
10 YEARS CANADIAN BONDS	11	CAD	1.510.190	20.09.2017	(20.023)
BANKERS ACC.CANADIAN 3 MONTHS	(6)	CAD	(1.479.825)	18.09.2017	1.459
BANKERS ACC.CANADIAN 3 MONTHS	(47)	CAD	(11.573.163)	18.12.2017	22.040
S&P INDICES S&P/TSX 60 INDEX	18	CAD	3.201.840	14.09.2017	(20.637)
EURO CHF 3 MONTH	(25)	CHF	(6.295.625)	18.09.2017	1.296
EURO CHF 3 MONTH	(12)	CHF	(3.021.300)	18.12.2017	907
10Y BTP ITALIAN BOND	88	EUR	11.989.120	07.09.2017	(27.424)
90 DAYS - EURO $ FUTURE	78	EUR	19.430.775	14.09.2020	280
AEX	38	EUR	3.966.440	18.08.2017	28.614
CAC 40	257	EUR	13.081.300	18.08.2017	(259.858)
DAX-INDEX	97	EUR	29.365.538	15.09.2017	(1.517.594)
EURIBOR 360 /3 MONATE	195	EUR	48.615.938	15.06.2020	(37.477)
EURIBOR 360 /3 MONATE	201	EUR	50.149.500	16.03.2020	(22.003)
EURIBOR 360 /3 MONATE	225	EUR	56.221.875	16.09.2019	(8.415)
EURIBOR 360 /3 MONATE	212	EUR	52.933.750	16.12.2019	(13.293)
EURIBOR 360 /3 MONATE	234	EUR	58.508.775	17.06.2019	(5.143)
EURIBOR 360 /3 MONATE	239	EUR	59.875.475	17.09.2018	3.802
EURIBOR 360 /3 MONATE	239	EUR	59.836.638	17.12.2018	943
EURIBOR 360 /3 MONATE	238	EUR	59.550.575	18.03.2019	766
EURIBOR 360 /3 MONATE	240	EUR	60.153.000	18.06.2018	(545)
EURIBOR 360 /3 MONATE	144	EUR	36.104.400	19.03.2018	(280)
EURO BOBL	646	EUR	85.310.760	07.09.2017	(23.780)
EURO BUND	599	EUR	97.008.050	07.09.2017	(1.056.974)
EURO OAT FUTURES	152	EUR	22.614.560	07.09.2017	(254.004)
EURO SCHATZ	893	EUR	100.078.510	07.09.2017	18.699
EURO STOXX 50 PR	1.584	EUR	54.600.480	15.09.2017	(1.619.168)
EURO STOXX 50 PR	(102)	EUR	(3.515.940)	15.09.2017	117.900
FTSE MIB INDEX	23	EUR	2.470.200	15.09.2017	58.626
SHORT EURO BTP IT	130	EUR	14.679.600	07.09.2017	61.815
3M SHORT STERLING	67	GBP	8.291.250	16.09.2020	(4.235)
3M SHORT STERLING	242	GBP	29.965.650	17.06.2020	(32.810)
3M SHORT STERLING	293	GBP	36.299.038	18.03.2020	(39.270)
3M SHORT STERLING	347	GBP	43.036.675	18.09.2019	(37.425)
3M SHORT STERLING	319	GBP	39.540.050	18.12.2019	(40.473)
3M SHORT STERLING	376	GBP	46.656.900	19.06.2019	(38.446)
3M SHORT STERLING	423	GBP	52.568.325	19.09.2018	(34.804)
3M SHORT STERLING	409	GBP	50.802.913	19.12.2018	(34.640)
3M SHORT STERLING	395	GBP	49.039.250	20.03.2019	(36.189)
3M SHORT STERLING	428	GBP	53.216.450	20.06.2018	(32.695)

Anhang zum Abschluss (Fortsetzung)
zum 31. Juli 2017

10. Futures (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des Futures	Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
3M SHORT STERLING	310	GBP	38.567.875	21.03.2018	(22.527)
LONG GILT STERLING FUTURES	224	GBP	28.228.480	27.09.2017	(344.142)
UKX FTSE 100 INDEX	371	GBP	27.120.100	15.09.2017	(535.316)
HONG KONG HANG SENG INDICES	281	HKD	382.553.400	30.08.2017	816.364
HSCEI - HKD CHINA ENT	249	HKD	134.870.850	30.08.2017	24.430
JAPANESE GOV. BDS FUTURE 10Y	92	JPY	13.814.720.000	12.09.2017	(134.214)
NIKKEI 225 INDICES D	349	JPY	6.959.060.000	07.09.2017	(521.109)
TOPIX INDEX (TOKYO)	370	JPY	5.992.150.000	07.09.2017	463.550
KOREA KOSPI 200 INDEX	437	KRW	34.402.825.000	14.09.2017	588.223
90-DAY BK ACC.BILL NEW ZEALAND	147	NZD	146.296.574	13.09.2017	17.446
90-DAY BK ACC.BILL NEW ZEALAND	130	NZD	129.362.050	13.12.2017	14.659
SWED OPTI OMX STOCKHOLM 30 IDX	323	SEK	49.903.500	18.08.2017	(230.208)
SIMSCI MSCI SINGAPORE FREE	194	SGD	7.147.930	30.08.2017	62.700
10Y TREASURY NOTES USA	708	USD	89.130.563	20.09.2017	(466.405)
2Y TREASURY NOTES USA	(141)	USD	(30.504.469)	29.09.2017	(38.562)
30Y TREASURY NOTES USA	137	USD	22.536.500	20.09.2017	(547.063)
5Y TREASURY NOTES USA	377	USD	44.541.961	29.09.2017	18.102
90 DAYS - EURO $ FUTURE	92	USD	22.519.300	14.09.2020	4.813
90 DAYS - EURO $ FUTURE	241	USD	59.017.888	15.06.2020	(300)
90 DAYS - EURO $ FUTURE	273	USD	66.885.000	16.03.2020	1.050
90 DAYS - EURO $ FUTURE	317	USD	77.756.138	16.09.2019	2.238
90 DAYS - EURO $ FUTURE	301	USD	73.778.863	16.12.2019	(63)
90 DAYS - EURO $ FUTURE	344	USD	84.421.900	17.06.2019	2.263
90 DAYS - EURO $ FUTURE	542	USD	133.257.475	17.09.2018	(7.675)
90 DAYS - EURO $ FUTURE	470	USD	115.461.375	17.12.2018	613
90 DAYS - EURO $ FUTURE	395	USD	96.987.313	18.03.2019	(1.825)
90 DAYS - EURO $ FUTURE	651	USD	160.162.275	18.06.2018	(18.675)
90 DAYS - EURO $ FUTURE	452	USD	111.271.100	19.03.2018	(40.013)
AUD/USD SPOT CROSS	737	USD	58.915.780	18.09.2017	908.530
CURRENCY FUTURE /CAD	914	USD	73.449.040	19.09.2017	1.316.260
DJ CBOT MINI SIZED DJ IND AV	167	USD	18.238.070	15.09.2017	532.820
EUR/USD SPOT -CROSS RATES	624	USD	92.511.900	18.09.2017	2.668.338
GBP/USD SPOT CROSS	(1.780)	USD	(147.039.125)	18.09.2017	(3.547.456)
JPY/USD SPOT CROSS	(3.289)	USD	(373.753.738)	18.09.2017	(6.175.969)
MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	584	USD	31.083.400	15.09.2017	1.461.145
MXN/USD SPOT/CROSS	1.756	USD	48.913.380	18.09.2017	793.090
NASDAQ 100 E-MINI INDEX	574	USD	67.531.100	15.09.2017	1.294.498
NSE S&P CNX NIFTY INDEX	211	USD	4.264.732	31.08.2017	67.532
NZD/USD SPOT CROSS	120	USD	9.003.600	18.09.2017	253.950
RUSSELL 2000 INDEX	(2.342)	USD	(166.797.240)	15.09.2017	(171.923)
S&P 500 EMINI INDEX	3.384	USD	417.585.600	15.09.2017	5.928.530
S&P 500 EMINI INDEX	(155)	USD	(19.127.000)	15.09.2017	(270.463)
S&P MIDCAP 400 INDEX EMINI	45	USD	7.919.100	15.09.2017	(13.285)
SPOT / CROSS CHF / USD	(257)	USD	(33.326.475)	18.09.2017	(50.956)
TAMSCI MSCI TAIWAN IDX FUT	288	USD	11.232.000	30.08.2017	540
US TREASURY BONDS	226	USD	34.570.938	20.09.2017	(652.438)
XIN9I FTSE CHINA A50 INDEX	447	USD	5.296.950	30.08.2017	(30.793)
FTSE/JSE AFRICA INDEX TOP40	(63)	ZAR	(30.786.840)	21.09.2017	(144.756)
					(2.143.143)

10. Futures (Fortsetzung)

Zum 31. Juli 2017 stand für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI Europe der nachstehend angegebene Futures-Kontrakt aus:

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des Futures	Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
EURO STOXX 50 PR	1	EUR	34.470	15.09.2017	(1.069)
					(1.069)

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV Basso die nachstehend angegebenen Futures-Kontrakte aus:

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontraktvolumen in der Währung des Futures	Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD
EURO BOBL	(21)	EUR	(2.773.260)	07.09.2017	25.749
10Y TREASURY NOTES USA	(18)	USD	(2.266.031)	20.09.2017	15.469
5Y TREASURY NOTES USA	(55)	USD	(6.498.164)	29.09.2017	21.484
					62.702

Zum 31. Juli 2017 standen für den Teilfonds DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control die nachstehend angegebenen Futures-Kontrakte aus:

Beschreibung	Anzahl der Kontrakte	Währung	Kontraktvolumen in der Währung des Futures	Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
EURO STOXX 50 PR	5	EUR	172.350	15.09.2017	(1.360)
S&P 500 EMINI INDEX	2	USD	246.800	15.09.2017	3.435
					2.075

11. Differenzgeschäfte (CFD)

Beträgt der nicht realisierte Nettogewinn (-verlust) in diesem Abschnitt null, bedeutet dies, dass zum 31. Juli 2017 eine Zurücksetzung vorgenommen wurde.

Zum 31. Juli 2017 bestehen folgende CFD in Bezug auf den Teilfonds DB Platinum IV Systematic Alpha:

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
21ST CENTURY -SHS A-	(20.784)	USD	(604.814)	0
3M CO	8.796	USD	1.769.491	0
ABBOTT LABORATORIES INC	(13.786)	USD	(677.995)	0
ABBVIE INC	15.655	USD	1.094.441	0
ABIOMED INC.	(787)	USD	(116.547)	0
ACADIA REALITY TRUST	22.987	USD	683.633	0
ACCENTURE PLC	2.609	USD	336.091	0
ACERINOX SA	(7.416)	EUR	(80.612)	0
ACTIVISION BLIZZARD INC	38.144	USD	2.356.536	0
ACUITY BRANDS INC	(5.459)	USD	(1.106.266)	0
ADMIRAL GROUP PLC	(3.170)	GBP	(65.556)	0
ADOBE SYSTEMS INC	9.743	USD	1.427.252	0
ADVANCE AUTO PARTS INC	(735)	USD	(82.327)	0
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES INC	1.267	USD	91.921	0
ADVANCED MICRO DEVICES INC	3.932	USD	53.515	0
AECOM	(11.310)	USD	(360.789)	0
AES CORP.	8.697	USD	97.232	0
AETNA INC	22.595	USD	3.486.634	0
AFLAC INC.	(3.621)	USD	(288.775)	0
AGCO CORP.	7.393	USD	533.331	0
AGILENT TECHNOLOGIES	22.322	USD	1.334.632	0
AIG	(25.148)	USD	(1.645.937)	0
AIR LIQUIDE	2.608	EUR	270.450	0
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	(5.262)	USD	(747.993)	0
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	(973)	USD	(45.867)	0
AKORN INC	(8.195)	USD	(275.516)	0
AKZO NOBEL NV (EUR 2)	3.693	EUR	282.219	0
ALASKA AIR GROUP INC	5.845	USD	498.169	0
ALBEMARLE CORP	(4.419)	USD	(511.720)	0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ.	(1.161)	USD	(140.771)	0
ALEXION PHARMA INC	(637)	USD	(87.486)	0
ALKERMES PLC	2.240	USD	121.878	0
ALLEGHANY CORP (DEL)	322	USD	197.495	0
ALLEGIANT TRAVEL CO	2.852	USD	368.621	0
ALLEGION PLC	330	USD	26.809	0
ALLERGAN PLC	(14.046)	USD	(3.544.227)	0

10. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ALLETE INC	(2.835)	USD	(207.720)	0
ALLIANCE DATA SYSTEM CORP	1.464	USD	353.454	0
ALLIANT ENERGY CORP	2.311	USD	93.665	0
ALLSCRIPTS HEALTHCARE SOL INC	8.811	USD	108.463	0
ALLSTATE CORP	21.058	USD	1.916.278	0
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1.693	USD	140.079	0
ALPHABET INC -A-	7.930	USD	7.497.815	0
ALPHABET INC -C-	(469)	USD	(436.405)	0
ALTRIA GROUP	119.520	USD	7.765.214	0
AMAZON COM INC	(134)	USD	(132.363)	0
AMC NETWORKS INC	1.482	USD	94.774	0
AMEREN CORP	(20.180)	USD	(1.132.098)	0
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	(7.650)	USD	(385.866)	0
AMERICAN ELECTRIC POWER CO.INC	(11.969)	USD	(844.293)	0
AMERICAN EXPRESS CO.	19.055	USD	1.624.058	0
AMERICAN TOWER CORP	3.129	USD	426.577	0
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4.212	USD	341.593	0
AMERIPRISE FINANC. /WH.I	6.853	USD	992.863	0
AMERISOURCEBERGEN CORP	9.656	USD	905.926	0
AMETEK INC	(19.377)	USD	(1.193.236)	0
AMGEN INC	1.680	USD	293.177	0
AMPHENOL CORPORATION -A-	(9.205)	USD	(705.287)	0
ANADARKO PETROL.CORP.	(13.604)	USD	(621.295)	0
ANALOG DEVICES INC	15.998	USD	1.264.002	0
ANGLO AMERICAN PLC	(68)	GBP	(852)	0
ANIXTER INTL	1.200	USD	94.500	0
ANTHEM INC	13.921	USD	2.592.229	0
AON PLC	10.248	USD	1.415.966	0
APACHE CORP.	(9.501)	USD	(470.109)	0
APARTMENT INV.+MANAG.-A-	3.203	USD	145.897	0
APPLE INC	13.578	USD	2.019.456	0
APPLIED INDUSTRIAL TECHNOLOG.	(1.853)	USD	(104.695)	0
APPLIED MATERIALS INC	44.790	USD	1.984.645	0
APTARGROUP INC	(7.443)	USD	(602.362)	0
AQUA AMERICA INC	5.872	USD	196.007	0
ARCELORMITTAL SA	(4.138)	EUR	(91.843)	0
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	(9.570)	USD	(403.663)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ARCONIC INC	(43.649)	USD	(1.082.059)	0
ARKEMA	2.934	EUR	282.192	0
ARROW ELECTRONICS INC.	7.013	USD	570.087	0
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	10.502	USD	682.315	0
ASSURANT INC	(3.335)	USD	(351.075)	0
ASTRAZENECA PLC	(1.759)	GBP	(80.369)	0
AT & T	(84.875)	USD	(3.310.125)	0
AUTODESK INC.	14.015	USD	1.552.722	0
AUTOLIV INC	(4.967)	USD	(538.373)	0
AUTOMATIC DATA PROCES.	9.259	USD	1.100.988	0
AUTONATION INC	4.511	USD	191.176	0
AUTOZONE INC	235	USD	126.858	0
AVALONBAY COMMUNITIES INC.	1.491	USD	286.794	0
AVERY DENNISON CORP	2.775	USD	257.881	0
AVISTA CORP	13.615	USD	716.285	0
AVIVA PLC	(12.096)	GBP	(65.197)	0
AVNET INC	(2.826)	USD	(108.462)	0
B&G FOODS INC	(18.690)	USD	(677.513)	0
BAKER HUGHES A GE COMPANY	(2.052)	USD	(75.698)	0
BALL CORP.	(33.873)	USD	(1.419.279)	0
BANCORPSOUTH INC.	(3.393)	USD	(101.960)	0
BANK OF AMERICA CORP	(29.593)	USD	(713.783)	0
BANK OF HAWAII CORP	(6.428)	USD	(537.831)	0
BANK OF NY MELLON CORP SHS	5.445	USD	288.748	0
BANK OF THE OZARKS INC	(5.816)	USD	(250.960)	0
BARCLAYS PLC	(126.107)	GBP	(255.997)	0
BARD (C.R.) INC	1.351	USD	433.131	0
BARRATT DEVEL.PLC	39.962	GBP	245.966	0
BASF NAMEN-AKT.	3.416	EUR	275.295	0
BAXTER INTL INC	(6.668)	USD	(403.281)	0
BB&T CORPORATION	(31.134)	USD	(1.473.261)	0
BECTON DICKINSON & CO.	1.130	USD	227.582	0
BED BATH & BEYOND INC.	(22.542)	USD	(674.006)	0
BERKELEY GROUP HOLDINGS	7.115	GBP	248.740	0
BERKSHIRE HATHAWAY - B	(3.898)	USD	(682.033)	0
BEST BUY CO INC.	15.050	USD	878.017	0
BHP BILLITON PLC	(60)	GBP	(827)	0
BIO TECHNE CORP	(4.690)	USD	(543.618)	0
BIOGEN INC	727	USD	210.532	0
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1.444	USD	126.682	0
BLACKROCK INC	(238)	USD	(101.514)	0
BLOCK INC. H+R	3.633	USD	110.807	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
BMW-BAYER.MOTORENWERKE	489	EUR	38.000	0
BOEING CO	5.195	USD	1.259.580	0
BORG WARNER INC	(19.486)	USD	(910.776)	0
BOSTON PROPERTIES	(1.663)	USD	(201.073)	0
BOSTON SCIENTIFIC CORP.	(12.258)	USD	(326.308)	0
BOYD GAMING	(25.469)	USD	(638.253)	0
BRDRDG FNCL SOLUTIONS /WH.ISS.	(4.020)	USD	(304.957)	0
BRINKS CO.	8.357	USD	653.100	0
BRISTOL MYERS SQUIBB CO	(24.508)	USD	(1.394.505)	0
BRITISH AMERICAN TOBACCO (25P)	15.695	GBP	739.784	0
BRITISH LAND CO PLC R.E.I.T	(5.001)	GBP	(30.531)	0
BROADCOM LIMITED	3.571	USD	880.823	0
BRUNSWICK CORP	(2.334)	USD	(132.128)	0
BRWN-FRMAN CORP. B /NON-VOT	(11.045)	USD	(545.623)	0
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	(585)	USD	(38.376)	0
CABLE ONE INC	(361)	USD	(274.324)	0
CABOT OIL+GAS INC./CL.	(22.937)	USD	(570.443)	0
CACI INT.INC. -A-	928	USD	116.093	0
CADENCE DESIGN SYSTEMS	28.548	USD	1.053.421	0
CAMDEN PROPERTY /BENEF.INT/REIT	(5.704)	USD	(511.649)	0
CAMPBELL SOUP CO.	2.359	USD	124.626	0
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	(2.537)	USD	(200.474)	0
CANADIAN PACIFIC RAILW.	(1.505)	USD	(235.337)	0
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP.	4.323	USD	372.556	0
CARDINAL HEALTH INC.	7.332	USD	566.470	0
CARE CAP /REIT	12.061	USD	292.117	0
CARLISLE COS INC	1.310	USD	127.843	0
CARMAX /WHEN ISSUED	1.334	USD	88.378	0
CARNIVAL CORP	18.467	USD	1.233.226	0
CASEY S GENERAL STORES INC	(4.980)	USD	(531.615)	0
CATERPILLAR INC.	(2.375)	USD	(270.631)	0
CATHAY GENERAL BANCORP	(2.901)	USD	(108.642)	0
CBOE HOLDINGS INC	(545)	USD	(51.519)	0
CBRE GROUP -A-	8.919	USD	338.833	0
CELANESE CORP SERIES -A-	(10.015)	USD	(963.143)	0
CELGENE CORP.	(1.366)	USD	(184.970)	0
CENTENE CORP. DE	34.382	USD	2.730.618	0
CENTERPOINT ENERGY INC	(34.321)	USD	(967.509)	0
CENTURYLINK INC	(162.845)	USD	(3.789.403)	0
CERNER CORP	(1.687)	USD	(108.592)	0
CF INDUSTRIES HOLDING INC	(40.611)	USD	(1.191.933)	0
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	16.559	USD	1.626.094	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
CHARLES SCHWAB CORP	(627)	USD	(26.898)	0
CHARTER COMMUNICATIONS INC	(1.182)	USD	(463.238)	0
CHEMIACAL FINANCIAL CORP	(15.754)	USD	(759.185)	0
CHEMOURS COMPANY CO.(THE)	7.335	USD	349.219	0
CHESAPEAKE ENERGY	(20.542)	USD	(101.888)	0
CHEVRON CORPORATION	(12.944)	USD	(1.413.355)	0
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	(1.217)	USD	(418.368)	0
CHUBB LTD	6.310	USD	924.163	0
CHURCH & DWIGHT CO INC	38.000	USD	2.027.300	0
CIENA CORP	(14.618)	USD	(376.414)	0
CIGNA CORP.	21.781	USD	3.780.310	0
CIMAREX ENERGY CO /WHEN ISSUED	(7.427)	USD	(735.496)	0
CINCINNATI FINANCIAL CORP	(9.482)	USD	(722.149)	0
CINTAS	2.331	USD	314.335	0
CIRRUS LOGIC INC.	5.530	USD	339.763	0
CISCO SYSTEMS INC.	39.993	USD	1.257.780	0
CITIGROUP INC	(16.595)	USD	(1.135.928)	0
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	(26.322)	USD	(923.376)	0
CITRIX SYSTEMS INC	35.338	USD	2.790.995	0
CLEAN HARBORS INC	2.233	USD	126.834	0
CLOROX CO *OPA*	15.110	USD	2.017.034	0
CME GROUP INC	(12.719)	USD	(1.559.604)	0
CMS ENERGY CORP.	(1.337)	USD	(61.823)	0
COACH INC	(1.253)	USD	(59.066)	0
COCA-COLA CO.	(17.525)	USD	(803.346)	0
COGNIZANT TECHNOLOGY SOL A	(10.216)	USD	(708.173)	0
COHERENT INC.	(364)	USD	(96.460)	0
COLGATE-PALMOLIVE CO.	40.286	USD	2.908.649	0
COLUMBIA BK SYSTEM	(2.996)	USD	(119.361)	0
COMCAST CORP/-A-	17.307	USD	700.068	0
COMERICA INC.	(5.036)	USD	(364.153)	0
COMMUNITY BANK SYSTEM INC.	(10.919)	USD	(599.453)	0
COMPASS MINERALS INTERNATIONAL	(6.875)	USD	(474.719)	0
COMPUTER ASSOCIATES INTL INC	67.743	USD	2.102.743	0
CONAGRA BRANDS INC	55	USD	1.883	0
CONCHO RESOURCES INC	(3.540)	USD	(461.120)	0
CONOCOPHILLIPS	(5.231)	USD	(237.330)	0
CONSOLIDATED EDISON INC	(11.554)	USD	(957.364)	0
CONSTELLATION BRAND -A-	839	USD	162.221	0
CONTINENTAL AG	206	EUR	39.243	0
COOPER COMPANIES INC.	(262)	USD	(63.894)	0
CORECIVIC INC /REIT	(13.035)	USD	(361.070)	0
CORELOGIC	15.482	USD	705.205	0
CORNING INC.	12.339	USD	359.558	0
COSTCO WHOLESALE CORP	(3.494)	USD	(553.834)	0
COTY INC-CL A	(35.142)	USD	(719.708)	0
COUSINS PROPERTIES SHS	(57.212)	USD	(525.778)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
COVESTRO AG	4.322	EUR	283.610	0
CRANE CO	(1.935)	USD	(146.093)	0
CREE INC	3.511	USD	90.970	0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL SHS	(14.149)	USD	(1.423.106)	0
CSRA INC	(458)	USD	(14.935)	0
CSX CORP.	(5.150)	USD	(254.101)	0
CULLEN FROST BANKERS INC	(6.195)	USD	(562.382)	0
CUMMINS INC	2.282	USD	383.148	0
CURTISS-WRIGHT CORP.	1.489	USD	143.569	0
CVS HEALTH CORP	18.079	USD	1.445.054	0
CYPRESS SEMICONDUCTORS	(10.378)	USD	(147.368)	0
DAIMLER AG / NAMEN-AKT.	631	EUR	37.412	0
DANA INC	(4.849)	USD	(115.018)	0
DANAHER CORP	(8.200)	USD	(668.218)	0
DARDEN RESTAURANTS	3.062	USD	256.841	0
DARLING INGRED --- SHS	32.986	USD	536.682	0
DAVITA INC --- SHS	7.809	USD	505.867	0
DEERE & CO.	8.099	USD	1.038.940	0
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	(6.968)	USD	(630.047)	0
DELTA AIR LINES	(2.672)	USD	(131.890)	0
DENTSPLY SIRONA INC	(19.939)	USD	(1.236.816)	0
DEUTSCHE TELEKOM /NAM.	(9.356)	EUR	(144.503)	0
DEVON ENERGY CORP.(NEW)	(16.234)	USD	(540.755)	0
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	(13.434)	USD	(166.850)	0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	(45.755)	USD	(534.418)	0
DIGITAL RLTY TR INC	(4.416)	USD	(509.341)	0
DIRECT LINE	(17.718)	GBP	(66.372)	0
DISCOVER FIN SVC	5.434	USD	331.148	0
DISCOVERY COM INC/-A-	(23.394)	USD	(575.492)	0
DOLLAR GENERAL CORPORATION	1.586	USD	119.204	0
DOLLAR TREE INC	(7.000)	USD	(504.560)	0
DOMINION ENERGY INC	(6.802)	USD	(524.978)	0
DOMTAR	(17.141)	USD	(669.527)	0
DONALDSON CO	(3.440)	USD	(163.366)	0
DOUGLAS EMMETT /REIT	(15.040)	USD	(575.430)	0
DOVER CORP.	(6.754)	USD	(567.336)	0
DOW CHEMICAL CO.	(18.240)	USD	(1.171.738)	0
DR HORTON INC	(4.865)	USD	(173.632)	0
DR PEPPER SNAPPLE GRP INC	18.002	USD	1.641.062	0
DST SYSTEMS INC	10.497	USD	576.285	0
DTE ENERGY COMPANY	(9.867)	USD	(1.056.361)	0
DU PONT DE NEM.& CO/E.I.	(10.479)	USD	(861.479)	0
DUKE ENERGY	(35.662)	USD	(3.035.549)	0
DUN AND BRADSTREET CORP	(3.561)	USD	(394.416)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
E TRADE FINANCIAL CORP	(29.761)	USD	(1.220.201)	0
EASTGROUP PROPERTIES INC	(9.102)	USD	(793.512)	0
EASTMAN CHEMICAL CO	(8.703)	USD	(723.741)	0
EATON CORPORATION PUBLIC LTD	(25.253)	USD	(1.976.047)	0
EBAY INC	36.473	USD	1.303.180	0
ECOLAB INC.	(7.044)	USD	(927.483)	0
EDISON INTERNATIONAL	10.326	USD	812.450	0
EDWARDS LIFESCIENCES	608	USD	70.029	0
EL PASO ELECTRIC CO	(3.584)	USD	(186.010)	0
ELECTRONIC ARTS	19.461	USD	2.271.877	0
ELECTRONICS FOR IMAGING INC	2.751	USD	133.644	0
EMERSON ELECTRIC CO.	(18.764)	USD	(1.118.522)	0
ENDO INTERNATIONAL - SHS	(206.723)	USD	(2.278.087)	0
ENERGIZER HOLDINGS INC	(3.825)	USD	(176.218)	0
ENERSYS INC	2.603	USD	188.119	0
ENTERGY CORP.	(23.387)	USD	(1.794.251)	0
ENVISION HEALTHCARE CORP	(1.122)	USD	(63.314)	0
EOG RESOURCES INC.	(7.065)	USD	(672.164)	0
EPR PROPERTIES	6.235	USD	451.289	0
EQT	(14.843)	USD	(945.499)	0
EQUIFAX INC	366	USD	53.231	0
EQUINIX INC /REIT	(284)	USD	(128.007)	0
ESSEX PROPERTY TRUST	(2.745)	USD	(718.367)	0
ESTEE LAUDER CO -A-	6.212	USD	614.926	0
ESTERLINE TECHNOLOGIES CORP.	6.016	USD	580.544	0
EVEREST REINSURANCE GROUP LTD	3.897	USD	1.022.534	0
EVERSOURCE ENERGY	(22.134)	USD	(1.345.526)	0
EVONIK INDUSTR -SHS-	9.717	EUR	279.850	0
EXELON CORP	(36.593)	USD	(1.402.976)	0
EXPEDIA INC DEL	(1.081)	USD	(169.144)	0
EXPEDITORS INTL WASH.	503	USD	29.617	0
EXPRESS SCRIPTS HLD	9.829	USD	615.689	0
EXTRA SPACE STORAGE INC	798	USD	63.441	0
EXXON MOBIL CORP	(6.765)	USD	(541.471)	0
F5 NETWORKS INC.	11.124	USD	1.343.223	0
FACEBOOK INC -A-	49.813	USD	8.430.850	0
FASTENAL	(11.736)	USD	(504.179)	0
FED.REALTY INV.TR./SBI	(1.075)	USD	(142.577)	0
FEDERATED INVESTORS INC. B	(16.672)	USD	(480.654)	0
FEDEX CORP.	(1.987)	USD	(413.356)	0
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES N.V	(57.357)	USD	(693.446)	0
FIDELITY NATL INFORM SERV	(11.452)	USD	(1.044.651)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
FIFTH THIRD BANCORP	(2.390)	USD	(63.813)	0
FIRST FINANCIAL BANKSHA INC	(2.368)	USD	(102.416)	0
FIRST SOLAR INC	(3.488)	USD	(171.993)	0
FIRSTENERGY CORP	(80.030)	USD	(2.553.757)	0
FISERV INC.	15.123	USD	1.943.306	0
FIVE BELOW SHS	(1.684)	USD	(81.354)	0
FLIR SYSTEMS	(23.764)	USD	(886.872)	0
FLOWERS FOODS INC	6.755	USD	118.820	0
FLOWSERVE CORP	(18.576)	USD	(764.031)	0
FLUOR CORP (NEW)	700	USD	30.401	0
FMC CORP.	(12.791)	USD	(976.977)	0
FNB CORP	(42.940)	USD	(588.278)	0
FOOT LOCKER INC	10.972	USD	517.769	0
FORD MOTOR CO	(122.907)	USD	(1.379.017)	0
FORTIVE CORP	(5.921)	USD	(383.326)	0
FR BRND HOM SEC	17.593	USD	1.155.332	0
FRANKLIN RESOURCES INC.	(2.815)	USD	(126.056)	0
FREEPORT MCMORAN INC	(11.590)	USD	(169.446)	0
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP NPV	(18.489)	USD	(283.067)	0
FUCHS PETROLUB VZ.A.	5.744	EUR	288.349	0
GALLAGHER+CO ARTHUR J.	24.240	USD	1.425.070	0
GAP INC.	18.091	USD	431.109	0
GARMIN	8.803	USD	441.823	0
GARTNER INC. *OPA*	(297)	USD	(38.111)	0
GATX CORP	2.363	USD	146.104	0
GENERAL ELECTRIC CO	(34.016)	USD	(871.150)	0
GENERAL MILLS INC	(330)	USD	(18.368)	0
GENERAL MOTORS CO	(39.987)	USD	(1.438.732)	0
GENESEE & WYOMING INC -A-	(10.602)	USD	(690.826)	0
GENTEX CORP	(29.953)	USD	(509.800)	0
GENUINE PARTS CO	799	USD	67.859	0
GGP --- REGISTERED SHS	18.839	USD	425.950	0
GILEAD SCIENCES INC.	14.919	USD	1.135.187	0
GLAXOSMITHKLINE	(5.453)	GBP	(82.586)	0
GLENCORE	(245)	GBP	(819)	0
GLOBAL PAYMENTS INC	(6.575)	USD	(620.483)	0
GOODYEAR TIRE & RUBBER	(5.248)	USD	(165.364)	0
GRANITE CONSTRUCTION INC	(6.497)	USD	(318.483)	0
GREIF INC	1.791	USD	100.457	0
HAIN CELESTIAL GROUP INC.	2.284	USD	102.118	0
HALLIBURTON CO	(19.918)	USD	(845.320)	0
HAMMERSON	(5.407)	GBP	(31.063)	0
HANESBRANDS INC	1.099	USD	25.189	0
HARLEY DAVIDSON INC.	(5.542)	USD	(269.729)	0
HARRIS CORP.	3.959	USD	453.187	0
HARTFORD FIN.SERV.GROUP	(4.924)	USD	(270.820)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
HASBRO INC.	3.583	USD	379.368	0
HAWAIIAN ELECTRIC INDUSTRIES	5.701	USD	188.076	0
HAWAIIAN HLD INC	1.417	USD	58.664	0
HCA HEALTHCARE INC	7.422	USD	596.283	0
HCP SHS	2.578	USD	81.594	0
HEALTHCARE REALTY TRUST	16.351	USD	544.488	0
HELMERICH & PAYNE	(7.305)	USD	(369.779)	0
HENRY JACK & ASSOCIATES INC.	(2.349)	USD	(252.095)	0
HENRY SCHEIN INC.	1.065	USD	194.054	0
HERMES INTERNATIONAL	1.310	EUR	560.680	0
HESS CORP	(8.314)	USD	(370.306)	0
HEWLETT PACKARD ENT CO	(41.277)	USD	(722.760)	0
HILTON INC	17.403	USD	1.088.210	0
HOLLYFRONTIER CORP	(42.963)	USD	(1.239.053)	0
HOLOGIC INC	3.487	USD	154.160	0
HOME BANCSHARES INC	(20.315)	USD	(503.812)	0
HOME DEPOT INC.	3.538	USD	529.285	0
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	1.968	USD	267.884	0
HORMEL FOODS CORPORATION	2.019	USD	68.989	0
HOST HOTELS & RESORTS INC	(7.834)	USD	(146.182)	0
HP INC	56.593	USD	1.080.926	0
HSBC HOLDINGS PLC	(36.241)	GBP	(274.344)	0
HUBBELL INC	(7.127)	USD	(846.616)	0
HUGO BOSS	8.970	EUR	571.658	0
HUMANA INC.	13.565	USD	3.136.228	0
HUNT J.B..TRANSP.SERV.	(7.678)	USD	(696.471)	0
HUNTINGTON BANCSHARES INC	(75.465)	USD	(999.911)	0
IBM	3.432	USD	496.507	0
IDEXX LABORATORIES INC.	(11)	USD	(1.831)	0
II-VI INC	(3.252)	USD	(123.901)	0
ILG INC	(21.690)	USD	(575.002)	0
ILIAD	(703)	EUR	(147.384)	0
ILLINOIS TOOL WORKS	4.404	USD	619.687	0
ILLUMINA INC	9.271	USD	1.611.763	0
IMPERIAL BRANDS	23.922	GBP	746.366	0
INCYTE CORPORATION	1.299	USD	173.144	0
INGERSOLL-RAND PLC SHS	(1.562)	USD	(137.269)	0
INGREDION INC SHS	217	USD	26.760	0
INTEGRATED DEVICE TECHN.INC	3.479	USD	90.941	0
INTEL CORP.	52.207	USD	1.851.782	0
INTERACTIVE BROKER GROUP INC	(10.008)	USD	(400.820)	0
INTERCONT EXCH	2.385	USD	159.103	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
INTERNATIONAL PAPER CO	(16.038)	USD	(881.769)	0
INTERPUBLIC GROUP	(13.253)	USD	(286.397)	0
INTL FLAVORS FRAG	(7.940)	USD	(1.057.449)	0
INTU PROPERTIES PLC	(11.649)	GBP	(29.740)	0
INTUIT	15.636	USD	2.145.416	0
INTUITIVE SURGICAL INC	105	USD	98.517	0
INVESCO LTD	(13.048)	USD	(453.679)	0
IPG PHOTONICS CORP	773	USD	117.991	0
IROBOT CORP	(1.281)	USD	(135.158)	0
IRON MOUNTAIN REIT INC /REIT	(7.913)	USD	(288.271)	0
ITT INC	(4.874)	USD	(199.834)	0
J&J SNACK FOODS CORP	1.209	USD	158.863	0
J.SAINSBURY PLC	(90.955)	GBP	(222.658)	0
J2 GLOBAL INC	(1.568)	USD	(132.700)	0
JABIL INC	(18.538)	USD	(565.409)	0
JACOBS ENGINEER.GROUP	(20.813)	USD	(1.097.261)	0
JETBLUE AIRWAYS CORP	(11.486)	USD	(251.888)	0
JM SMUCKER CO	(4.356)	USD	(530.996)	0
JOHN BEAN TECHNOLOGIES CORP	(8.616)	USD	(796.118)	0
JOHNSON & JOHNSON	(1.304)	USD	(173.067)	0
JOHNSON CTLS INTL PLC NPV	(31.634)	USD	(1.232.144)	0
JPMORGAN CHASE & CO	(4.452)	USD	(408.694)	0
JUNIPER NETWORKS INC.	4.490	USD	125.496	0
KANSAS CITY SOUTHERN	(3.834)	USD	(395.630)	0
KAPSTONE PAPER &PACKAGING CORP	(16.592)	USD	(379.293)	0
KBR INC	(8.709)	USD	(129.938)	0
KELLOGG CO	(621)	USD	(42.228)	0
KEMPER	(7.987)	USD	(313.490)	0
KENNAMETAL INC.	(2.227)	USD	(82.176)	0
KERING ACT.	1.909	EUR	564.110	0
KEYCORP	(89.742)	USD	(1.618.946)	0
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9.509	USD	395.479	0
KILROY REALTY CORPORATION	8.012	USD	556.113	0
KIMBERLY CLARK CORP	21.928	USD	2.700.652	0
KIMCO REALTY CORP.	(4.335)	USD	(87.480)	0
KINDER MORGAN INC	(69.610)	USD	(1.422.132)	0
KIRBY CORP.	1.328	USD	80.875	0
KLA TENCOR CORPORATION	14.816	USD	1.372.406	0
KLX INC	2.060	USD	106.955	0
KOHL S CORP.	(23.912)	USD	(988.761)	0
KONINKLIJKE DSM NV	4.419	EUR	275.657	0
KONINKLIJKE KPN /EUR 0.04	(51.040)	EUR	(156.387)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
KROGER CO.	4.407	USD	108.060	0
L BRANDS INC	2.848	USD	132.119	0
L3 TECHNOLOGIES INC	1.021	USD	178.644	0
LABORATORY CORP OF AMER.HLD	(11)	USD	(1.748)	0
LADBROKES PLC	(228.257)	GBP	(288.745)	0
LAM RESEARCH CORP	12.542	USD	1.999.947	0
LANCASTER COLONY CORP.	5.891	USD	722.354	0
LAND SEC GROUP PLC REIT/CAP	(2.996)	GBP	(30.589)	0
LANDSTAR SYSTEMS INC.	(6.561)	USD	(545.547)	0
LANXESS AG	4.244	EUR	276.794	0
LAS VEGAS SANDS CORP	7.744	USD	477.108	0
LCI INDUSTRIES INC	(1.032)	USD	(110.166)	0
LEAR CORP	(3.776)	USD	(559.565)	0
LEGACYTEXAS FIN GRP	(6.996)	USD	(270.885)	0
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	(24.697)	GBP	(66.287)	0
LEGGETT + PLATT INC.	3.743	USD	180.338	0
LEIDOS HOLDINGS INC	(17.717)	USD	(946.796)	0
LENNAR CORP. -A-	3.986	USD	209.026	0
LENNOX INTERNATIONAL INC.	5.852	USD	1.000.692	0
LEUCADIA NATIONAL CORP.	(46.425)	USD	(1.208.443)	0
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	(74.243)	USD	(4.356.579)	0
LEXINGTON REALTY TRUST	57.234	USD	582.642	0
LIFE STORAGE INC /REIT	(7.395)	USD	(540.131)	0
LIFEPOINT HEALTH INC	10.120	USD	601.128	0
LILLY (ELI) & CO	(15.060)	USD	(1.244.860)	0
LINCOLN NATIONAL CORP.	1.355	USD	98.996	0
LINDE A.G.	1.671	EUR	270.368	0
LITTELFUSE INC	(4.696)	USD	(846.125)	0
LKQ	(28.810)	USD	(995.674)	0
LLOYDS BANKING GROUP PLC	(387.124)	GBP	(253.876)	0
LOCKHEED MARTIN CORP	20.411	USD	5.962.665	0
LOEWS CORP	(27.002)	USD	(1.314.457)	0
LOWE S COMPANIES INC.	8.502	USD	658.055	0
LUMENTUM HOLDINGS INC	(5.037)	USD	(315.316)	0
LVMH ACT.	2.603	EUR	553.658	0
LYONDELLBASELL IND NV -A-	(2.597)	USD	(233.964)	0
M&T BANK CORPORATION	(4.873)	USD	(795.030)	0
MACERICH	1.127	USD	64.679	0
MACK-CALI REALTY CORP.	(15.301)	USD	(401.498)	0
MACY S	(3.124)	USD	(74.195)	0
MAGNA INTERNATIONAL INC	(11.790)	USD	(562.265)	0
MALLINCKRODT PLC	(50.596)	USD	(2.317.297)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
MANPOWERGROUP INC	5.051	USD	541.215	0
MARATHON OIL CORP.	(95.708)	USD	(1.170.509)	0
MARATHON PETROLEUM CORP	(19.530)	USD	(1.093.485)	0
MARRIOTT INTL INC. A	10.273	USD	1.070.344	0
MARSH & MC-LENNAN COS INC	24.813	USD	1.934.670	0
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC.	(1.541)	USD	(348.929)	0
MASCO CORP.	2.127	USD	81.103	0
MASIMO CORPORATION	1.448	USD	136.981	0
MASTERCARD INC. SHS-A-	2.325	USD	297.135	0
MATTEL INC.	(11.280)	USD	(225.826)	0
MATTHEWS INTL CORP. A	(9.133)	USD	(598.668)	0
MAXIMUS	(2.088)	USD	(126.032)	0
MC-CORMICK&CO/N.VOTING	1.637	USD	156.006	0
MCDONALD S CORP.	2.456	USD	381.024	0
MCKESSON CORP	7.296	USD	1.181.004	0
MEDIDATA SOLUTIONS	(5.197)	USD	(399.182)	0
MEDTRONIC HOLDINGS LIMITED	898	USD	75.405	0
MERCK	(20.358)	USD	(1.300.469)	0
METLIFE INC	(12.106)	USD	(665.830)	0
METTLER TOLEDO INTL INC.	3.026	USD	1.734.140	0
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14.832	USD	488.418	0
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	(4.601)	USD	(167.660)	0
MICHELIN B /NOM.	340	EUR	38.879	0
MICROCHIP TECHNOLOGY INC.	14.638	USD	1.171.626	0
MICRON TECHNOLOGY INC	21.046	USD	591.814	0
MICROSEMI	8.511	USD	443.253	0
MICROSOFT CORP	33.634	USD	2.445.192	0
MID-AMERICA APARTMENT COMMUN.	(7.989)	USD	(827.101)	0
MINERALS TECHNOLOGIES INC.	(1.550)	USD	(109.740)	0
MOHAWK INDUSTRIES	345	USD	85.902	0
MOLSON COORS BREW-B-NON-VOT	5.068	USD	450.951	0
MONDELEZ INTERNATIONAL INC WI	16.477	USD	725.318	0
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	(3.746)	USD	(383.291)	0
MONSANTO CO	2.364	USD	276.162	0
MONSTER BEVERAGE CORP	15.130	USD	798.108	0
MOODY S CORP	4.883	USD	642.749	0
MORGAN STANLEY	(12.752)	USD	(598.069)	0
MOSAIC CO	(89.877)	USD	(2.169.631)	0
MOTOROLA SOLTN/EX-DISTR	14.098	USD	1.278.407	0
MSC INDUSTRIAL DIRECT CO -A-	5.775	USD	411.238	0
MUELLER INDUSTRIES INC.	(8.779)	USD	(276.539)	0
MURPHY OIL CORP.	(3.990)	USD	(106.054)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
MYLAN N.V.	(50.223)	USD	(1.958.195)	0
NABORS INDUSTRIES LTD	4.418	USD	34.063	0
NASDAQ INC	(15.313)	USD	(1.138.828)	0
NATIONAL INSTRUMENTS CORP	18.466	USD	759.691	0
NATIONAL OILWELL VARCO INC	(546)	USD	(17.860)	0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	(10.478)	USD	(418.910)	0
NAVIENT CORP	(68.198)	USD	(1.005.921)	0
NEOGEN CORP.	(7.184)	USD	(473.210)	0
NETAPP INC	10.431	USD	452.914	0
NETFLIX INC	(2.695)	USD	(489.574)	0
NETSCOUT SYSTEMS INC.	17.506	USD	603.957	0
NEW JERSEY RESOURCES CORP.	18.169	USD	765.823	0
NEW STERIS LIMITED	(11.459)	USD	(937.919)	0
NEW YORK COMM.BANCORP	(20.770)	USD	(272.710)	0
NEW YORK TIMES A	(65.911)	USD	(1.252.309)	0
NEWELL BRANDS INC	(16.358)	USD	(862.394)	0
NEWFIELD EXPLORATION CO	(21.665)	USD	(622.435)	0
NEWMARKET CORP	387	USD	178.063	0
NEWMONT MINING CORP.	1.347	USD	50.068	0
NEWS CORPORATION /-A- WHEN ISS	(120.921)	USD	(1.730.380)	0
NEXTERA ENERGY	7.780	USD	1.136.580	0
NIELSEN HOLDINGS PLC	(7.749)	USD	(333.284)	0
NIKE INC B	(509)	USD	(30.056)	0
NISOURCE INC	(14.114)	USD	(367.811)	0
NOBLE ENERGY	(25.404)	USD	(734.430)	0
NORDSTROM INC	(6.178)	USD	(300.065)	0
NORFOLK SOUTHERN CORP.	(1.959)	USD	(220.544)	0
NORTHERN TRUST CORP	(180)	USD	(15.752)	0
NORTHROP GRUMMAN CORP	23.008	USD	6.054.095	0
NORTHWESTERN CORP.	(12.791)	USD	(739.192)	0
NORWEGIAN CRUISE LINE SHS	19.456	USD	1.071.442	0
NRG ENERGY INC	16.110	USD	396.628	0
NUCOR CORP.	818	USD	47.174	0
NVIDIA CORP.	8.156	USD	1.325.432	0
NVR INC	149	USD	388.956	0
O REILLY AUTOMOTIVE INC	108	USD	22.064	0
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	(12.077)	USD	(747.929)	0
OCEANEERING INTL INC.	(13.440)	USD	(344.736)	0
OGE ENERGY CORP	(5.197)	USD	(186.364)	0
OLD MUTUAL PLC	(32.774)	GBP	(64.401)	0
OLD NATIONAL BANCORP (IND)	(34.932)	USD	(569.392)	0
OMNICOM GROUP INC.	10.696	USD	842.203	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ONEOK INC (NEW)	(10.647)	USD	(602.301)	0
ORACLE CORP	47.681	USD	2.380.712	0
ORANGE	(10.396)	EUR	(147.831)	0
OWENS-ILLINOIS INC.	(5.483)	USD	(131.044)	0
PACCAR INC.	(13.653)	USD	(934.548)	0
PACKAGING CORP OF AMERICA	(2.560)	USD	(280.269)	0
PALO ALTO NETWORKS INC	1.112	USD	146.539	0
PAREXEL INTERNATIONAL CORP	19.200	USD	1.680.384	0
PARKER-HANNIFIN	(2.639)	USD	(438.021)	0
PATTERSON COMPANIES INC	(2.214)	USD	(92.368)	0
PAYCHEX INC.	14.862	USD	859.767	0
PAYPAL HOLDINGS INC	11.561	USD	676.897	0
PDC ENERGY	(5.455)	USD	(257.258)	0
PENTAIR PLC	4.529	USD	285.644	0
PEOPLE S UNITED FINANCIAL INC	(69.876)	USD	(1.218.637)	0
PEPSICO INC	10.206	USD	1.190.122	0
PERKINELMER INC	25.180	USD	1.657.599	0
PERRIGO COMPANY PLC	(19.377)	USD	(1.451.725)	0
PERSIMMON PLC	9.949	GBP	249.123	0
PEUGEOT SA	2.180	EUR	39.643	0
PFIZER INC.	(32.114)	USD	(1.064.900)	0
PG&E CORP	(4.964)	USD	(336.013)	0
PHILIP MORRIS INT.	67.422	USD	7.868.822	0
PHILLIPS 66	(15.443)	USD	(1.293.351)	0
PHILLIPS-VAN HEUSEN CORP	(5.970)	USD	(712.161)	0
PINNACLE WEST CAP.CORP.	(14.248)	USD	(1.235.729)	0
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	(3.950)	USD	(644.245)	0
PITNEY BOWES INC	7.319	USD	115.201	0
PNC FINANCIAL SERVICES GP	(5.340)	USD	(687.792)	0
PNM RESOURCES INC	4.700	USD	187.295	0
POLO RALPH LAUREN	(527)	USD	(39.868)	0
POLYONE CORP / WHEN ISSUED	(2.792)	USD	(102.131)	0
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING/PREF	786	EUR	38.031	0
PPG INDUSTRIES INC.	(12.458)	USD	(1.311.205)	0
PPL CORP	29.875	USD	1.145.109	0
PRAXAIR	(6.889)	USD	(896.672)	0
PRESTIGE BRANDS HOLDINGS INC	(10.724)	USD	(575.128)	0
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	(9.545)	USD	(637.129)	0
PROCTER & GAMBLE CO.	21.526	USD	1.954.991	0
PROGRESSIVE CORP	31.640	USD	1.491.193	0
PROLOGIS INC	1.601	USD	97.357	0
PROSPERITY BANCSHARES INC	(6.144)	USD	(393.830)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
PROXIMUS SA	(4.844)	EUR	(143.843)	0
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	(4.094)	USD	(463.564)	0
PRUDENTIAL PLC	(3.609)	GBP	(66.694)	0
PS BUSINESS PARKS INC.	(4.575)	USD	(615.155)	0
PUBL.SERV.ENTERPRISE	(19.042)	USD	(856.319)	0
PUBLIC STORAGE	62	USD	12.745	0
PULTEGROUP INC	(25.592)	USD	(624.957)	0
QIAGEN NV	48.374	USD	1.588.602	0
QORVO INC	(1.943)	USD	(133.212)	0
QUALCOMM INC.	24.949	USD	1.327.037	0
QUANTA SERVICES INC	(31.162)	USD	(1.051.094)	0
QUEST DIAGNOSTICS INC.	2.789	USD	302.077	0
RANGE RESOURCES	(24.064)	USD	(507.991)	0
RAYMOND JAMES FIN.INC	6.534	USD	543.563	0
RAYTHEON COMPANY	34.959	USD	6.004.907	0
REALTY INCOME CORP	(3.667)	USD	(209.239)	0
RED HAT INC	17.188	USD	1.699.378	0
REGENCY CENTERS CORP.	(516)	USD	(34.170)	0
REGENERON PHARMA. INC.	(893)	USD	(439.017)	0
REGIONS FINANCIAL CORP	(57.902)	USD	(845.369)	0
RENAULT SA	492	EUR	37.471	0
REPUBLIC SERVICES INC.	14.304	USD	918.603	0
RIO TINTO PLC /REG.	(23)	GBP	(810)	0
ROBERT HALF INTL INC.	(3.299)	USD	(149.280)	0
ROCKWELL AUTOMATION	(6.142)	USD	(1.013.614)	0
ROCKWELL COLLINS INC	5.507	USD	586.661	0
ROGERS CORP	(996)	USD	(117.498)	0
ROLLINS INC	(15.281)	USD	(663.348)	0
ROPER TECHNOLOGIES INC	827	USD	192.244	0
ROSS STORES INC	3.021	USD	167.122	0
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	(103.772)	GBP	(257.977)	0
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11.112	USD	1.256.434	0
ROYAL GOLD INC	4.319	USD	374.285	0
RPM INTERNATIONAL INC	2.648	USD	137.352	0
RSA INSURANCE GROUP PLC	(10.162)	GBP	(66.307)	0
RYDER SYSTEM INC.	(2.107)	USD	(153.305)	0
S&P GLOBAL SHS	2.116	USD	324.996	0
SALESFORCE COM INC	19.506	USD	1.771.145	0
SALZGITTER AG	(2.373)	EUR	(89.972)	0
SANMINA	3.762	USD	134.868	0
SBA COMMUNICATIONS CORP/REIT	(24.430)	USD	(3.360.347)	0
SCANA CORPORATION	(22.585)	USD	(1.453.796)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SCHAEFFLER AG /PFD	3.102	EUR	36.573	0
SCHLUMBERGER LTD	(8.310)	USD	(570.066)	0
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE I	(75)	USD	(6.556)	0
SEAGATE TECHNOLOGIE PLC	10.088	USD	332.500	0
SEALED AIR CORP (NEW)	(797)	USD	(34.677)	0
SEGRO PLC /REIT	(6.207)	GBP	(32.711)	0
SELECTIVE INSURANCE GROUP	(11.753)	USD	(595.289)	0
SEMPRA ENERGY	(6.931)	USD	(783.272)	0
SENSATA TEC	(23.786)	USD	(1.073.224)	0
SHERWIN-WILLIAMS CO	(2.208)	USD	(744.692)	0
SHIRE PLC	(2.043)	GBP	(87.052)	0
SIGNET JEWELERS LTD	(2.198)	USD	(134.430)	0
SILICON LABORATORIES INC	(1.853)	USD	(139.160)	0
SIMON PROPERTY/PAIRED SHS	(527)	USD	(83.530)	0
SIMPSON MANUFACTURING INC.	(15.223)	USD	(674.227)	0
SKYWORKS SOLUTIONS INC *OPA*	15.221	USD	1.596.226	0
SL GREEN REALTY CORPORATION	(1.117)	USD	(115.353)	0
SM ENERGY CO	(7.237)	USD	(125.851)	0
SMITH CORP..A.O.	(15.013)	USD	(803.946)	0
SNAP-ON INC	1.307	USD	201.539	0
SOLVAY SA	2.337	EUR	283.478	0
SONOCO PRODUCTS CO	(22.584)	USD	(1.094.872)	0
SOTHEBYS	(7.306)	USD	(413.447)	0
SOUTH JERSEY INDUSTRIES INC	(4.499)	USD	(152.831)	0
SOUTHERN CO.	(11.571)	USD	(554.598)	0
SOUTHWEST AIRLINES CO	7.913	USD	439.251	0
SOUTHWESTERN ENERGY CO	(21.070)	USD	(120.099)	0
SPROUTS FARMERS MARKET INC	(17.826)	USD	(429.072)	0
ST JAMES PLACE PLC	(5.397)	GBP	(65.681)	0
STAMPS COM INC	(951)	USD	(140.843)	0
STANDARD CHARTERED PLC	(32.963)	GBP	(279.098)	0
STANDARD LIFE ORD GBP0.1222222	(15.792)	GBP	(68.916)	0
STANLEY BLACK & DECKER INC	3.754	USD	528.150	0
STAPLES INC	(6.774)	USD	(68.756)	0
STARBUCKS CORP.	4.393	USD	237.134	0
STATE STREET CORP	(4.127)	USD	(384.760)	0
STERICYCLE INC	(10.280)	USD	(792.382)	0
STERLING BANC --- SHS	(25.567)	USD	(590.598)	0
STRYKER CORP.	1.473	USD	216.678	0
SUNTRUST BANKS INC.	(12.353)	USD	(707.703)	0
SVB FINANCIAL GROUP	527	USD	94.038	0
SYMANTEC CORP.	42.240	USD	1.309.018	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SYMRISE AG	4.606	EUR	272.813	0
SYNCHRONY FINANCIAL	(20.186)	USD	(612.040)	0
SYNNEX CORP	(5.572)	USD	(662.622)	0
SYNOPSYS INC.	4.291	USD	328.562	0
SYSCO CORP.	2.963	USD	155.913	0
T ROWE PRICE GROUP INC.	981	USD	81.148	0
TANGER FACTORY OUT. CENTERS	18.187	USD	480.682	0
TARGET CORP	12.772	USD	723.789	0
TAYLOR WIMPEY PLC	128.587	GBP	244.830	0
TCF FINANCIAL CORP	(32.956)	USD	(519.387)	0
TE CONNECTIVITY /REG SHS	8.040	USD	646.336	0
TECH DATA CORP	3.383	USD	346.419	0
TECHNIPFMC PLC	(6.198)	USD	(176.891)	0
TEGNA INC	(61.076)	USD	(905.757)	0
TELECOM ITALIA SPA	(180.594)	EUR	(157.207)	0
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1.558	USD	212.418	0
TELEFONICA SA	(15.821)	EUR	(151.249)	0
TELENET GROUP HOLDING	(2.635)	EUR	(155.439)	0
TELEPHONE AND DATA	(16.958)	USD	(482.116)	0
TERADATA	8.026	USD	255.387	0
TEREX CORP.	(2.320)	USD	(91.338)	0
TESCO PLC	(131.587)	GBP	(229.225)	0
TESORO CORP.	(15.647)	USD	(1.557.346)	0
TETRA TECH INC.	(10.160)	USD	(482.092)	0
TEXAS INSTRUMENTS INC	30.144	USD	2.453.119	0
THE GEO GROUP REIT INC	8.600	USD	252.410	0
THE HERSHEY CO	7.757	USD	816.890	0
THE KRAFT HEINZ COMPANY	9	USD	787	0
THE PRICELINE GROUP INC SHS	5	USD	10.143	0
THE SCOTTS MIRACLE-GRO CO A	6.671	USD	640.349	0
THE ULTIMATE SOFTWARE GROUP	(2.630)	USD	(593.617)	0
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9.684	USD	1.699.833	0
THOR INDUSTRIES INC.	(5.290)	USD	(557.302)	0
THYSSENKRUPP AG DUESSELDORF	(3.413)	EUR	(85.615)	0
TIFFANY & CO	(6.331)	USD	(604.674)	0
TIME WARNER	17.641	USD	1.806.791	0
TIMKEN CO	(10.776)	USD	(490.308)	0
TIVO CORP	4.862	USD	95.295	0
TJX COMPANIES INC	504	USD	35.436	0
TOLL BROTHERS	7.571	USD	292.165	0
TORCHMARK CORP.	(8.635)	USD	(681.906)	0
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	(14.964)	USD	(949.615)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
TRACTOR SUPPLY CO	(1.791)	USD	(100.511)	0
TRANSDIGM GROUP INC	(223)	USD	(62.917)	0
TRANSOCEAN LTD	(124.505)	USD	(1.076.968)	0
TRAVELERS COMPANIES INC *OPR*	8.184	USD	1.048.289	0
TRI POINTE GROUP SHS	16.935	USD	225.236	0
TRINITY IND.INC	3.800	USD	104.158	0
TRIPADVISOR INC	(8.947)	USD	(349.112)	0
TRUSTMARK CORP	(4.299)	USD	(137.396)	0
TYLER TECHNOLOGIES INC	(3.162)	USD	(543.263)	0
TYSON FOODS INC.-A-	11.548	USD	731.681	0
UDR INC /REIT	2.187	USD	85.490	0
ULTA BEAUTY INC	1.002	USD	251.712	0
UMICORE SA	4.506	EUR	305.867	0
UNDER ARMOUR INC /-A-	(3.403)	USD	(68.128)	0
UNION PACIFIC CORP.	(6.802)	USD	(700.334)	0
UNITED BANKSHARES INC	(17.662)	USD	(609.339)	0
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	(7.933)	USD	(536.905)	0
UNITED RENTALS INC.	2.341	USD	278.485	0
UNITED TECHNOLOGIES CORP	974	USD	115.487	0
UNITEDHEALTH GROUP INC	16.663	USD	3.196.130	0
UNIV.HEALTH SERV.INC B	76	USD	8.423	0
UNIVERSAL FOREST PRODUCTS INC	(3.467)	USD	(290.708)	0
UNUM GROUP	(10.254)	USD	(514.033)	0
URBAN EDGE PROPERTIES /REIT	13.974	USD	351.167	0
URBAN OUTFITTERS INC.	(5.817)	USD	(113.955)	0
US BANCORP	6.029	USD	318.211	0
UTD PARCEL SERVICE INC B	(4.688)	USD	(517.040)	0
UTD THERAPEUTICS CORP (DE)	5.727	USD	735.347	0
VALEO SA	653	EUR	38.227	0
VALERO ENER. CORP	425	USD	29.312	0
VALLEY NATIONAL BANCORP	(49.247)	USD	(585.054)	0
VALMONT IND.INC	2.628	USD	401.296	0
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	379	USD	36.808	0
VCA INC	3.347	USD	309.865	0
VENTAS INC.	49	USD	3.300	0
VERISIGN INC	3.968	USD	401.443	0
VERISK ANLYTCS	(2.304)	USD	(201.047)	0
VERIZON COMMUNICATIONS INC	(76.632)	USD	(3.708.989)	0
VERTEX PHARMACEUTICALS	(2.102)	USD	(319.126)	0
VF CORP	(1.206)	USD	(75.001)	0
VIACOM INC -B-	(8.039)	USD	(280.722)	0
VIASAT INC. CARLSBAD. CALIF.	(1.848)	USD	(122.134)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
VISA INC -A	(8.621)	USD	(858.307)	0
VOESTALPINE AG	(2.087)	EUR	(89.449)	0
VOLKSWAGEN AG /VORZUG.	293	EUR	38.119	0
VULCAN MATERL CO HOLD.CO*OPE*	(5.470)	USD	(673.466)	0
WABTEC CORP	(8.835)	USD	(665.806)	0
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	11.916	USD	961.264	0
WAL-MART STORES INC	8.013	USD	640.960	0
WALT DISNEY	5.347	USD	587.796	0
WASTE MANAGEMENT INC	28.339	USD	2.129.676	0
WATERS CORPORATION	13.329	USD	2.311.782	0
WATTS WATER TECHNOLOGIES INC	(13.412)	USD	(863.733)	0
WEC ENERGY GROUP INC	2.713	USD	170.838	0
WELLCARE HEALTH PLANS INC	9.942	USD	1.759.635	0
WELLS FARGO & CO	(12.314)	USD	(664.217)	0
WELLTOWER INC /REIT	(1.608)	USD	(118.011)	0
WESTAR ENERGY INC	(17.701)	USD	(898.326)	0
WESTERN DIGITAL CORP.	(723)	USD	(61.542)	0
WESTERN UNION COMPANY	22.474	USD	443.862	0
WESTROCK CO	(18.666)	USD	(1.071.802)	0
WEX	(7.045)	USD	(765.651)	0
WEYERHAEUSER CO	(11.181)	USD	(369.197)	0
WHIRLPOOL CORP.	3.524	USD	626.849	0
WHOLE FOODS MARKET INC.	(2.658)	USD	(110.998)	0
WILLIAM HILL PLC	(104.302)	GBP	(261.277)	0
WILLIAMS COMPANIES INC	11.455	USD	364.040	0
WILLIAMS-SONOMA INC	9.592	USD	445.357	0
WILLIS TOWERS WATS NPV	1.044	USD	155.431	0
WINTRUST FINANCIAL CORP	(1.810)	USD	(136.311)	0
WM MORRISON SUPERMARKETS PLC	(94.342)	GBP	(226.798)	0
WPX ENERGY INC	(5.236)	USD	(56.444)	0
WR BERKLEY CORP.	3.292	USD	227.049	0
WW GRAINGER INC	2.949	USD	491.716	0
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	12.599	USD	1.314.958	0
WYNN RESORTS LTD	3.109	USD	402.118	0
XCEL ENERGY INC	(21.344)	USD	(1.009.785)	0
XEROX CORP	(1.292)	USD	(39.626)	0
XILINX INC.	23.194	USD	1.467.252	0
XL GROUP LTD	2.556	USD	113.486	0
XYLEM INC	(20.629)	USD	(1.170.283)	0
YUM BRANDS SHS	4.514	USD	340.717	0
ZEBRA TECHNOLOGIES A	3.799	USD	386.434	0
ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	(2.504)	USD	(303.785)	0
ZIONS BANCORP	(22.462)	USD	(1.017.978)	0
ZOETIS INC -A-	(16.432)	USD	(1.027.329)	0
Gesamt				**0**

Zum 31. Juli 2017 beträgt der nicht realisierte Nettobetrag aus CFD USD 0.
Kontrahent der CFD war Goldman Sachs International.

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Zum 31. Juli 2017 bestehen folgende CFD in Bezug auf den Teilfonds DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity:

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR
ACCOR SA	(953)	EUR	(37.415)	0
ADIDAS AG	400	EUR	77.200	0
AIXTRON /NAMEN AKT.	(1.000)	EUR	(7.514)	0
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	(500)	EUR	(50.900)	0
ARCELORMITTAL SA	1.567	EUR	34.780	0
ARYZTA AG /NAM.	300	CHF	9.324	0
ASML HOLDING NV	(300)	EUR	(38.445)	0
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	(1.700)	GBP	(50.388)	0
ASTRAZENECA PLC	(600)	GBP	(27.414)	0
ATLANTIA SPA	(2.500)	EUR	(64.225)	0
ATOS ACT.	500	EUR	64.225	0
AXEL SPRINGER SE N NAMEN-AKT.V	(1.300)	EUR	(69.862)	0
BARCLAYS PLC	26.385	GBP	53.562	0
BAYER AG	500	EUR	53.575	0
BCO BILBAO VIZ.ARGENTARIA/NAM.	(4.285)	EUR	(32.785)	0
BEIERSDORF A.G.	(780)	EUR	(72.306)	0
BELLWAY PLC	1.600	GBP	51.040	0
BNP PARIBAS	(700)	EUR	(45.899)	0
BT GROUP PLC	(14.500)	GBP	(45.458)	0
BURBERRY GROUP PLC	4.200	GBP	71.862	0
BUREAU VERITAS	(4.000)	EUR	(76.980)	0
CARGOTEC -B-	1.200	EUR	61.920	0
CARREFOUR S.A.	(2.711)	EUR	(55.047)	0
CREDIT AGRICOLE SA. PARIS	5.400	EUR	80.190	0
DANONE	(300)	EUR	(18.927)	0
DEUTSCHE TELEKOM /NAM.	5.047	EUR	77.951	0
DIALOG SEMICONDUCTOR	900	EUR	33.215	0
ENEL	12.800	EUR	61.747	0
ERICSSON TEL. B	(6.200)	SEK	(325.190)	0
ESSILOR INTERNATIONAL	(450)	EUR	(48.195)	0
ESSITY AKTIE- B	2.800	SEK	655.480	0
FORTUM CORPORATION	(4.000)	EUR	(55.280)	0
FREENET AG NAMENS-AKTIEN	2.300	EUR	65.619	0
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	(900)	EUR	(71.811)	0
FRESENIUS SE & CO KGAA	1.000	EUR	71.430	0
G4S PLC	(15.000)	GBP	(49.320)	0
GLAXOSMITHKLINE	(3.300)	GBP	(49.979)	0
GN GREAT NORDIC LTD	(1.000)	DKK	(191.200)	0
HENKEL / VORZUG	500	EUR	59.875	0
HENNES & MAURITZ AB	(2.900)	SEK	(610.450)	0
HUGO BOSS	(300)	EUR	(19.119)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) EUR
IBERDROLA SA	8.298	EUR	55.298	0
ICA GRUPPEN AB	800	SEK	258.880	0
ILIAD	300	EUR	62.895	0
IMPERIAL BRANDS	1.700	GBP	53.040	0
INDITEX	2.400	EUR	80.616	0
INTRUM JUSTITIA AB	1.050	SEK	275.940	0
J.SAINSBURY PLC	7.900	GBP	19.339	0
JERONIMO MARTINS SGPS SA	(3.200)	EUR	(53.200)	0
KERRY GROUP A	700	EUR	53.445	0
KINGFISHER PLC	(16.600)	GBP	(48.870)	0
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	1.665	EUR	28.796	0
KONINKLIJKE VOPAK	(1.800)	EUR	(72.477)	0
LUXOTTICA GROUP	(1.200)	EUR	(58.644)	0
MARINE HARVEST ASA	2.500	NOK	366.250	0
MONCLER S.P.A.	2.600	EUR	59.020	0
NATIONAL GRID PLC	(6.650)	GBP	(62.297)	0
NOVARTIS AG BASEL/NAM.	700	CHF	57.680	0
ORANGE	(5.000)	EUR	(71.100)	0
PADDY POWER PLC	(500)	GBP	(37.850)	(3)
PANDORA A/S	600	DKK	433.800	0
PEARSON PLC	(1.700)	GBP	(11.178)	0
PERNOD-RICARD	460	EUR	53.935	0
PLAYTECH LIMITED	5.100	GBP	48.986	0
RECORDATI IND CHIMICA/POST RAG	2.400	EUR	86.640	0
RED ELECTRICA CORPORACION. SA	2.200	EUR	39.864	0
RIGHTMOVE PLC	1.500	GBP	63.120	0
ROLLS ROYCE HLD	3.700	GBP	32.856	0
RWE	(400)	EUR	(7.126)	0
SAFRAN SA	1.000	EUR	79.930	0
SANOFI	700	EUR	56.504	0
SONOVA HOLDING AG /NOM.	200	CHF	31.380	0
STMICROELECTRONICS NV	(1.200)	EUR	(17.316)	0
SVENSKA CELLUL.-B-	2.300	SEK	153.755	0
SWEDISH MATCH AB	(700)	SEK	(198.800)	0
TELEPERFORM.SE	700	EUR	82.355	0
TELIASONERA AB	(17.000)	EUR	(67.626)	20
TESCO PLC	(11.500)	GBP	(20.033)	0
TUI AG - NAM.AKT	2.200	EUR	29.326	0
UNILEVER PLC	(1.670)	GBP	(72.169)	0
UNITED INTERN.&CO/NAMENSAKT	1.400	EUR	72.086	0
VIFOR PHARMA AG	(400)	CHF	(41.320)	0
WARTSILA CORPORATION -B-	(1.000)	EUR	(56.150)	0
WIRECARD AG/APRES RED.CAP	1.000	EUR	64.690	0
Gesamt				**17**

Zum 31. Juli 2017 beträgt der nicht realisierte Nettogewinn aus CFD EUR 17.
Kontrahenten der CFD waren die Deutsche Bank AG und die Credit Suisse AG.

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Zum 31. Juli 2017 bestehen folgende CFD in Bezug auf den Teilfonds DB Platinum IV Basso:

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
3SBIO INC 0% 17-21.07.22 /CV 21/07/2022	1.000	EUR	102.306	2.719
51 JOBS INC /SADR 31/12/2099	(6.038)	USD	(297.432)	(8.481)
51JOB INC 3.25% 15-15.04.19 CV 15/04/201	4.600	USD	576.536	19.518
ACERGY SA 31/12/2099	(7.391)	USD	(108.881)	250
ACORDA THER 1.75%14-15.6.21/CV 15/06/202	3.570	USD	317.587	8.395
ACORDA THERAPEUTICS INC 31/12/2099	(4.194)	USD	(90.800)	(5.662)
ACS ACTIVID2.625% 22.10.18 /CV 22/10/201	17.000	EUR	2.105.518	(74.673)
AEGEAN MARINE PETROL NETWORK 31/12/2099	(56.308)	USD	(278.725)	39.037
AEGEAN4.25% 16-15.12.21 /CV 15/12/2021	8.100	USD	612.773	(18.142)
AEON FIN 0% 16-13.09.19 /CV 13/09/2019	330.000	JPY	35.904.660	1.222
AEON FINANCIAL SHS 31/12/2099	(5.900)	JPY	(14.165.900)	(2.672)
ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR 31/12/209	(6.027)	USD	(933.884)	(22.420)
ALSTRIA 2.75% 13-14.06.18 /CV 14/06/2018	14.000	EUR	1.937.796	131.263
ALSTRIA OFFICE REIT AG 31/12/2099	(135.024)	EUR	(1.673.622)	(98.318)
ALTABA INC 31/12/2099	(17.839)	USD	(1.041.798)	(13.595)
AMAG PHARMA 3.25% 1.06.22 /CV 31/12/2099	8.880	USD	891.889	(2.150)
AMAG PHARMACEUTICALS INC 31/12/2099	(19.499)	USD	(383.155)	3.182
AMER MOVIL 0% 15-28.05.20 /CV 28/05/2020	8.000	EUR	794.096	8.545
AMICUS THER 3% 16-15.12.23 /CV 15/12/202	2.750	USD	615.326	4.377
AMICUS THERAPEUTICS INC 31/12/2099	(41.559)	USD	(538.189)	(1.507)
ANGLO AMERICAN PLC 31/12/2099	(116.960)	GBP	(1.464.924)	(344.226)
APOLLO COM 5.5% 14-15.03.19/CV 15/03/201	6.670	USD	730.999	(4.929)
APOLLO COMMERCIAL RE FIN INC 31/12/2099	(18.883)	USD	(340.460)	3.965
ARES CAP 3.75%17-1.2.22/CV 144A 01/02/20	7.530	USD	763.241	(9.447)
ARES CAP 4.75% 13-15.01.18 15/01/2018	2.770	USD	281.202	792
ARES CAPITAL CORPORATION 31/12/2099	(15.477)	USD	(253.668)	1.548
ASIA VIEW L 1.5% 08.08.19 /CV 08/08/2019	2.500	USD	280.623	6.195
ASM PACIFIC 2% 14-28.03.19 /CV 28/03/201	120.000	HKD	14.217.840	(128.283)
ASM PACIFIC TECHNOLOGY LTD 31/12/2099	(86.900)	HKD	(8.785.590)	149.118
AYALA LAND USD EQUIV 31/12/2099	(731.655)	USD	(608.997)	(22.186)
AYC FIN 0.5% 14-02.05.19 /CV 02/05/2019	11.960	USD	1.296.356	29.524
BAYER 5.625% 16-22.11.19/CV 21/11/2019	8.000	EUR	937.808	(148.654)
BAYER AG 31/12/2099	(7.050)	EUR	(755.408)	124.679
BLACK HILLS CORP 31/12/2099	(18.522)	USD	(1.290.243)	(25.538)
BLACK HILLS CORP UNITS 31/12/2099	18.506	USD	1.394.982	37.752
BLACKROCK CAPITAL INV CORP 31/12/2099	(2.491)	USD	(18.907)	(25)
BLACKSTONE 5.25% 01.12.18 /CV 01/12/2018	9.610	USD	1.092.868	(8.049)
BLACKSTONE MORT TRUST-A-/REIT 31/12/2099	(26.251)	USD	(810.368)	3.938
BRITISH LAND 1.5% 10.09.17 CV 10/09/2017	5.000	GBP	503.435	751
BROADSOFT 1% 16-01.09.22 /CV 01/09/2022	6.200	USD	792.986	4.855
BROADSOFT INC 31/12/2099	(11.579)	USD	(510.055)	2.316
C.P.ALL --- SHS FOREIGN REGIST 31/12/209	(158.000)	USD	(288.444)	(1.235)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
CAHAYA CAPI 0% 14-18.09.21 /CV 18/09/202	1.590	USD	155.262	138
CARDTRONICS 1% 14-01.12.20 /CV 01/12/202	5.720	USD	546.226	2.722
CARDTRONICS PLC 31/12/2099	(5.444)	USD	(170.397)	5.898
CARILLION 2.5% 14-19.12.19 /CV 31/12/209	10.000	GBP	684.660	82.498
CHINA RAILWAY CONSTR CORP -H- 31/12/2099	(124.150)	HKD	(1.281.228)	3.815
CHINA YANGT 0% 16-09.11.21 /CV 09/11/202	6.000	EUR	629.904	1.832
CHUGOKU ELE 0% 15-23.3.18 /CV 23/03/2018	300.000	JPY	29.917.500	190
CHUGOKU ELE 0% 15-25.03.20 /CV 25/03/202	800.000	JPY	79.843.200	(2.814)
CHUGOKU ELECTR.POWER JPY 500 31/12/2099	(3.500)	JPY	(4.231.500)	830
CIENA 4% 12-15.12.20 CV 15/12/2020	4.580	USD	655.787	(9.629)
CIENA CORP 31/12/2099	(13.601)	USD	(350.226)	4.567
CITRIX SYST 0.5% 15.04.19 /CV 31/12/2099	18.970	USD	2.257.734	(54.330)
CITRIX SYSTEMS INC 31/12/2099	(20.692)	USD	(1.634.254)	44.083
CNA RAILWAY 0% 16-29.01.21 /CV 29/01/202	2.500	USD	287.730	(3.270)
COLONY 3.875% 14-15.01.21 CV 15/01/2021	10.090	USD	1.039.119	651
COLONY NORTHSTAR INC -A- 31/12/2099	(18.252)	USD	(267.209)	913
CP FOODS 0.5% 16-22.09.21 /CV 22/09/2021	16.000	USD	1.639.536	3.003
CROWN CASTLE INTERNATIONAL SHS 31/12/209	(3.891)	USD	(391.357)	(15.666)
CTRIP.COM 1% 16-01.07.20 CV 01/07/2020	5.370	USD	656.713	18.355
CTRIP.COM 1.25% 15.10.18 /CV 15/10/2018	5.920	USD	906.133	38.129
CTRIP.COM INTERNATION. LTD/SADR 31/12/20	(19.930)	USD	(1.190.419)	(71.180)
DANA GAS 7% 13-31.10.17/CV 31/12/2099	1.680	USD	134.990	(19.911)
DCM HLD 0% 15-21.12.20 /CV 31/12/2099	1.880.000	JPY	206.581.920	6.534
DCM HOLDINGS CO LTD 31/12/2099	(103.100)	JPY	(99.079.100)	361
DHT HOLDING 4.5% 01.10.19/CV 01/10/2019	12.780	USD	1.291.368	2.249
DHT HOLDINGS 31/12/2099	(93.001)	USD	(386.884)	16.740
DISH NETWORK CORP -A- 31/12/2099	(4.577)	USD	(293.065)	7.496
DISH NETWRK 2.375%15.03.24 /CV 15/03/202	3.450	USD	371.506	(3.843)
EDION CORP 0% 14-01.10.21 /CV 01/10/2021	1.000.000	JPY	117.300.000	13.802
EDION CORP 31/12/2099	(76.800)	JPY	(78.028.800)	(8.871)
EI GRP 31/12/2099	(135.541)	GBP	(193.146)	(28.529)
ELEC FOR IM 0.75% 01.09.19 /CV 01/09/201	4.340	USD	468.468	(1.639)
ELECTRONICS FOR IMAGING INC 31/12/2099	(4.409)	USD	(214.189)	366
EMPIRE STAT 2.625% 15.8.19 /CV 15/08/201	19.730	USD	2.267.273	(19.193)
EMPIRE STATE RT /REIT 31/12/2099	(66.202)	USD	(1.382.960)	14.258
ENN ENERGY 0% 13-26.02.18/CV 26/02/2018	10.000	USD	1.149.350	20.805
ENN ENERGY HOLDINGS 31/12/2099	(109.000)	HKD	(5.749.750)	(12.824)
ENTER FD 3.5% 13-10.9.20CV REGS 10/09/20	6.000	GBP	622.824	38.626
EURONET WLD 1.5% 14-1.10.44/CV 01/10/204	16.260	USD	2.246.937	128.650
EURONET WORLDWIDE INC 31/12/2099	(17.758)	USD	(1.715.600)	(114.308)
EVONIK INDUSTR -SHS- 31/12/2099	(15.000)	EUR	(432.000)	86
EZCORP INC -A-/NON-VOTING 31/12/2099	(5.803)	USD	(45.263)	(1.161)
FINISAR CORP 31/12/2099	2.901	USD	78.965	(2.948)
FINISR 0.5% 16-15.12.36/CV 144A 15/12/20	(2.080)	USD	(208.062)	2.436

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
FIREEYE 1.625% 15-01.06.35 /CV 01/06/203	4.370	USD	399.750	1.114
FIREEYE INC 31/12/2099	(2.860)	USD	(41.842)	2.488
FLEXION 3.375% 01.05.24 /CV 01/05/2024	6.010	USD	670.740	(1.140)
FLEXION THERAPEUTICS INC 31/12/2099	(23.380)	USD	(533.064)	8.914
FLUIDIGM 2.75% 01.02.34 CV 01/02/2034	9.640	USD	549.808	(59.450)
FLUIDIGM CORP 31/12/2099	(4.693)	USD	(17.646)	2.065
FRESENIUS 0% 14-24.09.19 /CV 24/09/2019	6.000	EUR	874.878	(81.233)
FRESENIUS SE & CO KGAA 31/12/2099	(10.800)	EUR	(771.444)	84.386
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP NPV	(42.623)	USD	(652.558)	(40.918)
FTR /CV PFD 31/12/2099	34.099	USD	865.092	6.422
GEN CABLE ST-DW 09-15.11.29 CV 15/11/202	4.370	USD	393.706	18.924
GENERAL CABLE CORPORATION 31/12/2099	(12.287)	USD	(237.139)	(13.516)
GOLAR LNG LTD BERMUDA 31/12/2099	(11.495)	USD	(273.696)	(7.527)
GOLR BRM 2.75% 15.2.22 /CV 144A 15/02/20	8.150	USD	797.494	10.153
GREAT PORTL /REIT 31/12/2099	(75.362)	GBP	(453.679)	(3.477)
GREAT PORTL 1% 10.9.18 CV 31/12/2099	13.000	GBP	1.335.646	(2.096)
GULF KEYS 10% 16-18.10.21 /PIK 18/10/202	4.390	USD	450.423	326
GULF KEYSTONE PETROLEUM LTD 31/12/2099	427.135	USD	512.562	(148)
HAITAN INTL HLDGS LTD 31/12/2099	(90.000)	HKD	(2.016.000)	2.939
HAITIAN INT 2% 6.2.2019CV/1882 13/02/201	5.000	USD	558.175	(3.339)
HAITONG INT 0% 25.10.21/CV 25/10/2021	40.000	HKD	4.077.400	3.969
HAITONG INT SEC 31/12/2099	(59.000)	HKD	(265.500)	76
HEALTHWAYS 1.5% 1.7.18 /CV 01/07/2018	5.420	USD	1.108.677	2.751
HESS CORP 31/12/2099	(9.250)	USD	(411.995)	(24.175)
HESS CORP 8% /CV PFD -A- 01/02/2019	9.537	USD	536.456	31.854
IBERDROLA SA 31/12/2099	(262.346)	EUR	(1.748.274)	76.089
IHH HEALTHCARE BHD 31/12/2099	(652.630)	SGD	(1.226.944)	4.202
INDAH CAPIT 0% 24.10.18 CV 24/10/2018	24.500	SGD	2.549.225	13.539
INMARSAT 3.875% 09.09.23 /CV 09/09/2023	6.000	USD	713.838	13.192
INMARSAT PLC 31/12/2099	(24.298)	USD	(252.213)	(10.535)
INNOVIVA INC 31/12/2099	(31.750)	USD	(435.610)	(24.488)
INTEL 3.25% 09-01.08.39 CV 01/08/2039	4.390	USD	757.793	12.763
INTEL CORP. 31/12/2099	(18.054)	USD	(640.375)	(18.054)
INTERDIGIT 1.5% 15-1.03.20 /CV 01/03/202	14.780	USD	1.746.006	(34.910)
INTERDIGITAL INC 31/12/2099	(14.955)	USD	(1.089.472)	44.865
IRIDIUM COMMUNICATIONS 31/12/2099	(47.181)	USD	(469.451)	49.540
J SAINSBURY 1.25% 21.11.19 /CV 21/11/201	9.000	GBP	926.316	(16.671)
J.SAINSBURY PLC 31/12/2099	(92.843)	GBP	(227.280)	11.084
J2 GLOBAL 3.25% 14-15.6.29/CV 31/12/2099	16.290	USD	2.237.725	18.332
J2 GLOBAL INC 31/12/2099	(18.714)	USD	(1.583.766)	749
JANUS CAP 0.75% 13-15.7.18 /CV 15/07/201	12.160	USD	1.813.895	35.507
JANUS HENDERSON GROUP 31/12/2099	(41.512)	USD	(1.390.237)	(18.224)
JUST ENERGY GROUP 31/12/2099	(70)	USD	(375)	6
KAKAO CORP 0% 16-11.05.21 /CV 11/05/2021	12.000.000	USD	1.106.568	43.560
KAMAN CORP A 31/12/2099	(4.878)	USD	(249.363)	(2.195)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
KANDENKO CO LTD 31/12/2099	(19.000)	JPY	(22.420.000)	(8.763)
KANS PAINT 0% 16-17.06.22 /CV 17/06/2022	600.000	JPY	63.550.200	(8.341)
KANSAI PAINT CO LTD OSAKA 31/12/2099	(24.800)	JPY	(62.768.800)	18.590
KEIHAN HOLDINGS CO..LTD. 31/12/2099	(41.900)	JPY	(29.916.600)	(4.885)
KLOECKNER & CO AG/NAMENSAKTIEN 31/12/209	(16.950)	EUR	(158.279)	13.429
KLOECKNER 2% 16-08.09.23 /CV 08/09/2023	5.000	EUR	515.075	1.722
KONINKLIJKE KPN /EUR 0.04 31/12/2099	(27.693)	EUR	(84.851)	(4.588)
KUNLUN EN 1.625% 25.7.19 /CV 25/07/2019	10.000	USD	174.375	5.624
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD 31/12/2099	(60.000)	HKD	(463.800)	(5.301)
KYUSHU ELECTR.POWER CO/JPY 500 31/12/209	(43.000)	JPY	(56.158.000)	2.877
KYUSHU POW 0% 17-31.03.20 /CV 31/12/2099	600.000	JPY	63.829.800	1.309
KYUSHU POW 0% 17-31.03.22 /CV 31/12/2099	800.000	JPY	85.824.000	1.122
LARSEN TOUBRO /GDR REPR.1 SHS 31/12/2099	(14.499)	USD	(263.882)	(1.933)
LARSEN&TOUB 0.675% 14-19 /CV 22/10/2019	6.300	USD	643.167	(461)
LIB MEDIA 1% 17-30.01.23 /CV 30/01/2023	4.560	USD	515.886	(4.630)
LIBERTY FORMULA ONE 31/12/2099	(8.652)	USD	(304.291)	3.625
LIBERTY MED 1.375%15.10.23 /CV 15/10/202	10.950	USD	1.392.172	100.164
LIBERTY MED FORMULA ONE -A- 31/12/2099	(4.661)	USD	(157.309)	(4.195)
LIBERTY MEDIA CORP 31/12/2099	(20.895)	USD	(920.769)	(79.798)
LIGAND PHAR 0.75% 15.08.19 /CV 15/08/201	16.480	USD	2.730.192	89.718
LIGAND PHAR -B- 31/12/2099	(19.741)	USD	(2.386.884)	(82.123)
LOEN ENTERTAINMENT INC 31/12/2099	(4.000)	USD	(320.410)	(14.817)
MAIRE TECNI 5.75% 20.2.19 /CV 20/02/2019	3.000	EUR	687.594	84.325
MAIRE TECNIMONT AZ POST RAGGRU 31/12/209	(139.316)	EUR	(660.079)	(81.303)
MEDICINES 2.5% 15-15.01.22 /CV 15/01/202	18.170	USD	2.387.702	(1.653)
MEDICINES CO 31/12/2099	(40.732)	USD	(1.566.145)	(6.110)
MEDIDATA 1% 13-1.8.18 CV 01/08/2018	4.080	USD	567.402	(20.028)
MEDIDATA SOLUTIONS 31/12/2099	(5.976)	USD	(459.017)	25.039
MERCADOLIB 2.25% 01.07.19 /CV 01/07/2019	9.000	USD	2.086.677	110.108
MERCADOLIBRE INC 31/12/2099	(6.931)	USD	(1.999.039)	(83.506)
MICROC TEC 1.625% 15-15.2.25CV 15/02/202	10.170	USD	1.601.826	(8.082)
MICROCHIP TECHNOLOGY INC. 31/12/2099	(26.812)	USD	(2.146.032)	26.544
MNV 3.375% 13-02.04.19 /CV 02/04/2019	27.000	EUR	3.252.744	(133.505)
MODWEN PROPERT.PLC.ST. 31/12/2099	(2.259)	GBP	(8.099)	(485)
MOH 1.125% 13-15.01.20 /CV 15/01/2020	11.620	USD	1.972.588	(86.751)
MOLINA HEALTHCARE INC 31/12/2099	(25.925)	USD	(1.731.790)	89.982
NAT GRID U 0.9% 2.11.20 CV 02/11/2020	8.000	GBP	813.888	(7.007)
NAT HEALTH INV3.25% 1.4.21/CV 01/04/2021	18.480	USD	2.151.109	(1.946)
NATIONAL GRID PLC 31/12/2099	(13.943)	GBP	(130.618)	12.536
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC. 31/12/209	(16.318)	USD	(1.260.566)	8.485
NCR CORP 31/12/2099	(6.813)	USD	(257.872)	23.300
NH HOTELES 4% 13-08.11.18 /CV 08/11/2018	3.000	EUR	374.520	13.718
NH HOTELES SA 31/12/2099	(28.218)	EUR	(158.867)	(4.939)
NIPPON CERAMIC 31/12/2099	16	JPY	46.352	20
NUANCE 1.25% 17-01.04.25 /CV 01/04/2025	4.670	USD	474.080	2.003

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
NUANCE COMMUNICATIONS INC 31/12/2099	(14.746)	USD	(255.106)	(295)
NUVASIVE 2.25% 16-15.03.21 /CV 15/03/202	5.370	USD	675.519	(76.281)
NUVASIVE INC 31/12/2099	(6.338)	USD	(416.977)	80.388
NYRSTAR 5% 16-11.07.22 /CV 11/07/2022	4.000	EUR	415.936	(783)
NYRSTAR NV 31/12/2099	(16.343)	EUR	(89.658)	(578)
OCI 3.875% 13-25.09.18 /CV 25/09/2018	20.500	EUR	2.105.719	(14.989)
OCI 31/12/2099	(14.601)	EUR	(264.497)	28.232
OITA BANK 0% 14-18.12.19 /CV 18/12/2019	20.000	USD	2.061.260	(33.740)
ON SEMICOND 1% 16-01.12.20 /CV 01/12/202	(3.910)	USD	(422.124)	(1.266)
ON SEMICONDUCTOR CORP 31/12/2099	10.050	USD	150.248	(603)
PACIFIC BASIN SHIPPING LTD 31/12/2099	(45.000)	HKD	(76.950)	(58)
PALO ALTO 0% 14-01.07.19 CV 01/07/2019	13.350	USD	1.736.288	(58.887)
PALO ALTO NETWORKS INC 31/12/2099	(9.078)	USD	(1.196.299)	62.457
PATTERN ENERGY GROUP INC 31/12/2099	(9.552)	USD	(239.755)	(4.727)
PATTERN ENR 4% 16-15.07.20/CV 15/07/2020	8.870	USD	938.854	9.927
PB ISSUER N 3.25%03.07.21 /CV 03/07/2021	2.000	USD	195.104	982
PHP FIN 4.25% 14-20.05.19 /CV 20/05/2019	4.000	GBP	477.636	14.845
PLAYTECH LIMITED 31/12/2099	(135.001)	EUR	(1.449.944)	9.229
PREMIER OIL PLC 31/12/2099	(420.126)	USD	(335.093)	4.811
PRICELINEGR 0.9% 15-15.09.21 15/09/2021	(9.280)	USD	(1.114.472)	(26.508)
PRICELN GRP 1%15.03.18 CV/PCLN 15/03/201	4.130	USD	886.761	74.439
PRIM HEALTH /REIT 31/12/2099	(241.294)	GBP	(279.298)	(8.423)
PROOFPOINT 0.75% 15.06.20 /CV 15/06/2020	(5.490)	USD	(685.838)	10.420
PROOFPOINT INC 31/12/2099	3.901	USD	332.521	(13.185)
PROSPECT CAPITAL CORP 31/12/2099	(2.740)	USD	(22.386)	(14)
PRYSMIAN 1.25% 13-8.3.18 CV 08/03/2018	8.000	EUR	988.904	23.916
PRYSMIAN SPA 31/12/2099	(28.397)	EUR	(768.139)	(27.934)
PT JERSEY 0.5% 14-19.11.19 /CV 19/11/201	16.000	EUR	1.993.024	(10.517)
QUIDEL 3.25% 14-15.12.20 /CV 15/12/2020	4.910	USD	597.007	(67.265)
QUIDEL CORP 31/12/2099	(11.942)	USD	(382.025)	69.139
RAG STIFTUN 0% 14-31.12.18 /CV 31/12/201	14.000	EUR	1.433.082	(1.816)
RED HAT INC 0.25% 14-1.10.19 31/12/2099	5.420	USD	769.364	3.111
RED HAT INC 31/12/2099	(6.023)	USD	(595.494)	(2.048)
RESORTTRUST 0% 14-01.12.21 /CV 01/12/202	200.000	JPY	20.331.400	438
RESORTTRUST INC. NAGOYA CITY 31/12/2099	(600)	JPY	(1.220.400)	152
RICHTER GEDEON 31/12/2099	(95.829)	EUR	(2.070.473)	109.491
SACYR 4% 14-08.05.19 /CV 08/05/2019	3.000	EUR	303.213	1.844
SALESFORCE 0.25% 14-1.4.18 CV 01/04/2018	7.760	USD	1.074.434	18.487
SALESFORCE COM INC 31/12/2099	(10.711)	USD	(972.559)	(15.928)
SANKYO 0% 15-23.07.20 /CV 23/07/2020	300.000	JPY	30.198.900	918
SANKYO 31/12/2099	(1.400)	JPY	(5.068.000)	190
SBI HOLDING 0% 13-02.11.17 /CV 02/11/201	200.000	JPY	22.367.000	5.765
SBI HOLDINGS INC 31/12/2099	(8.400)	JPY	(13.263.600)	(4.199)
SEACOR HLDG 2.5% 13-15.12.27CV 15/12/202	6.450	USD	646.748	1.132
SEACOR HLDG 3% 13-15.11.28 /CV 15/11/202	20.050	USD	1.723.137	6.473
SEACOR HOLDINGS INC 31/12/2099	(7.357)	USD	(250.800)	12.753

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SEMICONDUCT 0% 16-07.07.22 /CV 07/07/202	5.000	USD	566.150	(11.375)
SEMICONDUCT 31/12/2099	(590.920)	HKD	(5.052.366)	(1.104)
SERVICEN 0% 17-01.06.22/CV 144A 01/06/20	1.810	USD	188.904	438
SERVICENOW 0% 13-01.11.18 CV 01/11/2018	9.900	USD	1.505.364	26.742
SERVICENOW INC 31/12/2099	(14.317)	USD	(1.581.313)	(18.140)
SGPS 5.25% 10-28.9.17 CV/GALP 28/09/2017	12.000	EUR	1.266.612	416
SHIP FIN 5.75% 16-15.10.21 /CV 15/10/202	7.900	USD	758.771	3.895
SHIP FIN IN 3.25% 13-1.2.18 CV 01/02/201	5.750	USD	612.341	4.250
SHIP FINANCE INTERNATIONAL 31/12/2099	(45.906)	USD	(624.322)	(6.886)
SHUTTERFLY 0.25% 13-15.05.18 15/05/2018	13.050	USD	1.313.339	15.906
SHUTTERFLY INC COM 31/12/2099	(4.700)	USD	(230.488)	(3.431)
SIEM INDUS 2.25% 02.06.21 /CV 02/06/2021	3.000	EUR	433.794	(4.637)
SILICONWARE 0% 14-31.10.19 /CV 31/10/201	15.000	USD	1.687.860	4.958
SILICONWARE PREC.IND. /SADR 31/12/2099	(23.571)	USD	(192.339)	0
SILICONWARE PRECISION USD EQUIV 31/12/2	(91.966)	USD	(151.525)	465
SIRIUS MIN 8.5% 16-28.11.23/CV 28/11/202	2.000	USD	285.590	(2.066)
SIRIUS MINERALS PLC 31/12/2099	(651.990)	USD	(259.585)	(28.233)
ST MODWEN 2.875% 14-6.3.19/CV 06/03/2019	2.000	GBP	201.552	1.661
STAR MICRONICS CO LTD 31/12/2099	(33.900)	JPY	(62.003.100)	30.198
STARWOOD 3.75% 14-15.10.17 CV 31/12/2099	11.460	USD	1.163.224	5.922
STARWOOD 4.375%01.04.23 /CV 01/04/2023	2.340	USD	241.118	1.037
STARWOOD PROPERTY TRUST 31/12/2099	(1.821)	USD	(40.135)	109
STEINHOFF F 4% 14-30.01.21 /CV 30/01/202	12.000	EUR	1.526.244	(77.659)
STEINHOFF IN HD 31/12/2099	(172.900)	EUR	(740.012)	63.805
STMICROELEC 0% 14-03.07.19 /CV 03/07/201	6.000	USD	840.966	124.482
STMICROELECTRONICS NV 31/12/2099	(12.737)	USD	(216.694)	(62.498)
SUBSEA 7 SA 31/12/2099	(16.630)	EUR	(207.791)	7.545
SUN EDISON 0.25% 15.01.20 /CV 15/01/2020	1.610	USD	3.761	340
SUNEDISON 2.375% 15-15.4.22 CV 15/04/202	7.720	USD	17.192	787
SUZUKI MOT 0% 16-31.03.23 /CV 31/12/2099	100.000	JPY	13.439.000	(2.241)
SUZUKI MOTOR CORP 31/12/2099	(91.100)	JPY	(476.453.000)	98.558
TCP CAPITAL 4.625% 1.03.22 /CV 01/03/202	8.730	USD	912.966	6.211
TCP CAPITAL CORP 31/12/2099	(16.674)	USD	(277.289)	3.835
TEIJIN LTD 0% 14-10.12.21 /CV 10/12/2021	600.000	JPY	72.300.000	(7.256)
TEIJIN LTD 31/12/2099	(64.900)	JPY	(143.948.200)	1.573
TENAGA NASIONAL USD EQUIV 31/12/2099	(5.312)	USD	(17.519)	50
TESLA INC 2.375% 17-15.3.22/CV 15/03/202	3.720	USD	443.569	(35.278)
TESLA INC 31/12/2099	(1.002)	USD	(324.117)	39.915
THE PRICELINE GROUP INC SHS 31/12/2099	225	USD	456.413	1.593
THERAV BIO 3.25% 01.11.23 /CV 01/11/2023	3.740	USD	445.471	(37.262)
THERAVANCE 2.125% 15.01.23 CV 15/01/2023	10.040	USD	946.310	27.366
THERAVANCE BIOPHARMA INC 31/12/2099	(8.777)	USD	(282.005)	48.010
TIVITY HEALTH INC 31/12/2099	(27.289)	USD	(1.082.009)	1.364
TOHOKU EL P 0% 15-03.12.18 /CV 03/12/201	1.400.000	JPY	139.815.200	2.920
TOHOKU EL P 0% 15-03.12.20 /CV 03/12/202	1.000.000	JPY	101.739.000	2.917
TOHOKU ELECTR.POWER JPY 500 31/12/2099	(19.200)	JPY	(28.838.400)	(1.580)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
TOPPAN PRIN 0% 13-19.12.19 /CV 19/12/201	500.000	JPY	56.510.000	(8.688)
TOPPAN PRINTING CO.LTD 31/12/2099	(27.000)	JPY	(31.482.000)	9.126
TRANSCOSMO 0% 15-22.12.20/CV 22/12/2020	300.000	JPY	30.580.200	3.893
TTM TECH 1.75% 13-15.12.20 /CV 15/12/202	5.060	USD	956.704	(47.078)
TTM TECHNOLOGIES INC 31/12/2099	(46.898)	USD	(815.087)	51.588
TULLOW 21EN 6.625% 12.07.21 /CV 12/07/20	4.000	USD	446.896	20.609
TULLOW OIL PLC 31/12/2099	(82.537)	USD	(182.914)	(22.266)
TWITTER 0.25% 14-15.09.19 /CV 15/09/2019	1.610	USD	152.367	(113)
TWITTER 1% 14-15.09.21 /CV 15/09/2022	870	USD	80.108	339
TWO HARBORS 6.25%15.01.22 /CV 15/01/2022	5.310	USD	562.414	6.293
TWO HARBORS INV/REIT 31/12/2099	(26.182)	USD	(258.940)	(1.309)
UTD LAB INT 4.5%05.12.21/CV 05/12/2021	9.000	USD	1.058.859	(18.887)
UTD LABORATORIES INTL HLDS 31/12/2099	(832.000)	HKD	(4.076.800)	14.914
VISHAY INT 2.25% 10-15.11.40CV 15/11/204	35.770	USD	5.008.444	121.944
VISHAY INT 2.25% 12-1.6.42 /CV 01/06/204	6.190	USD	1.019.437	24.047
VISHAY INTERTECHNOLOGY INC 31/12/2099	(310.657)	USD	(5.545.227)	(123.738)
VOLCAN 4.125% 17-11.04.20 /CV 11/04/2020	16.000	GBP	1.667.584	368.104
WORKDAY 1.5% 13-15.07.20/CV 15/07/2020	6.790	USD	941.909	430
WORKDAY INC - CLASS A 31/12/2099	(6.235)	USD	(636.656)	4.863
WORLD 3.375%15.12.23 /CV 15/12/2023	5.930	USD	647.117	14.385
WORLD WRESTLING ENTERTAINM. A 31/12/209	(19.773)	USD	(418.397)	(8.816)
YAHOO INC 0% 13-01.12.18 /CV 01/12/2018	14.680	USD	1.737.172	19.466
YAMADA DENK 0% 28.6.19 CV/YME 28/06/2019	1.900.000	JPY	219.218.200	54.002
YAMADA DENKI CO LTD 31/12/2099	(247.200)	JPY	(145.600.800)	(53.499)
YAMAGATA BANK LTD 31/12/2099	(161.600)	USD	(732.702)	(17.397)
YAMAGATA BK 0% 14-22.4.19 /CV 22/04/2019	23.000	USD	2.347.587	4.462
YAMAGUCHI FINANCIAL GROUP INC 31/12/2099	(14.000)	JPY	(18.186.000)	6.082
YAMAGUCHI FINANCIAL GROUP INC 31/12/2099	(112.100)	USD	(1.317.842)	22.264
YUEXIU TRANSPOR INFRASTRUCTURE 31/12/209	(186.500)	HKD	(1.089.160)	(5.731)
Gesamt				**696.873**

Zum 31. Juli 2017 beträgt der nicht realisierte Nettogewinn aus CFD USD 696.873.
Kontrahenten der CFD waren BNP Paribas London Branch, Citibank NA, Deutsche Bank AG und Nomura International.

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Zum 31. Juli 2017 bestehen folgende CFD in Bezug auf den Teilfonds DB Platinum IV Clinton Equity Strategies:

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
21ST CENTURY -SHS A-	19.605	USD	570.506	21.187
3I GROUP PLC	3.283	GBP	30.729	0
3I INFRASTRUCT GBP	(49.995)	GBP	(98.190)	0
3M CO	496	USD	99.780	1.051
3SBIO INC	(51.371)	HKD	(503.436)	0
A2A SPA	160.840	EUR	231.288	0
AA PUBLIC LIMITED COMPANY	20.138	GBP	49.197	0
AAC TECHNOLOGIE SHS	(3.505)	HKD	(368.376)	0
AAK SHS	(923)	SEK	(551.031)	0
AALBERTS INDUSTRIES NV	(687)	EUR	(25.350)	0
AAREAL BANK AG	3.519	EUR	124.221	0
ABACUS PROPERTY GRP	10.646	AUD	33.109	0
ABB	(18.295)	CHF	(415.297)	0
ABBOTT LABORATORIES INC	1.341	USD	65.950	(2.213)
ABBVIE INC	2.927	USD	204.627	(4.341)
ABCAM PLC	1.775	GBP	18.229	0
ABIOMED INC.	2.886	USD	427.388	(310)
ACACIA MINING PLC-SHS	128.238	GBP	223.391	0
ACADIA HEALTHCARE SHS	(17.709)	USD	(937.337)	(32.694)
ACADIA PHRAMACEUTICALS INC	(34.347)	USD	(1.022.510)	7.774
ACCENTURE PLC	(463)	USD	(59.644)	(42)
ACCIONA SA /ESP 167	153	EUR	11.054	0
ACCOR SA	(26.267)	EUR	(1.031.242)	0
ACCTON TECHNOLOGY CORP	49.883	USD	132.988	55
ACEA	199	EUR	2.523	0
ACER USD EQUIV	(161.586)	USD	(79.468)	(33)
ACERINOX SA	(14.625)	EUR	(158.974)	0
ACKERMANS & VAN HAAREN SA	(441)	EUR	(67.385)	0
ACS	13.280	EUR	430.604	0
ACTIVIA PROPERTIES INC	3	JPY	1.486.500	0
ACTIVISION BLIZZARD INC	(852)	USD	(52.637)	(550)
ACUITY BRANDS INC	(6.131)	USD	(1.242.447)	20.905
ADDTECH AB	3.302	SEK	520.065	0
ADECCO GROUP SA /ACT.NOM.	10.556	CHF	779.033	0
ADELAIDE BRIGHTON LTD	(5.230)	AUD	(29.393)	0
ADIDAS AG	4.391	EUR	847.463	0
ADMIRAL GROUP PLC	(21.547)	GBP	(445.592)	0
ADO PROPERTIES S.A. /REIT	482	EUR	18.391	0
ADOBE SYSTEMS INC	(427)	USD	(62.551)	442
ADVANCE AUTO PARTS INC	(9.978)	USD	(1.117.636)	(58.045)
ADVANCE RESIDENCE INVESTMENT	4	JPY	1.077.600	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ADVANCED MICRO DEVICES INC	9.511	USD	129.445	(10.056)
ADVANCED SEMICONDUCT.ENG.INC-USD EQ	(5.065)	USD	(6.810)	(2)
ADVANTECH CO USD EQUIV	(3.741)	USD	(28.310)	(11)
ADVANTEST CORP.	(12.547)	JPY	(25.432.769)	0
AEDIFICA SA -ACT- /REIT	522	EUR	40.382	0
AEGON NV	(99.337)	EUR	(470.758)	0
AEKYUNG PETROCHEM.	325	USD	20.832	597
AENA S.A	4.379	EUR	723.630	0
AEON FINANCIAL SHS	(43.904)	JPY	(105.413.504)	0
AEON MALL CO LTD	(9.091)	JPY	(19.100.191)	0
AERCAP HOLDINGS NV	(861)	USD	(42.275)	(196)
AEROMEXICO – CFD	22.819	MXN	842.477	(268)
AEROPORTS DE PARIS ADP	113	EUR	16.165	0
AES CORP. – CFD	16.542	USD	184.940	(374)
AES TIETE ENERGIA SA /UNIT	(1.300)	BRL	(18.278)	0
AETNA INC – CFD	3.422	USD	528.049	(1.531)
AF AB – CFD	4.974	SEK	879.901	0
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	(2.534)	USD	(470.893)	(11.632)
AFLAC INC. – CFD	71	USD	5.662	184
AGCO CORP. – CFD	8.085	USD	583.252	2.323
AGEAS NV – CFD	(11.568)	EUR	(440.336)	0
AGGREKO PLC – CFD	6.005	GBP	50.952	0
AGILE GRP HLDGS --- SHS	(718)	HKD	(6.677)	0
AGILENT TECHNOLOGIES	214	USD	12.795	(161)
AGL ENERGY LTD	132.999	AUD	3.205.276	0
AGNC INVESTMENT CORP /REIT	41.707	USD	883.354	3.966
AGRANA BETEILIGUNG AG	1.265	EUR	144.843	0
AIA GROUP LTD	34.953	HKD	2.151.357	0
AIG – CFD	(8.242)	USD	(539.439)	(1.564)
AIN HLDG – CFD	(224)	JPY	(1.780.800)	0
AIR CANADA VT AND VAR VT SHS	(715)	CAD	(14.178)	0
AIR CHINA LTD -H-	14.804	HKD	104.516	0
AIR FRANCE - KLM	28.267	EUR	323.233	0
AIR LEASE CORP	(24.118)	USD	(954.590)	5.845
AIR NEW ZEALAND LTD	(2.660)	NZD	(8.911)	0
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	(99)	USD	(14.073)	782
AIR WATER INC OSAKA	1.442	JPY	3.090.206	0
AIRBUS SE – CFD	(19.791)	EUR	(1.397.245)	0
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4.067	USD	55.021	22
AJINOMOTO CO. INC	(16.655)	JPY	(36.957.445)	0
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	(12.499)	USD	(589.203)	50.913
AKBANK	15.721	TRY	164.442	0
AKER ASA -A-	12.763	NOK	3.803.374	0
AKER BP ASA	33.517	NOK	4.973.923	0
AKER SOLUTIONS SHS	12.439	NOK	489.723	0
AKZO NOBEL NV (EUR 2)	(2.855)	EUR	(218.179)	0
ALAMOS GOLD INC	1.663	CAD	14.684	149

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ALASKA AIR GROUP INC	7.790	USD	663.942	(13.296)
ALBEMARLE CORP	1.870	USD	216.546	(3.060)
ALCOA CORP	0	USD	0	36
ALEXION PHARMA INC	(375)	USD	(51.503)	(2.345)
ALFA LAVAL AB	21.029	SEK	3.793.632	0
ALFA SAB DE CV A	(81.750)	MXN	(2.020.043)	(137)
ALFRESA HLD CORP TOKYO	6.335	JPY	12.872.720	0
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1.331	CAD	17.742	398
ALIANSCE SHOPPING CENTER	(19.682)	BRL	(330.658)	0
ALIGN TECHNOLOGY INC	(2.878)	USD	(481.288)	(16.123)
ALIMENT COUCHE TARD-VTG B	733	CAD	43.335	(961)
ALIOR BANK	(602)	PLN	(38.588)	0
ALKERMES PLC	(636)	USD	(34.605)	1.688
ALLEGHANY CORP (DEL)	393	USD	241.043	(5.619)
ALLEGION PLC	655	USD	53.212	1.532
ALLERGAN PLC	(891)	USD	(224.826)	2.515
ALLIANCE DATA SYSTEM CORP	440	USD	106.229	(282)
ALLIANT ENERGY CORP	2.888	USD	117.051	(58)
ALLIANZ SE/NAM.VINKULIERT	(432)	EUR	(77.760)	0
ALLISON TR	158	USD	5.972	91
ALLREAL HOLDING AG ZUG	2	CHF	352	0
ALLSTATE CORP	(5.592)	USD	(508.872)	(4.965)
ALLY FINANCIAL INC	(5.241)	USD	(118.656)	(3.230)
ALMIRALL	(18.627)	EUR	(152.369)	0
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1.556	USD	128.743	626
ALPEK	(23.578)	MXN	(482.406)	(66)
ALPHABET INC -A-	(533)	USD	(503.952)	12.541
ALS LTD	10.867	AUD	80.633	0
ALSEA SAB DE CV	11.776	MXN	815.841	(13)
ALSTOM	757	EUR	22.926	0
ALSTRIA OFFICE REIT AG	1.456	EUR	18.047	0
ALTAGAS	29	CAD	842	(1)
ALTAREA	139	EUR	26.549	0
ALTEN	(572)	EUR	(41.727)	0
ALTIUM	(614)	AUD	(5.373)	0
ALTRAN TECHNOLOGIES SA	4.774	EUR	70.918	0
ALTRIA GROUP	49.197	USD	3.196.329	(200.659)
ALUMINA LIMITED	20.172	AUD	38.327	0
ALUPAR INV /UNITS (1SH+2PFD)	(2.053)	BRL	(37.652)	0
AMADEUS IT --- SHS-A-	(803)	EUR	(41.804)	0
AMAYA INC	2.971	CAD	65.689	146
AMAZON COM INC	(83)	USD	(81.986)	1.993
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	(19.329)	USD	(394.312)	6.818
AMC NETWORKS INC	(8.188)	USD	(523.623)	2.994
AMCOR LTD	(49.769)	AUD	(763.456)	0
AMDOCS LTD	(157)	USD	(10.546)	(54)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
AMER SPORTS CORPORATION A	(5.782)	EUR	(131.251)	0
AMERCO	(2.180)	USD	(847.061)	(12.032)
AMERICA MOVIL SAB DE CV -L-	(376.391)	MXN	(5.920.630)	633
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2.482	USD	125.192	(63)
AMERICAN CAMPUS COMMUNIT /REIT	(17)	USD	(815)	(13)
AMERICAN ELECTRIC POWER CO.INC	311	USD	21.938	42
AMERICAN FINANCIAL GROUP	3.561	USD	361.085	(4.641)
AMERICAN HOMES 4 RENT	(725)	USD	(16.682)	106
AMERICAN TOWER CORP	(4.731)	USD	(644.977)	1.219
AMERICAN WATER WORKS CO INC	(253)	USD	(20.518)	46
AMERIPRISE FINANC. /WH.I	(2.234)	USD	(323.662)	(4.410)
AMERISOURCEBERGEN CORP	2.519	USD	236.333	(1.749)
AMETEK INC	(7.499)	USD	(461.788)	1.292
AMORE PACIFIC CORP (NEW)- USD EQUIV	(464)	USD	(117.600)	176
AMP LTD	(210.283)	AUD	(1.133.425)	0
AMPHENOL CORPORATION -A-	187	USD	14.328	248
AMPLIFON SPA/AFTER SPLIT	(133)	EUR	(1.615)	0
AMS AG	(5.561)	CHF	(387.880)	0
ANA HOLDINGS INC	6.722	JPY	2.544.277	0
ANADARKO PETROL.CORP.	(846)	USD	(38.637)	42
ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT	(11)	TRY	(227)	0
ANALOG DEVICES INC	(786)	USD	(62.102)	401
ANDRITZ AG GRAZ	(93)	EUR	(4.815)	0
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	(37.028)	ZAR	(11.948.565)	0
ANGLO AMERICAN PLC	(24.633)	GBP	(308.528)	0
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	(103)	ZAR	(13.709)	0
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	(11.925)	EUR	(1.213.965)	0
ANHUI CONCH CEMENT CO -H-	106.961	HKD	3.101.869	1.370
ANIMA HOLDING S.P.A.	(5.110)	EUR	(35.106)	0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	36.512	USD	439.239	4.858
ANSALDO STS SPA	1.544	EUR	17.910	0
ANSELL LTD	(5.721)	AUD	(125.690)	0
ANSYS INC	(1.949)	USD	(252.493)	(2.951)
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	(97.784)	HKD	(2.620.611)	0
ANTERO RESOURCES CORPORATION	3.564	USD	73.490	(255)
ANTHEM INC	3.359	USD	625.479	7.585
ANTOFAGASTA PLC	(43.458)	GBP	(411.113)	0
ANZ BANKING GROUP	(1.905)	AUD	(56.445)	0
AON PLC	(1.289)	USD	(178.101)	1.412
AOYAMA TRADING CO LTD	(648)	JPY	(2.491.560)	0
AOZORA BANK LTD	(100.267)	JPY	(42.513.208)	0
APA GROUP - STAPLED SECURITY	(36.013)	AUD	(310.432)	0
APACHE CORP.	14.234	USD	704.298	8.791
APERAM SA	(3.390)	EUR	(139.210)	0
APL HOSP /REIT	3.671	USD	67.767	1.194
APPLE INC	6.253	USD	930.009	(23.656)
APPLIED MATERIALS INC	27.294	USD	1.209.397	(54.805)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
APTARGROUP INC	1.039	USD	84.086	(326)
AQUA AMERICA INC	(154)	USD	(5.141)	8
ARAMARK	1.715	USD	68.360	98
ARB CORPORATION	(5.864)	AUD	(89.895)	0
ARC RESOURCES LTD	1.028	CAD	17.671	148
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	(21.382)	MXN	(2.829.908)	(443)
ARCADIS NV	19.797	EUR	342.191	0
ARCELIK AS	(39.543)	TRY	(1.028.118)	0
ARCELORMITTAL SA	892	EUR	19.798	0
ARCH CAPITAL GP LTD BERMUDA	(1.853)	USD	(180.223)	3.336
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	(3.068)	USD	(129.408)	(1.018)
ARCONIC INC	5.971	USD	148.021	(6.592)
ARES MANAGEMENT LP /LP	1.528	USD	28.268	6
AREZZO INDUSTRIA E COMERCIO	2.464	BRL	91.168	0
ARISTA NETWORKS INC	61	USD	9.107	(328)
ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	104.504	AUD	2.116.206	0
ARKEMA	3.174	EUR	305.275	0
AROUNDTOWN	(13.275)	EUR	(66.375)	0
ARRIS INTERNATIONAL LIMITED	31.356	USD	876.714	(13.198)
ARROW ELECTRONICS INC.	(2.524)	USD	(205.176)	6.308
ARYZTA AG /NAM.	(2.796)	CHF	(86.900)	0
ASAHI GROUP HD --- SHS	(34.684)	JPY	(156.043.316)	0
ASAHI KASEI CORP	9.555	JPY	12.082.298	0
ASCENTIAL PLC	(1.925)	GBP	(6.911)	0
ASELSAN A.S.	178.301	TRY	4.289.922	0
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	19.473	USD	1.265.161	(37.963)
ASHMORE GROUP PLC	359	GBP	1.292	0
ASHTEAD GROUP PLC	15.052	GBP	245.197	0
ASIA CEMENT CORP USD EQUIV	(50.095)	USD	(44.297)	(18)
ASICS CORP.	12.621	JPY	25.330.347	0
ASKUL CORP TOKYO	604	JPY	2.041.520	0
ASM PACIFIC TECHNOLOGY LTD	57.773	HKD	5.840.850	(740)
ASML HOLDING NV	(1.374)	EUR	(176.078)	0
ASOS PLC	(281)	GBP	(16.236)	0
ASR NEDERLAND NV	(3.012)	EUR	(96.233)	0
ASSECO POLAND S.A.	10.285	PLN	465.088	0
ASSOCIATED BANC-CORP	5.893	USD	141.137	1.473
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2.086	GBP	61.829	0
ASSORE LIMITED	1.901	ZAR	405.864	0
ASSURA PLC	766	GBP	491	0
ASSURANT INC	(356)	USD	(37.476)	74
ASSURED GUARANTY LTD	(320)	USD	(14.403)	(27)
ASTELLAS PHARMA INC	133.100	JPY	187.404.800	0
ASTM SPA	502	EUR	9.262	0
ASTRAZENECA PLC	(14.948)	GBP	(682.974)	0
ASUSTEK COMPUTER USD EQUIV	(35.223)	USD	(327.791)	(129)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ASX LIMITED	(227)	AUD	(11.872)	0
AT & T	38	USD	1.482	(1)
ATCO LTD - CL I NON VOTING	10	CAD	464	0
ATEA ASA	4.003	NOK	386.290	0
ATHENAHEALTH INC	(7.030)	USD	(972.390)	92.586
ATLANTIA SPA	(4.828)	EUR	(124.031)	0
ATLAS COPCO AB	466	SEK	136.352	0
ATLASSIAN CORPORATION PLC -A-	(339)	USD	(12.143)	432
ATMOS ENERGY CORP	(1.703)	USD	(147.752)	69
ATOS ACT.	(3.218)	EUR	(413.352)	0
ATRESMEDIA CORP MEDIOS COM SA	(19.765)	EUR	(196.069)	0
ATRIUM EURO RE	8.502	EUR	33.583	0
ATRIUM LJUNGB SHS -B-	6.447	SEK	888.397	0
ATTENDO AB	772	SEK	78.358	0
AU OPTRONICS CORP USD EQUIV	55.366	USD	22.370	8
AURIZON HLDGS --- SHS	9.264	AUD	46.505	0
AURUBIS AG	(5.353)	EUR	(402.974)	0
AUSNET SVCS	34.331	AUD	56.131	0
AUSTEVOLL SEAFOOD ASA	41.211	NOK	2.884.770	0
AUTO TRADER GR	(6.182)	GBP	(23.659)	0
AUTODESK INC.	(642)	USD	(71.127)	944
AUTOGRILL SPA	(92)	EUR	(923)	0
AUTOLIV INC	(3.836)	USD	(415.746)	4.992
AUTOMATIC DATA PROCES.	(3.690)	USD	(438.778)	(8.208)
AUTOMOTIVE HLDG GRP	(15.238)	AUD	(58.362)	0
AUTONATION INC	(25.654)	USD	(1.087.217)	9.032
AUTOZONE INC	(1.688)	USD	(911.216)	(48.254)
AVALONBAY COMMUNITIES INC.	(93)	USD	(17.889)	(411)
AVANZA BANK HOLDING AB	3.516	SEK	1.171.180	0
AVEO GROUP - STAPLED SECURITY	31.254	AUD	75.947	0
AVERY DENNISON CORP	(1.425)	USD	(132.425)	(1.864)
AVEVA GROUP	517	GBP	10.257	0
AVI LTD	(517)	ZAR	(50.666)	0
AVICHINA INDUST.&TECHN/-H-	(47.663)	HKD	(227.829)	61
AVNET INC	1.080	USD	41.450	150
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1.239	USD	39.029	(553)
AXIARE PATRIM	(292)	EUR	(4.606)	0
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	120	USD	7.750	(131)
AYGAZ	75.939	TRY	1.224.137	0
AZBIL CORP	475	JPY	2.068.625	0
AZIMUT HOLDING SPA	2.380	EUR	45.077	0
B2GOLD CORP	46.311	CAD	144.953	(4.953)
B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO	(50.033)	BRL	(1.025.176)	0
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP	10.763	GBP	90.894	0
BAE SYSTEMS PLC	(8.670)	GBP	(52.150)	0
BAIC MOTOR CORPORATION LTD /H	(82.074)	HKD	(574.518)	315

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
BAKER HUGHES A GE COMPANY	5.428	USD	200.239	7.437
BAKKAFROST	(615)	NOK	(189.974)	0
BALL CORP.	(11.566)	USD	(484.615)	6.993
BALOISE HOLDING/NAMEN	1.390	CHF	216.006	0
BANCA IFIS SPA	6.250	EUR	248.125	0
BANCA MEDIOLANUM	(1.268)	EUR	(9.371)	0
BANCO BPI SA /NOM.	1.488	EUR	1.577	0
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	(2.385.513)	EUR	(575.863)	0
BANCO DO BRASIL SA	(1)	BRL	(29)	0
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	(85)	PLN	(6.035)	0
BANK MILLENNIUM SA	(1.547)	PLN	(11.927)	0
BANK OF AMERICA CORP	(15.087)	USD	(363.898)	6.278
BANK OF CHINA LTD -H-	(211.851)	HKD	(815.626)	0
BANK OF CHONGQING CO LTD /H	(1.880)	HKD	(12.728)	0
BANK OF COMMUNICATIONS CO -H-	195.482	HKD	1.131.841	0
BANK OF HAWAII CORP	113	USD	9.455	(10)
BANK OF NOVA SCOTIA	5.736	CAD	445.515	(691)
BANK OF NY MELLON CORP SHS	(5.815)	USD	(308.369)	3.078
BANK OF QUEENSLAND LTD	(9.868)	AUD	(118.909)	0
BANK OF THE OZARKS INC	(8.773)	USD	(378.555)	35.220
BANK ZACHODNI WBK SA WROCLAW	(392)	PLN	(148.980)	0
BANKIA S.A.	20.143	EUR	86.252	0
BANKINTER SA	45.387	EUR	373.898	0
BANKUNITED INC	(2.112)	USD	(72.695)	1.117
BANREGIO GRUPO FINANCIERO SAB	22.028	MXN	2.570.227	(333)
BANRISUL PNB -B-/PREF	(14.213)	BRL	(207.936)	0
BAPCOR --- SHS	1.896	AUD	10.712	0
BARCLAYS AFRICA -SHS-	(42.343)	ZAR	(6.122.798)	0
BARCLAYS PLC	10.640	GBP	21.599	0
BARCO NV	2.082	EUR	176.158	0
BARLOWORLD LTD	53.513	ZAR	6.346.107	0
BARRICK GOLD CORP	1.489	USD	25.179	860
BASF NAMEN-AKT.	10.222	EUR	823.791	0
BAXTER INTL INC	17.687	USD	1.069.710	(26.868)
BAYER AG	4.801	EUR	514.427	0
BAYER.WARENV.LANDWIRT.GEN.-NOM	81	EUR	2.531	0
BB SEGURIDADE	3.402	BRL	93.385	0
BB&T CORPORATION	(1.219)	USD	(57.683)	(522)
BBA AVIATION PLC	2.705	GBP	8.107	0
BCA POPOLARE EMILIA ROMAGNA	(126.897)	EUR	(590.325)	0
BCE INC	(1.545)	CAD	(90.413)	0
BCO BILBAO VIZ.ARGENTARIA/NAM.	19.155	EUR	146.555	0
BCO BRADESCO SA /PREF.	86.744	BRL	2.618.801	0
BEACH ENERGY	47.287	AUD	32.155	0
BEAZLEY PLC	11.629	GBP	59.599	0
BECHTLE AG. GAILDORF	(424)	EUR	(25.800)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
BECTON DICKINSON & CO.	(828)	USD	(166.759)	1.832
BED BATH & BEYOND INC.	(36.235)	USD	(1.083.427)	(49.963)
BEIERSDORF A.G.	(5.249)	EUR	(486.582)	0
BEIJER ALMA AB	64	SEK	15.104	0
BEIJING CAP INT AIRPORT H	(46.391)	HKD	(568.754)	238
BEIJING ENTERPRISES HLD LTD	(64.702)	HKD	(2.685.133)	0
BEIJING ENTERPRISES WATER GP	54.634	HKD	353.482	(140)
BELLWAY PLC	10.452	GBP	333.419	0
BEMIS CO INC	10.901	USD	461.875	(18.838)
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	(9.241)	AUD	(102.760)	0
BENI STABILI SPA	(28.514)	EUR	(19.247)	0
BERENDSEN PLC	3.156	GBP	40.239	0
BERKELEY GROUP HOLDINGS	11.329	GBP	396.062	0
BERKSHIRE HATHAWAY - B	(15)	USD	(2.625)	(39)
BERRY GLOBL GRP REGISTERED SHS	600	USD	33.648	55
BEST BUY CO INC.	17.912	USD	1.044.986	53.993
BGEO GROUP	1.115	GBP	38.434	0
BGF RETAIL CO.. LTD.	320	USD	26.434	(545)
BHP BILLITON LTD	(32.892)	AUD	(850.258)	0
BIC	(6.122)	EUR	(606.507)	0
BIDVEST GROUP LTD	(43)	ZAR	(7.211)	0
BILFINGER SE	(4.876)	EUR	(168.490)	0
BILIA AB	49.877	SEK	3.890.406	0
BILLERUDKORSNAS AB	(1.299)	SEK	(165.882)	0
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	(2.353)	TRY	(161.416)	0
BIOGAIA AB B	113	SEK	34.013	0
BIOGEN INC	402	USD	116.415	1.688
BIO-RAD LABORATORIES A	(219)	USD	(51.603)	270
BK OF EAST ASIA LTD	150.569	HKD	5.021.476	(1.928)
BK POLSKA KASA OPIEKI PEKAO	(179)	PLN	(22.876)	0
BKW AG	3.554	CHF	195.825	0
BLACKBAUD	(9.764)	USD	(901.608)	2.839
BLACKBERRY LTD SHS	41.011	USD	384.683	(23.493)
BLACKMORES LTD	79	AUD	6.992	0
BLACKROCK INC	175	USD	74.643	(1.042)
BLACKSTONE GROUP LP	871	USD	29.135	(83)
BLK KNT FIN	(3.281)	USD	(139.443)	971
BLOCK INC. H+R	5.816	USD	177.388	1.670
BLUE BUFFALO PET PRODUCTS INC	15	USD	336	(2)
BLUEBIRD BIO INC	410	USD	38.643	(1.788)
BLUESCOPE STEEL LTD	5.365	AUD	70.711	0
BMW-BAYER.MOTORENWERKE	10.457	EUR	812.613	0
BNP PARIBAS	(3.684)	EUR	(241.560)	0
BOARDWALK PIPELINE PARTNERS LP	12.438	USD	208.212	(6.942)
BOC AVIATION PTE LTD	(1.942)	HKD	(78.845)	0
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	25.057	HKD	964.695	160

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
BODYCOTE PLC	(18.103)	GBP	(164.737)	0
BOEING CO	4.236	USD	1.027.061	122.016
BOK FINANCIAL CORPORATION	(476)	USD	(40.493)	368
BOLIDEN AB	(27.554)	SEK	(6.987.694)	0
BOLLORE SA	(97.704)	EUR	(383.000)	0
BOLSA MEXICANA SHS A	6.809	MXN	208.219	(27)
BOOHOO.COM PLC	30.812	GBP	72.562	0
BOOZ ALLEN HAMILTON	(96)	USD	(3.293)	(13)
BORAL LTD	(20.250)	AUD	(140.130)	0
BORG WARNER INC	(5.941)	USD	(277.682)	(5.336)
BORREGAARD ASA	24.020	NOK	2.365.970	0
BORYSZEW SA	77.980	PLN	849.982	0
BOSKALIS WESTMINSTER	(8.722)	EUR	(263.622)	0
BOSTON PROPERTIES	3.807	USD	460.304	4.593
BOSTON SCIENTIFIC CORP.	11.962	USD	318.428	(3.848)
BOUYGUES	469	EUR	16.999	0
BOVIS HOMES GROUP PLC	(2.423)	GBP	(24.497)	0
BP PLC	(400.294)	GBP	(1.784.511)	0
BR MALLS PARTICIPAES SA	4.029	BRL	53.183	0
BR PET HLDS	(50.277)	HKD	(102.062)	0
BR PROPERTIES	832	BRL	8.112	0
BRADESPAR SA BRASIL/PREF.	(11.100)	BRL	(256.188)	0
BRAIT SE	(3.535)	ZAR	(222.387)	0
BRAMBLES LTD	(113.298)	AUD	(1.046.874)	0
BRASKEM SA -A-/PREF.	4.869	BRL	181.662	0
BRAVIDA HOLDING AB	592	SEK	35.846	0
BREMBO SPA	37.610	EUR	488.930	0
BREVILLE GROUP LTD	603	AUD	6.060	0
BRF --- SHS	(42.812)	BRL	(1.580.619)	0
BRICKWORKS LTD	(2.375)	AUD	(31.350)	0
BRIDGESTONE CORP	(16.675)	JPY	(77.655.475)	0
BRIGHT FAMILY SOL	(561)	USD	(44.325)	152
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	132.200	HKD	2.604.340	(1.354)
BRISTOL MYERS SQUIBB CO	(548)	USD	(31.181)	(472)
BRITISH AMERICAN TOBACCO (25P)	(82)	GBP	(3.865)	0
BRITVIC PLC	11.088	GBP	79.168	0
BRIXMOR PROP GR /REIT	(13.536)	USD	(265.170)	(746)
BROADCOM LIMITED	363	USD	89.538	(1.704)
BROOKFIELD INFR./PARTNERSHIP	189	USD	7.647	(28)
BROOKFIELD RENEWABLE LP EQ CAD	(853)	CAD	(35.911)	(90)
BROTHER INDUSTRIES LTD	1.482	JPY	4.179.240	0
BROWN & BROWN INC	(551)	USD	(24.575)	(56)
BRP INC SUB VTG SHS	1.951	CAD	77.942	691
BRUKER CORP	(36)	USD	(1.032)	1
BRUNELLO CUCINELLI SPA	4.318	EUR	107.086	0
BRUNSWICK CORP	8.129	USD	460.183	(13.895)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
BRWN-FRMAN CORP. B /NON-VOT***	(3.370)	USD	(166.478)	(1.307)
BS FINL SHS	(13.141)	USD	(132.753)	(5.233)
BT GROUP PLC	(132.123)	GBP	(414.206)	0
BT INVESTMENT MANAGEMENT LTD	2.017	AUD	21.703	0
BTG PACT/UNI(1BD+2BDS+1SH+2PFD)	1.835	BRL	28.718	0
BUCHER INDUSTRIES AG/NAM	(140)	CHF	(45.150)	0
BUDIMEX	702	PLN	155.142	0
BUNZL PLC	7.273	GBP	166.406	0
BURBERRY GROUP PLC	(488)	GBP	(8.350)	0
BUREAU VERITAS	(82.148)	EUR	(1.580.938)	0
BURLINGTON STORES INC	14.914	USD	1.297.965	2.700
BUWOG AG	5.470	EUR	135.847	0
BUZZI UNICEM	1.491	EUR	31.907	0
BWP TRUST UNITS	(5.296)	AUD	(15.358)	0
BWX TECHNOLOGIES INC	(8.755)	USD	(461.213)	910
BYD COMPANY LIMITED -H-	(70)	HKD	(3.409)	0
BYD ELECTRONIC CO LTD	429.949	HKD	8.487.193	0
C&C GROUP PLC	(397)	EUR	(1.215)	0
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	(6.951)	USD	(455.986)	2.216
C.I.R.CIE INDUSTRIALI RIUNITE	41.952	EUR	52.818	0
CABLE ONE INC	(44)	USD	(33.436)	(599)
CABOT CORP	5.523	USD	300.065	(6.515)
CABOT OIL+GAS INC./CL.	15.704	USD	390.558	(2.523)
CADENCE DESIGN SYSTEMS	27.410	USD	1.011.429	6.856
CAE INC	1.535	CAD	32.435	(124)
CALATLANTIC GRP SHS	(8.152)	USD	(286.135)	21.297
CALBEE INC	(8.195)	JPY	(37.492.125)	0
CALTEX AUSTRALIA LTD	(11.056)	AUD	(344.284)	0
CAMECO CORP.	(1.025)	CAD	(13.089)	60
CANADIAN APART.PROPERTIES/REIT	305	CAD	9.885	6
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	11.175	USD	883.049	(6.311)
CANADIAN PACIFIC RAILW.	907	USD	141.828	(2.088)
CANADIAN T.CORP A N-VOT.	594	CAD	84.532	(257)
CANADIAN UTILIT.LTD-A-N-VOT	592	CAD	23.425	0
CANON INC.	226	JPY	867.162	0
CANON MARKETING JAPAN INC	(12.905)	JPY	(31.436.580)	0
CAP COUNT PTY /REIT	(211.658)	GBP	(608.728)	0
CAPGEMINI SE	5	EUR	460	0
CAPITA --- SHS	(4.902)	GBP	(32.280)	0
CAPITEC BANK HOLDINGS LIMITED	1.040	ZAR	894.182	0
CARD FACTORY PLC	20.968	GBP	64.309	0
CARDINAL HEALTH INC.	167	USD	12.902	(72)
CARGOTEC -B-	8.763	EUR	452.171	0
CARL ZEISS MEDITEC AG	24	EUR	1.087	0
CARLISLE COS INC	(2.845)	USD	(277.644)	2.256
CARLSBERG AS B	(972)	DKK	(678.942)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
CARLYLE GP PARTNERSHIP UNIT LP	17.011	USD	348.726	3.239
CARMAX /WHEN ISSUED	(16.470)	USD	(1.091.138)	(700)
CARNIVAL CORP	184	USD	12.288	16
CARSALES.COM LTD	(4.062)	AUD	(50.206)	0
CARTER S INC	(243)	USD	(21.075)	304
CASEY S GENERAL STORES INC	(4.330)	USD	(462.228)	6.422
CASINO GUICHARD-PERRACH	345	EUR	17.781	0
CASIO COMPUTER CO.LTD	(5.985)	JPY	(10.820.880)	0
CASTELLUM AB GOTHENBURG	5.072	SEK	636.536	0
CATALENT INC	3.804	USD	131.999	(3.388)
CATCHER TECH CO USD EQUIV	86.231	USD	990.962	392
CATHAY FINANCIAL HLDS USD EQUIV	(48.722)	USD	(79.388)	(30)
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	(17.618)	HKD	(215.292)	45
CBRE GROUP -A-	1.060	USD	40.269	(262)
CCC SHS	(1.444)	PLN	(352.336)	0
CCL INDUSTRIES -B-/NON VOT.	3.587	CAD	214.395	(2.414)
CCR	53.351	BRL	911.235	0
CD PROJEKT SA	16.524	PLN	1.429.326	0
CDK GLOBAL INC	(2.327)	USD	(153.070)	493
CDW CORP	458	USD	29.051	(169)
CECONOMY AG	50.821	EUR	482.850	0
CEDAR FAIR LP	8.529	USD	592.254	1.524
CELANESE CORP SERIES -A-	452	USD	43.469	912
CELGENE CORP.	(1.092)	USD	(147.868)	1.119
CELLNEX TELECOM S.A.	(75.160)	EUR	(1.428.040)	0
CEMEX SAB DE CV/C.PART.(2A+1B)	354.382	MXN	6.095.370	0
CENOVUS ENERGY	(2.156)	CAD	(22.573)	(904)
CENTAMIN SHS	14.447	GBP	23.982	0
CENTENE CORP. DE	2.781	USD	220.867	(7.236)
CENTENNIAL RESOURCE DEV INC -A-	(642)	USD	(10.773)	93
CENTERPOINT ENERGY INC	13.793	USD	388.825	3.721
CENTRAL JAPAN RAILWAY CO	(2.073)	JPY	(36.795.750)	0
CENTRICA PLC	3.892	GBP	7.726	0
CENTURYLINK INC	5.220	USD	121.469	2.635
CERNER CORP	2.058	USD	132.473	(1.544)
CERVED INFORMATION SOLUTIONS	1.484	EUR	14.395	0
CGI GROUP INC./SUB.VOT. A	83	CAD	5.464	(74)
CGN POWER CO LTD	(57.864)	HKD	(123.829)	0
CHAILEASE /USD EQ	55.113	USD	158.430	63
CHALLENGER LTD	(12.382)	AUD	(159.109)	0
CHAMPION REAL ESTATE INV TRUST	177.420	HKD	1.078.714	0
CHANG HWA COMMERCIAL BK USD EQUIV	7.532	USD	4.415	1
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	483	USD	47.431	244
CHARLES SCHWAB CORP	(11.046)	USD	(473.873)	538
CHARTER COMMUNICATIONS INC	326	USD	127.763	24.794
CHARTER HALL GROUP /STAPLED	27.116	AUD	140.732	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
CHARTER HALL RETAIL /REIT	688	AUD	2.821	0
CHARTWELL RET RES TRUST UNITS	950	CAD	14.545	96
CHECK POINT SOFTWARE TECHNO	1.584	USD	167.556	(1.863)
CHEIL COMMUNICATIONS INC-UND-CFD	(298)	USD	(5.421)	(253)
CHEIL INDUSTRIES INC.	165	USD	20.504	127
CHEMOURS COMPANY CO.(THE)	684	USD	32.565	113
CHENG SHIN RUBBER IND USD EQUIV	(9.067)	USD	(18.347)	(7)
CHESAPEAKE ENERGY	(49.154)	USD	(243.804)	425
CHEUNG KONG PPTY HOLDINGS LTD	111.095	HKD	7.026.759	0
CHEVRON CORPORATION	(9.251)	USD	(1.010.117)	(40.791)
CHICONY ELECTRONICS CO-USD EQ	(27.090)	USD	(69.710)	(26)
CHIMATA GLD	(2.024)	ZAR	(85.028)	0
CHIMERA INVESTMENT CORP /REIT	6.727	USD	126.602	1.472
CHINA AGRI INDUSTRIES HOLDINGS	575.555	HKD	2.014.443	0
CHINA CITIC BK -H-	38.317	HKD	194.267	0
CHINA COMMUNICAT.SERVICES -H-	144.303	HKD	613.288	0
CHINA COMMUNICATIONS CONSTR-H-	145.513	HKD	1.516.245	0
CHINA DEV FINANCIAL HLDS USD EQUIV	(176.110)	USD	(53.133)	(18)
CHINA EASTERN AIRLINES H	147.950	HKD	636.185	(189)
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	(87.618)	HKD	(888.447)	673
CHINA EVERBRIGHT LTD	(237.952)	HKD	(4.221.268)	1.828
CHINA EVERGRANDE	166.544	HKD	3.622.332	0
CHINA GALAXY SECURITIES -H-	(402.721)	HKD	(2.774.748)	0
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	(69.109)	HKD	(1.297.867)	1.062
CHINA HONGQIAO GROUP	2.841	HKD	20.029	0
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	(2.209.762)	HKD	(8.021.436)	0
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	13.294	HKD	73.250	0
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-H-	(173)	HKD	(4.282)	0
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-USD EQ	4.684	USD	4.956	2
CHINA LONGYUAN POWER H	55.510	HKD	317.517	0
CHINA MACHINERY -SHS H -	727	HKD	3.839	0
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS	(662)	HKD	(8.831)	0
CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD	(167.478)	HKD	(2.549.015)	0
CHINA MERCHANTS BANK /-H-	(48.762)	HKD	(1.253.183)	0
CHINA MOBILE LTD	(1.564)	HKD	(130.750)	30
CHINA MOTOR CORP USD EQUIV	129.071	USD	111.566	49
CHINA NATL BLDING MATERIAL -H-	(78.351)	HKD	(373.734)	0
CHINA OVERSEAS LAND+INVESTMENT	(801.897)	HKD	(21.170.081)	10.267
CHINA PETROLEUM&CHEM CORP H	151.926	HKD	902.440	195
CHINA POWER INTL DEVELOP.LTD	(373.890)	HKD	(1.002.025)	0
CHINA RAILWAY CONSTR CORP -H-	33.279	HKD	343.439	0
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H-	(5.448)	HKD	(33.887)	0
CHINA RAILWAY SIGNAL /H	8.473	HKD	51.770	0
CHINA RESOURCES ENTERPRISE LTD	5.628	HKD	110.759	(43)
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	(52.559)	HKD	(1.550.491)	673
CHINA RESOURCES LAND	(234.875)	HKD	(5.860.131)	4.511

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	(42.624)	HKD	(635.098)	0
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H-	444.523	HKD	8.650.418	0
CHINA STATE CONSTR INT HLD LTD	(102.306)	HKD	(1.291.102)	0
CHINA STEEL CORP COMMON USD EQUIV	(1.136.786)	USD	(933.672)	(371)
CHINA TAIPING INSURANCE	(49.322)	HKD	(1.156.601)	316
CHINA TELECOM CORP LTD -H-	(190.794)	HKD	(709.754)	0
CHINA TRADITIONAL CHINESE MED	(64.539)	HKD	(267.191)	83
CHINA UNICO (HK)	(475.479)	HKD	(5.401.441)	(1.218)
CHINA VANKE -H-	7	HKD	161	0
CHINATRUST FINL HLDGS USD EQUIV	(194.069)	USD	(124.687)	(56)
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	61	USD	20.970	51
CHN HUARONG ASSET /H 144A REGS	(126.387)	HKD	(404.438)	0
CHOICE HOTEL INTERNATIONAL	537	USD	34.717	220
CHONGQING RURAL SHS-H-	133.767	HKD	770.498	0
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP	226.681	HKD	1.838.383	0
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	(1.306)	DKK	(660.836)	0
CHUBB LTD	91	USD	13.328	26
CHUGAI PHARMACEUT. CO.LTD	(123)	JPY	(545.505)	0
CHUGOKU BANK LTD	(18.386)	JPY	(29.417.600)	0
CHUGOKU ELECTR.POWER JPY 500	(30.424)	JPY	(36.782.616)	0
CHUNGHWA	283	USD	13.309	5
CHUNGHWA TELECOM CO USD EQUIV	(86.313)	USD	(291.568)	(115)
CHURCH & DWIGHT CO INC	(19)	USD	(1.014)	3
CIA BRASILEIRA /PFD	6.372	BRL	461.970	0
CIA ENERG MINAS GERAIS/PREF	(63.453)	BRL	(540.620)	0
CIA HERING	(15.200)	BRL	(326.648)	0
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS SA	25.538	BRL	1.082.300	0
CIE ENERG.SAO PAULO/PREF.-B-	(39.327)	BRL	(613.501)	0
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAM-AK	(2.791)	CHF	(229.281)	0
CIECH SA	19.251	PLN	1.112.708	0
CIELO	(48.114)	BRL	(1.255.775)	0
CIFI HOLDINGS SHS	(160.688)	HKD	(715.062)	0
CIGNA CORP.	7.218	USD	1.252.756	(1.661)
CIMAREX ENERGY CO /WHEN ISSUED	(2.263)	USD	(224.105)	(3.166)
CIMIC GROUP LTD	6.223	AUD	257.757	0
CINCINNATI FINANCIAL CORP	(1.025)	USD	(78.064)	(840)
CINEMARK HOLDINGS INC	1.252	USD	48.703	134
CINEPLEX	82	CAD	4.032	0
CINEWORLD GROUP PLC	941	GBP	6.488	0
CINTAS	126	USD	16.991	(231)
CIRRUS LOGIC INC.	11.718	USD	719.954	(30.473)
CISCO SYSTEMS INC.	(8.565)	USD	(269.369)	5.739
CIT GROUP INC	477	USD	22.729	(81)
CITIC PACIFIC LTD	(370.965)	HKD	(4.384.806)	2.850
CITIGROUP INC	(3.729)	USD	(255.250)	(1.048)
CITIZEN WATCH SHS	(7.714)	JPY	(6.333.194)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	16.408	USD	575.593	(8.217)
CITRIX SYSTEMS INC	729	USD	57.576	(2.038)
CITYCON OYJ	1.299	EUR	2.988	0
CJ CGV	75	USD	4.647	(136)
CJ CHEILJEDANG CORP- USD EQUIV	(130)	USD	(43.001)	(401)
CJ CORPORATION - USD EQUIV	3.380	USD	586.214	(13.025)
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	35.925	HKD	3.696.683	0
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	44.725	HKD	3.253.744	(573)
CLARIANT /NAMEN-AKT.	(41.152)	CHF	(925.920)	0
CLAS OHLSON AB B	9.117	SEK	1.513.422	0
CLBANCO SA INSTITUCION-13-REIT	53.904	MXN	1.672.641	91
CLEANAWAY WASTE SHS	50.970	AUD	66.516	0
CLICKS GRP	23.323	ZAR	3.481.191	0
CLINIGEN GRP SHS	(2.966)	GBP	(29.719)	0
CLOETTA -B-	(1.232)	SEK	(35.605)	0
CLOROX CO *OPA*	(78)	USD	(10.412)	12
CLOSE BROTHERS GROUP PLC	6.761	GBP	104.119	0
CLP HOLDINGS LTD	21.466	HKD	1.782.751	(550)
CME GROUP INC	5.596	USD	686.182	4.282
CMS ENERGY CORP.	6.272	USD	290.017	(951)
CN CINDA AM /H	(126.855)	HKD	(412.279)	0
CN CONCH VENT	(16.021)	HKD	(232.625)	0
CN ENERGY /H	13.311	HKD	19.035	0
CN HUISHAN DAI	59.901	HKD	25.158	0
CN INTL CAP /H	(41.825)	HKD	(519.467)	107
CN MERCHANT PT	(24.181)	HKD	(593.644)	0
CN REINSUR /H	1	HKD	2	0
CN RESO CEMENT	575.837	HKD	2.677.642	0
CNO FINL GROUP	(2.532)	USD	(57.932)	(1.909)
CNOOC LTD	(700.291)	HKD	(6.106.538)	1.793
CNP ASSURANCES	24.619	EUR	502.228	0
COBHAM PLC	(187.569)	GBP	(248.904)	0
COCA COLA ICECEK SANAYI	634	TRY	26.945	0
COCA-COLA AMATIL LTD	(8.801)	AUD	(72.520)	0
COCA-COLA CO.	(16.164)	USD	(740.958)	(7.153)
COCA-COLA EUROP PRNTR	(3.929)	USD	(169.851)	(1.265)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV L	24.698	MXN	3.741.994	(55)
COCA-COLA JP --- REGISTERED SHS	(5.228)	JPY	(17.409.240)	0
COCHLEAR LIMITED	631	AUD	90.138	0
COFACE SA	893	EUR	7.144	0
COGECO COMMUNICATIONS INC SUB	(569)	CAD	(49.560)	(622)
COGNEX CORP	(535)	USD	(50.857)	36
COGNIZANT TECHNOLOGY SOL A	(4.631)	USD	(321.021)	2.220
COHERENT INC.	(1.476)	USD	(391.140)	12.798
COLFAX	993	USD	40.991	(16)
COLGATE-PALMOLIVE CO.	3.954	USD	285.479	180

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
COLONY NORTHSTAR INC -A-	(21.148)	USD	(309.607)	1.218
COLOPLAST -B-	(8.775)	DKK	(4.738.500)	0
COLUMBIA SPORTSWEAR	9.555	USD	578.842	27.655
COM HEM HOLDING AB	5.915	SEK	697.970	0
COMCAST CORP/-A-	7.162	USD	289.703	5.220
COMERICA INC.	4.638	USD	335.374	(5.220)
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	(5.289)	AUD	(442.848)	0
COMMSCOPE HOLDING CO INC	796	USD	29.277	828
COMPAL ELECTRONICS USD EQUIV	(43.271)	USD	(28.733)	(9)
COMPASS GROUP PLC	(785)	GBP	(12.693)	0
COMPUGROUP MEDICAL SE	(191)	EUR	(9.619)	0
COMPUTER ASSOCIATES INTL INC	8.692	USD	269.800	(85)
COMPUTERSHARE LIMITED CPU	567	AUD	7.978	0
COMSYS HOLDINGS CORP	(19.514)	JPY	(44.140.668)	0
CONAGRA BRANDS INC	47.671	USD	1.632.255	5.865
CONCHO RESOURCES INC	(653)	USD	(85.060)	703
CONOCOPHILLIPS	4.686	USD	212.604	3.756
CONSOL ENERGY INC	(6.774)	USD	(113.532)	605
CONSOLIDATED EDISON INC	(477)	USD	(39.524)	(358)
CONSTELLATION SOFTWARE INC	387	CAD	259.929	2.123
CONSTR	(723)	EUR	(27.178)	0
CONTINENTAL RESOURCES INC	(1.719)	USD	(57.466)	270
COOPER COMPANIES INC.	95	USD	23.168	(176)
COOR – CFD	99	SEK	5.742	0
COPA HOLDINGS -A-	3.694	USD	463.449	(5.421)
COPART INC	548	USD	17.257	(219)
COPEL.CIA PARAN.EN.PREF. B	11.763	BRL	304.779	0
CORBION NV --- SHS	5.151	EUR	140.571	0
CORE LABORATORIES NV	(3.427)	USD	(344.516)	(631)
CORECIVIC INC /REIT	(641)	USD	(17.756)	578
CORNING INC.	27	USD	787	(23)
CORP FIN ALBA /SPLIT ISSUE	109	EUR	5.772	0
CORPORATE TRAVEL MANAGEMENT LT	2.397	AUD	53.525	0
CORTIC.AMORIM SOC.GEST.PART.	3.565	EUR	42.067	0
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	15.089	BRL	544.713	0
COSCO SHIPPING	979	HKD	9.349	(1)
COSMOS PHARMACEUTICAL CORP	1.027	JPY	24.113.960	0
COSTA GROUP HOLDINGS LTD	1.199	AUD	5.731	0
COSTAR GROUP INC	837	USD	230.635	(4.286)
COSTCO WHOLESALE CORP	610	USD	96.691	3.681
COTIVITI HOLDINGS INC	12.956	USD	557.756	5.528
COTY INC-CL A	(64.954)	USD	(1.330.258)	(52.078)
COUNTRY GARDEN HOLDINGS	1.248.675	HKD	13.635.531	0
COUNTRYSIDE PROPERTIES PLC	48.287	GBP	173.688	0
COVESTRO AG	26.812	EUR	1.759.403	0
CRACKER BARREL OLD COUNTRY ST	12	USD	1.865	(10)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
CRAMO PLC	358	EUR	8.664	0
CRANE CO	2.180	USD	164.590	(4.274)
CREDIT ACCEPTANCE CORP	248	USD	61.777	(1.238)
CREDIT SAISON CO LTD	2.194	JPY	4.660.056	0
CRH PLC	134	EUR	3.979	0
CRODA INTERNATIONAL PLC	557	GBP	20.615	0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL SHS	(2.887)	USD	(290.374)	(3.044)
CROWN RESORTS SHS	(15.930)	AUD	(202.630)	0
CRRC CORP LTD /-H-	(32.695)	HKD	(228.211)	0
CSL LTD	2.435	AUD	306.810	0
CSPC PHARMACEUT --- SHS	179.640	HKD	2.180.830	(920)
CSR LTD	19.191	AUD	75.229	0
CSX CORP.	6.370	USD	314.296	(7.659)
CTS EVENTIM AKT.	14.917	EUR	583.851	0
CUBESMART	(14.465)	USD	(356.707)	(5.815)
CUCKOO ELECTRONICS CO. LTD.	(59)	USD	(7.411)	325
CULLEN FROST BANKERS INC	(432)	USD	(39.217)	620
CUMMINS INC	65	USD	10.914	114
CURTISS-WRIGHT CORP.	(1.117)	USD	(107.701)	655
CVC BRASIL	(1)	BRL	(36)	0
CVS HEALTH CORP	(111)	USD	(8.872)	(136)
CYBERAGENT INC	(57.974)	JPY	(197.981.210)	0
CYBG PLC	3.588	GBP	9.587	0
CYPRESS SEMICONDUCTORS	(7.015)	USD	(99.613)	3.184
CYRELA BRAZIL REALTY SA	(9.652)	BRL	(118.140)	0
CYRUSONE INC /REIT	(3.126)	USD	(186.653)	(3.157)
D S SMITH PLC	101.637	GBP	490.703	0
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD USD EQUIV	1.033	USD	84.685	(701)
DAEWOO INTERNATIONAL CORP USD EQUIV	(41)	USD	(861)	5
DAEWOO SECURITIES CO LTD USD EQUIV	5.865	USD	56.890	932
DAH SING BANKING GROUP LTD	(1.219)	HKD	(20.406)	0
DAH SING FINANCIAL HLDS LTD	(1.644)	HKD	(90.831)	11
DAICEL --- SHS	50.111	JPY	72.109.729	0
DAIDO STEEL CO LTD	1.847	JPY	1.241.184	0
DAIFUKU CO LTD	2.072	JPY	7.904.680	0
DAI-ICHI LIFE HLDGS SHS	(43.214)	JPY	(82.581.954)	0
DAIICHI SANKYO CO LTD	39	JPY	93.912	0
DAIICHIKOSHO CO LTD	(1.186)	JPY	(6.297.660)	0
DAIKIN INDUSTRIES LTD	85	JPY	994.500	0
DAIKYO INC	16.660	JPY	3.848.460	0
DAILY MAIL & GENERAL TR A	(55.934)	GBP	(356.020)	0
DAIMLER AG / NAMEN-AKT.	13.812	EUR	818.913	0
DAITO TRUST CONSTRUCT.	7.391	JPY	137.768.240	0
DANAHER CORP	1.219	USD	99.336	(607)
DANONE	(19.418)	EUR	(1.225.082)	0
DANSKE BANK AS	155	DKK	39.448	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
DAOU TECHNOLOGY INC	(2)	USD	(40)	(0)
DARDEN RESTAURANTS	7.456	USD	625.409	(9.495)
DASSAULT AVIATION SA	(122)	EUR	(154.495)	0
DASSAULT SYSTEMES SA	(1.354)	EUR	(112.233)	0
DATALOGIC SPA	130	EUR	3.380	0
DAVIDE CAMPARI - MILANO SPA	(92)	EUR	(575)	0
DAVITA INC --- SHS	(429)	USD	(27.791)	45
DB MEX REIT S.11	13.215	MXN	438.342	200
DBV TECHNOLOGIES	6.626	EUR	502.185	0
DC CHEMICAL CO LTD- USD EQUIV	3.588	USD	295.747	17.588
DCC	412	GBP	27.460	0
DCP MIDSTREAM LP/UNITS	(2.064)	USD	(70.238)	1.176
DCT INDUSTRIAL TRUST INC /REIT	(402)	USD	(22.649)	(114)
DE LONGHI SPA	(1.725)	EUR	(47.921)	0
DECHRA PHARMACEUTICALS PLC	182	GBP	3.231	0
DEERE & CO.	3.996	USD	512.607	1.528
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	(4.141)	USD	(374.429)	2.129
DELTA AIR LINES	6.021	USD	297.197	(7.076)
DELTA ELECTRONICS USD EQUIV	(202.247)	USD	(1.075.032)	(433)
DENA CO LTD TOKYO	1.483	JPY	3.596.275	0
DENSO CORP	13.319	JPY	70.670.614	0
DENTSPLY SIRONA INC	133	USD	8.250	(16)
DENTSU INC TOKYO	(30.786)	JPY	(158.855.760)	0
DERWENT LONDON PLC REIT	(208)	GBP	(5.924)	0
DETOUR GOLD CORPORATION	6.349	CAD	99.552	5.715
DEUTSCHE BANK AG /NAM.	(24.817)	EUR	(374.489)	0
DEUTSCHE BOERSE AG /NAM.	4.314	EUR	381.401	0
DEUTSCHE EUROSHOP/NAMENAKT.	1.795	EUR	63.139	0
DEUTSCHE LUFTHANSA/NAM.	17.048	EUR	309.847	0
DEUTSCHE TELEKOM /NAM.	(67.846)	EUR	(1.047.881)	0
DEUTSCHE WOHNEN AG	2.764	EUR	92.553	0
DEVON ENERGY CORP.(NEW)	4.439	USD	147.863	(200)
DEXCOM INC	(12.778)	USD	(851.143)	34.543
DEXUS PROPERTY GROUP	(1.944)	AUD	(18.235)	0
DFDS A/S	24	DKK	8.599	0
DGB FINANCIAL GROUP	(572)	USD	(6.111)	(194)
DIAGEO PLC	7.347	GBP	179.891	0
DIAMONDBACK ENERGY INC SHS	(1.702)	USD	(163.188)	570
DIASORIN AZ	(2.566)	EUR	(188.858)	0
DIC CORP	5.250	JPY	21.971.250	0
DICK S SPORTING GOODS INC	(81)	USD	(3.025)	(9)
DIGITAL RLTY TR INC	(2.889)	USD	(333.217)	(8.378)
DIGNITY PLC	(316)	GBP	(8.049)	0
DIOS FASTIGHETER	13.800	SEK	651.360	0
DIPLOMA PLC	15.644	GBP	168.955	0
DIRECT ENERGIE - SHS	6.244	EUR	302.054	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
DISCO CORP.	259	JPY	5.068.630	0
DISCOVER FIN SVC	5.393	USD	328.649	(14.836)
DISCOVERY SHS	(22.588)	ZAR	(3.169.322)	0
DISH NETWORK CORP -A-	1.413	USD	90.474	(545)
DISTRIBUIDORA INTL	(31.921)	EUR	(182.045)	0
DIXONS CARP	(105)	GBP	(282)	0
DKSH HOLDING LTD SHS	(4.407)	CHF	(335.593)	0
DMG MORI AKTIENGESELLSCHAFT	(1.661)	EUR	(82.934)	0
DMG MORISEIKI J	(8.579)	JPY	(15.733.886)	0
DNB ASA	466	NOK	72.044	0
DNO -A- SHS	(381.177)	NOK	(3.491.581)	0
DOLBY LABORATORIES INC -A-	(1.289)	USD	(66.706)	2.635
DOLLAR GENERAL CORPORATION	(6.991)	USD	(525.444)	(4.527)
DOLLAR TREE INC	(2.575)	USD	(185.606)	(3.562)
DOLLARAMA INC	282	CAD	34.367	62
DOMETIC GROUP AB	6.391	SEK	436.186	0
DOMINION ENERGY INC	(756)	USD	(58.348)	(275)
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES LTD	577	AUD	30.760	0
DOMINO S PIZZA GROUP PLC	(29.038)	GBP	(77.357)	0
DOMINO S PIZZA INC	5.368	USD	1.001.132	3.451
DON QUIJOTE HOLDINGS CO LTD	1.147	JPY	4.605.205	0
DONALDSON CO ***	(106)	USD	(5.034)	(53)
DONG ENERGY A/S	(1.010)	DKK	(305.929)	0
DONGBU HITEK CO LTD	583	USD	9.981	(100)
DONGBU INSURANCE CO LTD- USD EQUIV	1.143	USD	81.850	(603)
DONGFENG MOTOR -H-	(289.954)	HKD	(2.774.860)	0
DONGKUK STEEL MILL CO LTD USD EQUIV	53.480	USD	686.090	(596)
DONGWON INDUSTRIES	5	USD	1.238	10
DOOSAN CORPORATION- USD EQUIV	108	USD	11.393	(179)
DOUGLAS EMMETT /REIT	498	USD	19.053	245
DOWA HOLDINGS CO LTD	84.734	JPY	75.667.462	0
DOWNER EDI LTD	3.772	AUD	23.990	0
DR PEPPER SNAPPLE GRP INC	1.198	USD	109.210	(972)
DRAX GROUP PLC	5.842	GBP	18.601	0
DST SYSTEMS INC	2.015	USD	110.624	1.177
DSV	4.582	DKK	1.858.459	0
DTE ENERGY COMPANY	3.093	USD	331.137	2.280
DUERR AG	3.387	EUR	348.861	0
DUFRY AG BASEL	(1.574)	CHF	(242.553)	0
DUKE ENERGY	864	USD	73.544	1.132
DUKE REALTY CORP	4.876	USD	139.405	3.757
DULUXGROUP	(5.950)	AUD	(39.211)	0
DUN AND BRADSTREET CORP	(2.474)	USD	(274.020)	2.715
DUNELM GROUP PLC	(8.789)	GBP	(52.910)	0
DUNKIN BRANDS GROUP INC	2.857	USD	151.507	(57)
DURATEX	(34.983)	BRL	(277.065)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
DYCOM INDUSTRIES INC.	(35)	USD	(3.171)	(27)
E TRADE FINANCIAL CORP	(2.536)	USD	(103.976)	2.326
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS USD EQUIV	(307)	USD	(196)	(0)
EAGLE MATERIALS INC	182	USD	17.126	(99)
EAST JAPAN RAILWAY CO	12.659	JPY	131.020.650	0
EASTMAN CHEMICAL CO	2.643	USD	219.792	(551)
EAST-WEST BANCORP	175	USD	9.972	(48)
EASYJET PLC	49.883	GBP	616.554	0
EATON CORPORATION PUBLIC LTD	3.514	USD	274.971	(1.786)
EATON VANCE CORP/N.VOT.	698	USD	34.265	(169)
EBARA CORP.	(11.170)	JPY	(36.134.950)	0
EBAY INC	6.412	USD	229.101	(3.783)
EBOS GROUP LTD	952	NZD	17.222	0
EBRO FOODS --- SHS	4.180	EUR	84.520	0
ECHOSTAR CORP-A-	6.119	USD	371.607	(4.507)
ECLAT TEXTILE CO LTD	111	USD	1.277	1
ECOLAB INC.	(3.209)	USD	(422.529)	4.005
ECORODOVIAS	47.991	BRL	513.024	0
EDENRED	(4.280)	EUR	(95.016)	0
EDF	(178)	EUR	(1.526)	0
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5.085	USD	367.137	(3.715)
EDP ENERGIAS DO BRASIL SA	51.051	BRL	733.603	0
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	(18.978)	EUR	(56.934)	0
EDWARDS LIFESCIENCES	2.905	USD	334.598	(2.447)
EIFFAGE SA	(3.492)	EUR	(285.820)	0
EL TOWERS AZ	(24)	EUR	(1.241)	0
ELDORADO GOLD	6.830	CAD	18.031	(1.862)
ELECTROCOMPONENTS	8.744	GBP	54.213	0
ELECTROLUX AB B	3.317	SEK	916.155	0
ELECTRONIC ARTS	7.086	USD	827.220	21.456
ELEKTA AB	956	SEK	74.329	0
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	(395)	CAD	(3.729)	0
ELEMENTIA SA DE CV	(2.755)	MXN	(70.528)	(8)
ELEMENTIS PLC	577	GBP	1.710	0
ELETROB.EL.BRASIL./PREF. B	10.676	BRL	177.969	0
ELITE MATERIAL CO LTD	203.034	USD	1.005.250	394
ELLIE MAE	888	USD	77.451	(7.547)
E-MART CO LTD	(151)	USD	(34.288)	(628)
EMBRAER SA	13.144	BRL	207.281	0
EMCOR GROUP INC.	373	USD	25.178	985
EMERA INC	316	CAD	14.662	(41)
EMERSON ELECTRIC CO.	472	USD	28.136	(360)
EMLAK KONUT GAYR. REIT/IPO	(4.035)	TRY	(12.831)	0
EMMI AG / NAM.	20	CHF	13.630	0
EMPIRE CO LTD -A-/NON VOTING	464	CAD	9.401	(22)
EMS CHEMIE HOLDING AG	(256)	CHF	(172.288)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ENABLE MID /LP	13.700	USD	197.417	(3.979)
ENAGAS	(763)	EUR	(18.224)	0
ENAV S.P.A.	(914)	EUR	(3.544)	0
ENB.ENERGY PARTNERS/UNTS	1.720	USD	26.901	(385)
ENBRIDGE INC.	45	CAD	2.326	(5)
ENBRIDGE INCOME FUND HOLDINGS	257	CAD	8.234	75
ENCANA CORP	(7.103)	USD	(71.456)	1.788
ENEL	(10.322)	EUR	(49.793)	0
ENERGA S.A.	145.400	PLN	1.850.942	0
ENERGEN CORP	(3.529)	USD	(188.025)	(106)
ENERGY TRANSFER PARTNERS/LP	(17.108)	USD	(353.965)	(8.041)
ENERSYS INC	8.639	USD	624.341	(2.022)
ENGIE	(29.211)	EUR	(397.416)	0
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	5.877	BRL	205.695	0
ENI SPA ROMA	(105.373)	EUR	(1.408.837)	0
ENLINK MID PART /PU	(1.383)	USD	(22.861)	840
ENN ENERGY HOLDINGS	21.062	HKD	1.111.021	(809)
ENSTAR GROUP LTD	(611)	USD	(123.789)	1.146
ENTERGY CORP.	1.073	USD	82.321	1.395
ENTERPRISE PRODUCTS PARTNERS	(8.096)	USD	(220.211)	3.076
ENTRA ASA /REIT	3.506	NOK	366.377	0
ENVISION HEALTHCARE CORP	(17.640)	USD	(995.425)	42.058
EOG RESOURCES INC.	(3.259)	USD	(310.061)	(805)
EPAM SYSTEMS	(6)	USD	(516)	(0)
EPISTAR CORP USD EQ	40.547	USD	38.808	17
EQT	(7.512)	USD	(478.514)	2.723
EQT MIDSTREAM PARTNERS LP	137	USD	10.649	191
EQUATORIAL ENERGIA	(17.826)	BRL	(1.010.734)	0
EQUIFAX INC	(932)	USD	(135.550)	(384)
EQUINIX INC /REIT	(522)	USD	(235.281)	(7.188)
EQUITY LIFESTYLE	178	USD	15.539	52
EQUITY RESIDENTIAL SBI	8	USD	544	10
EREGLI DEMIR CELIK	(43.954)	TRY	(344.599)	0
ERG SPA MILANO	48.317	EUR	583.669	0
ERICSSON TEL. B	(43.632)	SEK	(2.288.498)	0
ESSENT GROUP LTD	47	USD	1.806	17
ESSENTRA SHS	(12.115)	GBP	(64.876)	0
ESTACIO PART	(37.991)	BRL	(775.016)	0
ESTEE LAUDER CO -A-	(2.685)	USD	(265.788)	(504)
ETAB COLRUYT	(6.466)	EUR	(306.359)	0
EULER HERMES GROUP SA	3	EUR	303	0
EURAZEO ACT.	(9.901)	EUR	(682.674)	0
EUROCASH SA	(12.164)	PLN	(432.187)	0
EUROCOMMERCIAL---SHARES	4.967	EUR	169.797	0
EUROFINS SCIENTIFIC SA	155	EUR	72.912	0
EUROMONEY INSTITUT.INVESTOR	2.729	GBP	30.292	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
EURONAV NV ANVERS	166	EUR	1.121	0
EURONET WORLDWIDE INC	(905)	USD	(87.432)	(949)
EURONEXT NV	(271)	EUR	(13.387)	0
EUSKALTEL S.A.	1.425	EUR	12.303	0
EUTELSAT COMMUNICATIONS PARIS	489	EUR	11.193	0
EVA AIRWAYS CORP USD EQUIV	29.365	USD	14.247	5
EVENT HOSPITAL AND ENT	(217)	AUD	(2.854)	0
EVERSOURCE ENERGY	(2.407)	USD	(146.322)	(718)
EVN AG	2.931	EUR	37.912	0
EVOLUTION MINING LTD	14.897	AUD	33.071	0
EVOTEC AG	39.187	EUR	478.081	0
EVRAZ	4.568	GBP	10.872	0
EXACT SCIENCES CORP	(1.563)	USD	(60.644)	(2.298)
EXELIXIS INC	28.562	USD	774.316	(12.044)
EXELON CORP	(649)	USD	(24.883)	(19)
EXOR HOLDING N.V.	(8.570)	EUR	(433.642)	0
EXPEDIA INC DEL	(2.536)	USD	(396.808)	1.607
EXPEDITORS INTL WASH.	(1.864)	USD	(109.752)	1.375
EXPERIAN PLC	(36.648)	GBP	(552.285)	0
EXPRESS SCRIPTS HLD	1.571	USD	98.407	146
EXTRA SPACE STORAGE INC	(292)	USD	(23.214)	(141)
EXXARO RESOURCES LIMITED	24.740	ZAR	2.694.681	0
EXXON MOBIL CORP	(2.657)	USD	(212.666)	156
EZ TEC EMPREENDIMENTOS E PAR	(9.453)	BRL	(185.090)	0
F5 NETWORKS INC.	154	USD	18.596	396
FABEGE AB	29.778	SEK	4.749.591	0
FACEBOOK INC -A-	4.975	USD	842.019	18.423
FACTSET RESEARCH SYSTEM INC	(5.822)	USD	(973.555)	(8.142)
FAGERHULT AB	2.074	SEK	220.363	0
FAIR ISAAC CORP	(621)	USD	(88.524)	1.822
FAMILYMT UNY H --- SHS	(19.747)	JPY	(122.036.460)	0
FAR EAST HORIZON	(40.680)	HKD	(270.929)	0
FAR EASTERN TEXTILE USD EQUIV	(549.830)	USD	(452.500)	(155)
FAR EASTONE TELECOM. CO USD EQUIV	35.037	USD	84.706	32
FAST RETAILING CO LTD	3.934	JPY	130.294.080	0
FASTENAL	1.113	USD	47.814	(663)
FASTIGHETS BALDER AB B	16.314	SEK	3.352.527	0
FAURECIA SA	26.386	EUR	1.238.295	0
FE NEW N.V.	(2.208)	USD	(232.260)	182
FED.REALTY INV.TR./SBI	(2.598)	USD	(344.573)	260
FEDEX CORP.	484	USD	100.687	315
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	9.810	USD	42.073	16
FERGUSON PLC	16.005	GBP	724.546	0
FERROVIAL SA	(29.127)	EUR	(531.422)	0
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES N.V	13.383	EUR	136.507	0
FIBRIA	20.771	BRL	687.105	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
FID NAT FIN-A- FNF GROUP	(1.195)	USD	(58.388)	(53)
FIDELITY NATL INFORM SERV	(4.905)	USD	(447.434)	(5.030)
FIELMANN AG	(82)	EUR	(5.566)	0
FIFTH THIRD BANCORP	(33)	USD	(881)	(5)
FIH MOBILE	(80.531)	HKD	(210.186)	0
FILA KOREA	(116)	USD	(7.674)	24
FINCANTIERI S.P.A.	(16.155)	EUR	(16.123)	0
FINECOBANK S.P.A	16.524	EUR	122.525	0
FINNING INTL	2.557	CAD	64.155	12
FIRST AMERICAN FINANCIAL CORP	(987)	USD	(47.781)	(1.381)
FIRST CAPITAL REALTY INC	(300)	CAD	(6.120)	0
FIRST DATA CORP	2.594	USD	48.404	(471)
FIRST FINANCIAL HLDG CO USD EQUIV	207.951	USD	140.493	64
FIRST HORIZON NATL CORP	(214)	USD	(3.730)	36
FIRST PACIFIC CO LTD	6.308	HKD	37.028	16
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	(27.329)	CAD	(376.594)	(8.564)
FIRST SOLAR INC	(1.776)	USD	(87.575)	(6.710)
FIRSTENERGY CORP	(12.037)	USD	(384.101)	(10.071)
FIRSTGROUP PLC	241.429	GBP	278.851	0
FIRSTRAND LTD /NEW	(8.939)	ZAR	(463.577)	0
FIRSTSERVICE SHS SUBORD VOTING	225	CAD	18.079	(200)
FISCHER GEORG AG/NAM.	(11)	CHF	(12.100)	0
FISHER&PAYKEL HEALTHC.CORP.	5.883	NZD	64.537	0
FISKARS OY A	2.566	EUR	54.451	0
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	(451)	USD	(68.579)	(393)
FLETCHER BUILDING	(16.489)	NZD	(131.747)	0
FLEURY	(8.157)	BRL	(244.955)	0
FLEX LTD	(3.280)	USD	(52.447)	2.952
FLIGHT CENTRE LIMITED *OPE*	(898)	AUD	(39.063)	0
FLIR SYSTEMS	(13.307)	USD	(496.617)	4.138
FLOW TRADERS	385	EUR	9.848	0
FLOWERS FOODS INC	(5.366)	USD	(94.388)	(299)
FLOWSERVE CORP	(24.511)	USD	(1.008.137)	132.646
FLUOR CORP (NEW)	1.525	USD	66.231	(283)
FMC CORP.	312	USD	23.831	(471)
FNB CORP	(7.884)	USD	(108.011)	769
FOMENTO DE CONSTR.Y CONTRATAS	141	EUR	1.315	0
FOMENTO ECO.MEXICANO SAB/UNITS	(72.534)	MXN	(13.020.578)	1.097
FONCIERE DES REGIONS	224	EUR	18.285	0
FOOT LOCKER INC	13.468	USD	635.555	17.692
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	(492)	TRY	(22.140)	0
FORMOSA CHEMICAL FIBERS USD EQUIV	(9.436)	USD	(28.438)	(12)
FORMOSA PETROCHEMICAL CO-USD EQ	251.827	USD	884.041	355
FORMOSA PLASTIC CORP USD EQUIV	52.474	USD	157.448	62
FORMOSA TAFFETA CO USD EQUIV	(8.274)	USD	(8.193)	(4)
FORST CITY /REIT	1.269	USD	30.938	(495)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
FORT INC FD-B-ZAR	11.205	ZAR	428.031	0
FORTESCUE METALS GROUP LTD	47.070	AUD	270.182	0
FORTINET	3.281	USD	121.102	(1.188)
FORTUM CORPORATION	883	EUR	12.203	0
FOSUN INTERNATIONAL LTD	62.271	HKD	737.289	0
FOXCONN TECHNOLOGY CO USD EQUIV	(99.806)	USD	(300.128)	(121)
FR BRND HOM SEC	(1.811)	USD	(118.928)	468
FRANCO-NEVADA CORP	401	CAD	36.222	190
FRANKFURT AIRPORT SERV.WORLDW.	2.869	EUR	242.775	0
FRANKLIN RESOURCES INC.	(6.049)	USD	(270.874)	3.092
FREENET AG NAMENS-AKTIEN	11.493	EUR	327.895	0
FREEPORT MCMORAN INC	(7.455)	USD	(108.992)	1.366
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	(130)	EUR	(10.373)	0
FRESENIUS SE & CO KGAA	148	EUR	10.572	0
FRESNILLO PLC	3.895	GBP	59.827	0
FRONTLINE LTD	1.722	NOK	78.523	0
FUBON FINANCIAL HOLDING USD EQUIV	(14.066)	USD	(21.848)	(9)
FUGRO NV	(266)	EUR	(3.610)	0
FUJI ELECTRIC CO LTD	19.571	JPY	11.899.168	0
FUJIFILM HOLDINGS CORP	23.953	JPY	97.081.509	0
FUJITSU GENERAL LTD	(3.674)	JPY	(8.545.724)	0
FUJITSU LTD	113.313	JPY	93.335.918	0
FUKUOKA FINANCIAL GROUP	(98.312)	JPY	(50.040.808)	0
G4S PLC	22.442	GBP	73.789	0
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP	171.952	HKD	8.288.086	(3.302)
GALLAGHER+CO ARTHUR J.	437	USD	25.691	(135)
GALLIFORD TRY PLC	9.044	GBP	122.637	0
GAMESA CORP.TECNOLOGICA SA	(9.531)	EUR	(132.004)	0
GAP INC.	(1.784)	USD	(42.513)	368
GARMIN	(1.328)	USD	(66.652)	3.398
GARTNER INC. *OPA*	(2.548)	USD	(326.959)	1.308
GAS NATURAL SDG /SPLIT ISSUE	(17.342)	EUR	(343.198)	0
GAZTRANSPORT ET TECHNIGAZ SA	7.102	EUR	285.784	0
GBL	(14.453)	EUR	(1.252.642)	0
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	(659.988)	HKD	(547.790)	0
GEA GROUP AG	(3.260)	EUR	(111.965)	0
GEBERIT AG/NAMEN-AKTIEN	(2.265)	CHF	(1.053.678)	0
GECINA /ACT.NOM.	2.542	EUR	324.359	0
GEELY AUTOMOBILE HLD LTD	392.512	HKD	7.104.467	2.010
GEMALTO	1.117	EUR	48.098	0
GEN INT	137.133	USD	1.317.056	524
GENERAL ELECTRIC CO	(1.245)	USD	(31.884)	(92)
GENERAL MILLS INC	8.608	USD	479.121	4.685
GENERAL MOTORS CO	4.460	USD	160.471	603
GENESEE & WYOMING INC -A-	2.527	USD	164.659	(5.430)
GENESIS ENERGY LP	374	USD	11.295	69

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
GENESIS ENERGY LTD	4.350	NZD	10.788	0
GENMAB A/S	(878)	DKK	(1.254.662)	0
GENOMMA LAB INTERNACION. SA	89.546	MXN	2.046.126	(201)
GENPACT LTD	(33.390)	USD	(968.310)	(7.930)
GENTEX CORP	2.301	USD	39.163	(333)
GENUINE PARTS CO	7.165	USD	608.523	12.975
GENUS PLC HAMPSHIRE	1.054	GBP	18.224	0
GENWORTH	(7.620)	AUD	(22.936)	0
GENWORTH MI CANADA INC	269	CAD	9.784	275
GEORGE WESTON LTD	100	CAD	10.889	(541)
GERDAU /PREF.	(4.901)	BRL	(52.245)	0
GETINGE AB B	215	SEK	30.143	0
GFINTER	4.048	MXN	405.610	20
GGP --- REGISTERED SHS	(458)	USD	(10.355)	590
GIANT MANUFACTURE CO LTD	2.136	USD	10.540	4
GIBSON ENGY	5.152	CAD	83.617	(477)
GILDAN ACTIVEWEAR	156	USD	4.700	(50)
GILEAD SCIENCES INC.	(2.805)	USD	(213.432)	(3.323)
GIMV SA	229	EUR	12.247	0
GIVAUDAN SA /REG.	2	CHF	3.850	0
GJENSIDIGE FORSIKRING	948	NOK	129.118	0
GKN PLC	87.496	GBP	281.300	0
GLANBIA PLC /-A-	(811)	EUR	(14.193)	0
GLENCORE	(101.055)	GBP	(337.675)	0
GLOBAL PAYMENTS INC	(1.356)	USD	(127.966)	836
GLORY LTD	422	JPY	1.550.850	0
GLOVIS CO LTD-USD EQ	6	USD	842	(25)
GLP J-REIT	(47)	JPY	(5.640.000)	0
GODADDY INC	731	USD	31.418	(535)
GOLD FIELDS	6.248	ZAR	331.019	0
GOLDCORP INC	(4.051)	USD	(53.190)	(593)
GOLDMAN SACHS GROUP INC.	(477)	USD	(107.482)	(1.501)
GOME ELECTRICAL APPLIANCE HOLD	(79.635)	HKD	(74.061)	102
GOODMAN GROUP	2.365	AUD	18.825	0
GOODMAN PROPERTY TRUST REIT	(3.848)	NZD	(4.829)	0
GOODYEAR TIRE & RUBBER	(5.049)	USD	(159.094)	566
GOURMET MASTER CO LTD /USD EQ	11.231	USD	131.484	52
GPT GROUP /STAPLED SECURITY	87.163	AUD	417.511	0
GRACO INC	(172)	USD	(19.959)	(1.131)
GRAFTON GROUP PLC / UNITS	851	GBP	6.540	0
GRAINCORP LTD -A-	5.297	AUD	46.243	0
GRAINGER PLC	9.615	GBP	25.259	0
GRAND CANYON EDUCATION INC	8.095	USD	595.549	(8.667)
GRAND CITY PROPERTIES	622	EUR	10.891	0
GRAND KOREA LEISURE CO LTD EQ USD	(1.292)	USD	(26.508)	337
GRANDVISION N.V.	(135)	EUR	(3.224)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
GRANGES AB	2.587	SEK	230.890	0
GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO	7.041	USD	92.871	(824)
GREAT EAGLE HOLDINGS LTD	(6.313)	HKD	(270.196)	40
GREAT PLAINS ENERGY INC	2.343	USD	72.305	1.523
GREAT PORTL /REIT	(45.572)	GBP	(274.343)	0
GREAT WALL MOTOR CO LTD -H-	262.034	HKD	2.625.581	0
GREEN CROSS CORP /USD EQ	(504)	USD	(82.906)	312
GREENCORE GROUP PLC	(48.431)	GBP	(108.389)	0
GREENE KING PLC	(10.991)	GBP	(75.288)	0
GREGGS PLC	(77)	GBP	(847)	0
GRENDENE SA	(1.931)	BRL	(51.056)	0
GRENKELEASING AG	(131)	EUR	(9.568)	0
GROUPE EUROTUNNEL REGROUPEMT	(20.816)	EUR	(194.879)	0
GROWTHPOINT	8.234	AUD	25.690	0
GROWTHPOINT PROPS	639.795	ZAR	15.854.120	0
GRUBHUB INC	(2.331)	USD	(107.529)	2.122
GRUMA SA DE CV B	(2.898)	MXN	(711.343)	70
GRUPA KETY S.A.	4	PLN	1.674	0
GRUPO AEROPORT.CENTRO NORTE-B-	(15.027)	MXN	(1.689.786)	202
GRUPO AEROPORT.DEL PACIFICO B	(2.492)	MXN	(507.571)	25
GRUPO AEROPORTUARIO -B-	(2.700)	MXN	(1.021.977)	263
GRUPO BIMBO SAB DE CV A	(23.843)	MXN	(1.067.451)	321
GRUPO CATALANA OCCIDENTE SA	9.956	EUR	374.545	0
GRUPO CEMENT.DE CHIHUAHUA SAB	(401)	MXN	(37.281)	(0)
GRUPO COMERCIAL -B-	7.736	MXN	288.553	43
GRUPO FIN BANAMEX	23.773	MXN	759.547	293
GRUPO FIN BANORTE -O-	55.886	MXN	6.593.989	(94)
GRUPO FIN.I.SAB DE CV O	13.112	MXN	419.453	(132)
GRUPO FINANC -B-	58.131	MXN	2.122.363	(163)
GRUPO GICSA SA DE CV	(5.650)	MXN	(68.930)	(6)
GRUPO HERDEZ SAB DE CV	17.270	MXN	692.354	(87)
GRUPO LALA	16.651	MXN	583.118	(75)
GRUPO MEXICO SAB DE CV /-B-	22.787	MXN	1.320.507	(51)
GRUPO SIMEC SA DE CV B	(24.779)	MXN	(1.574.953)	222
GS HOLDINGS CORP USD EQUIV	1.346	USD	90.731	2.036
GS RETAIL	(502)	USD	(21.721)	11
GS YUASA CORP KYOTO	8.069	JPY	4.203.949	0
GUANGDONG INVESTMENT LTD	(122.455)	HKD	(1.344.556)	314
GUANGZHOU AUTO -H-	25.206	HKD	422.957	0
GUANGZHOU R&F PROP.-H- /NEW	(3.113)	HKD	(43.457)	0
GUARARAPES CONFECCOES SA	3.246	BRL	340.473	0
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	(13.982)	USD	(1.008.941)	6.563
GUNGHO ONLINE ENT	(94.540)	JPY	(28.172.920)	0
GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	(376.073)	HKD	(906.336)	0
H&R REAL ESTATE INVEST /REIT	4.472	CAD	94.359	(1.178)
H.I.S. CO LTD	(1.963)	JPY	(6.664.385)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
H.K.EXCHANGES AND CLEARING LTD	8	HKD	1.781	(0)
H.LUNDBECK A/S	3.830	DKK	1.445.825	0
H2O RETAILING CORP	12.685	JPY	22.909.110	0
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	50.175	HKD	1.011.026	0
HAIN CELESTIAL GROUP INC.	(27.279)	USD	(1.219.644)	(23.929)
HAITAN INTL HLDGS LTD	15.430	HKD	345.632	0
HAITONG INT SEC	(356.982)	HKD	(1.606.419)	457
HAKUHODO DY HLD INC	(378)	JPY	(585.522)	0
HAL TRUST- UNITS(EX HOLL.AMER)	22	EUR	3.933	0
HALLIBURTON CO	9.928	USD	421.344	(2.925)
HALMA PLC	2.431	GBP	26.717	0
HAMBURGER HAFEN UND LOGISTIK AG	10.860	EUR	256.948	0
HAMMERSON	3.977	GBP	22.848	0
HAN KOOK TIRE MANUFACTURING CO USD EQUIV	(305)	USD	(5.781)	294
HANA FINANCIAL GROUP INC- USD EQUIV	726	USD	33.101	345
HANESBRANDS INC	(19.067)	USD	(437.016)	12.370
HANG LUNG PROPERTIES LTD	(21.509)	HKD	(417.705)	110
HANG SENG BANK LTD	(10.984)	HKD	(1.862.886)	563
HANKOOK TIRE CO LTD	1.027	USD	57.384	(3.422)
HANKYU HANSHIN HOLDINGS INC	4.101	JPY	16.137.435	0
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	188	EUR	20.060	0
HANOVER INSURANCE GROUP INC	(1.620)	USD	(153.673)	(499)
HANSSEM CO LTD	(113)	USD	(17.780)	(197)
HANWHA CHEMICAL CORP USD EQUIV	4.359	USD	131.327	5.394
HAPAG-LLOYD AG	2.466	EUR	82.364	0
HARLEY DAVIDSON INC.	10.202	USD	496.531	3.043
HARRIS CORP.	(25)	USD	(2.862)	(23)
HARTFORD FIN.SERV.GROUP	(1.237)	USD	(68.035)	(1.311)
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	132.247	AUD	577.919	0
HASBRO INC.	9.926	USD	1.050.965	(4.208)
HASEKO CORP	95.197	JPY	131.562.254	0
HASTINGS GROUP HOLDINGS PLC	1.349	GBP	4.140	0
HAVERSHAM HOLDINGS PLC	42.923	GBP	83.271	0
HAWAIIAN ELECTRIC INDUSTRIES	119	USD	3.926	21
HAYS PLC	37.034	GBP	61.773	0
HCA HEALTHCARE INC	3.432	USD	275.727	(3.324)
HCP SHS	9.522	USD	301.371	(764)
HD SUPPLY HOLDINGS INC	(38.571)	USD	(1.253.172)	(12.187)
HEALTHCA TR -A- /REIT	(10.038)	USD	(307.062)	(3.775)
HEALTHCARE REALTY TRUST	114	USD	3.796	(8)
HEALTHSCOPE LTD	(156.673)	AUD	(325.880)	0
HEALTHSOUTH CORPORATION	5.796	USD	246.678	(13.392)
HEIDELBERGCEMENT AG	(10.569)	EUR	(885.894)	0
HEINEKEN NV	(16.334)	EUR	(1.440.169)	0
HEIWA CORP.	11.738	JPY	28.511.602	0
HELLA KGAA HUECK & CO	14.434	EUR	645.200	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
HELMERICH & PAYNE	(2.839)	USD	(143.710)	15.728
HELVETIA HOLDING SA /NOM.	137	CHF	74.049	0
HEMFOSA FASTIGHETER AB /REIT	10.515	SEK	1.041.511	0
HENDERSON LAND DEV.	(32)	HKD	(1.443)	0
HENGAN INTL GROUP	(7.820)	HKD	(467.636)	(200)
HENNES & MAURITZ AB	(54.751)	SEK	(11.525.086)	0
HENRY JACK & ASSOCIATES INC.	(55)	USD	(5.903)	(36)
HENRY SCHEIN INC.	349	USD	63.591	(348)
HERA SPA	13.740	EUR	37.510	0
HERBALIFE LTD	(13.531)	USD	(899.947)	35.731
HESS CORP	8.924	USD	397.475	2.118
HEWLETT PACKARD ENT CO	50.488	USD	884.045	(15.455)
HEXAGON AB B	(7.173)	SEK	(2.862.027)	0
HEXCEL CORP	93	USD	4.759	22
HEXPOL AB	1.134	SEK	93.725	0
HICL INFRASTRUCTURE CO LTD/GBP	747.970	GBP	1.196.752	0
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP-USD EQ.	(9.957)	USD	(16.488)	(7)
HIGHWOOD PROPERTIES INC.	3.594	USD	185.163	2.233
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	(22.465)	GBP	(317.206)	0
HILL & SMITH HOLDINGS	23	GBP	308	0
HILL-ROM HOLDINGS INC	132	USD	9.837	(47)
HILTON INC	6.444	USD	402.943	(1.100)
HIMART CO LTD	(1.045)	USD	(65.022)	(3.057)
HINO MOTORS LTD	(42.822)	JPY	(55.711.422)	0
HIROSHIMA BANK LTD	33.474	JPY	15.799.728	0
HISCOX LTD	6.707	GBP	87.057	0
HISPANIA ACTIV.	83	EUR	1.265	0
HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES CORP	9.299	JPY	37.846.930	0
HITACHI KOKUSAI ELECTRIC INC	(11.545)	JPY	(32.891.705)	0
HITACHI LTD	488.799	JPY	371.291.720	0
HITACHI METALS LTD	(16.024)	JPY	(24.644.912)	0
HITACHI TRANSPORT SYSTEM	8.191	JPY	20.813.331	0
HITEJINRO CO LTD EQ USD	2.416	USD	51.730	1.949
HIWIN TECHNOLOGIES /USD EQUIV	6.769	USD	49.094	19
HKE & HKE LTD	31.340	HKD	232.229	0
HKT LTD - STAPLED	(3.352)	HKD	(34.324)	0
HOCHSCHILD MINING PLC	(14.557)	GBP	(46.058)	0
HOCHTIEF A.G.	5.486	EUR	828.386	0
HOIST FINANCE	1.162	SEK	103.999	0
HOKURIKU ELEC.JPY 500	(7.205)	JPY	(7.356.305)	0
HOLLYFRONTIER CORP	(1.224)	USD	(35.300)	(282)
HOLMEN AB B	404	SEK	147.298	0
HOLOGIC INC	2.873	USD	127.015	(2.564)
HOME DEPOT INC.	7.534	USD	1.127.086	18.973
HOMESERVE PLC	(48)	GBP	(348)	0
HON HAI PRECISION IND CO USD EQUIV	(281.818)	USD	(1.096.657)	(441)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
HONAM PETROCHEMICAL CO LTD USD EQUIV	844	USD	278.424	3.483
HONDA MOTOR CO.LTD	2.780	JPY	8.640.240	0
HONGKONG & CHINA GAS	(266.840)	HKD	(3.933.222)	1.367
HOPEWELL HOLDINGS LTD	(75)	HKD	(2.243)	0
HORMEL FOODS CORPORATION	7.742	USD	264.544	652
HORNBACH HOLDING AG	649	EUR	50.622	0
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	(995)	USD	(28.915)	(408)
HOST HOTELS & RESORTS INC	2.591	USD	48.348	900
HOTA INDUSTRIAL MANUFACTURING	3.212	USD	14.733	6
HOTAI MOTOR CO LTD EQ USD	(10.697)	USD	(130.015)	(51)
HOTEL SHILLA – CFD	1.396	USD	81.122	(1.781)
HOUSE FOODS GRP	711	JPY	2.024.928	0
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	51.318	GBP	218.050	0
HOYA CORP	(97)	JPY	(603.922)	0
HP INC	(16.084)	USD	(307.204)	857
HSBC HOLDINGS PLC	8.669	GBP	65.624	0
HUA NAN FINANCIAL HLDGS USD EQUIV	(1.789)	USD	(1.046)	(0)
HUANENG POWER INTL H	(40.401)	HKD	(223.014)	(52)
HUANENG RENW -H-	(75.442)	HKD	(179.552)	0
HUBBELL INC	(18)	USD	(2.138)	27
HUCHEMS FINE CHEMICAL CORP USD EQ	(131)	USD	(2.922)	(2)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	12.783	USD	418.260	6.593
HUFVUDSTADEN AB A	2.905	SEK	408.443	0
HUGO BOSS	(64)	EUR	(4.079)	0
HUHTAMAKI OY	(29.615)	EUR	(969.595)	0
HUISHANG BANK /H	342	HKD	1.300	0
HUMANA INC.	5.404	USD	1.249.405	(18.956)
HUNT J.B..TRANSP.SERV.	(451)	USD	(40.910)	1.227
HUNTINGTON	(810)	USD	(166.949)	(2.068)
HUNTINGTON BANCSHARES INC	(60)	USD	(795)	1
HYATT HOTELS CORP -A-	488	USD	27.118	161
HYDRO ONE LTD – CFD	642	CAD	14.355	(53)
HYNIX SEMICONDUCTOR INC USD EQUIV	2.935	USD	173.177	4.113
HYOSUNG CORPORATION- USD EQUIV	(346)	USD	(51.812)	(1.214)
HYPERMARCAS SA	(27.496)	BRL	(769.613)	0
HYPROP INV /REIT	124.685	ZAR	14.737.767	0
HYSAN DEVELOPMENT CO	1.872	HKD	69.732	(132)
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO USD EQUIV	(552)	USD	(54.777)	398
HYUNDAI DEVELOPM.CO-EN.&C. USD EQUIV	4	USD	153	(3)
HYUNDAI ENGINEERING+CONSTR.C USD EQUIV	(5.298)	USD	(214.559)	3.310
HYUNDAI FIRE & MARINE INS CO- USD EQUIV	1.110	USD	45.052	(724)
HYUNDAI GREENFOOD CO LTD	(294)	USD	(4.810)	(13)
HYUNDAI MIPO DOCKYARD CO LTD USD EQUIV	(1.677)	USD	(161.168)	5.702
HYUNDAI MOBIS USD EQUIV	(1.204)	USD	(264.789)	9.326
HYUNDAI MOTOR CO LTD USD EQUIV	(3.052)	USD	(395.631)	8.999
HYUNDAI STEEL CO USD EQUIV	(367)	USD	(20.572)	(633)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
HYUNDAI WIA CORP EQ USD	(443)	USD	(27.327)	(258)
IAC/INTERACTIVECORP /W.ISS.	206	USD	21.554	(743)
IAMGOLD SHS	9.238	CAD	62.172	2.051
IBERDROLA SA	(7.186)	EUR	(45.919)	2.321
IBERIABANK CORP	3.107	USD	251.201	(1.857)
IBIDEN CO LTD	7.640	JPY	14.638.240	0
IBM	4.334	USD	627.000	(1.766)
ICON PLC	739	USD	77.558	3.998
IDACORP INC.	3.990	USD	344.576	(1.141)
IDEMITSU KOSAN	15.782	JPY	42.248.414	0
IDEXX LABORATORIES INC.	2.871	USD	477.907	(339)
IDP EDUCATION LTD	557	AUD	2.913	0
IG GROUP HOLDINGS PLC	7.496	GBP	47.712	0
IGM FINANCIAL INC *OPR*	(866)	CAD	(36.337)	(109)
IGUATEMI EMPRESA SHOP CENT	(17.626)	BRL	(646.874)	0
IHI CORP	(125.063)	JPY	(45.522.932)	0
IHS MARKIT LTD	(1.527)	USD	(71.235)	(146)
ILIAD	(5.045)	EUR	(1.057.684)	0
ILLINOIS TOOL WORKS	4.148	USD	583.665	(769)
ILLUMINA INC	91	USD	15.820	(7)
ILUKA RESOURCES LTD	(60.061)	AUD	(541.750)	0
IMI PLC	3.345	GBP	40.240	0
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	(1.484)	ZAR	(52.252)	0
IMPERIAL BRANDS	19.640	GBP	612.768	0
IMPERIAL HOLDINGS LTD	5.125	ZAR	890.930	0
INCHCAPE	52.771	GBP	423.751	0
INCITEC PIVOT LTD	(39.198)	AUD	(125.434)	0
IND & COM BOC -H-	(282.588)	HKD	(1.545.756)	0
INDEPENDENCE GROUP NL 26.11.10	(91.001)	AUD	(273.913)	0
INDITEX	(36.412)	EUR	(1.223.079)	0
INDIVIOR PLC	44.154	GBP	169.551	0
INDRA SISTEMAS SA	4.025	EUR	52.707	0
INDUS HOLDING AG	1.346	EUR	85.135	0
INDUSTRIAL ALL.INS.AND FIN.SER	(868)	CAD	(50.205)	(256)
INDUSTRIAL BANK OF KOREA USD EQUIV	6.579	USD	90.871	822
INDUSTRIAS BACHOCO SAB DE CV	6.194	MXN	550.027	14
INDUSTRIAS CH SAB DE CV B	(5.905)	MXN	(509.483)	(36)
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	902	MXN	394.174	(34)
INFORMA PLC	(15.734)	GBP	(109.430)	0
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOV	38.708	MXN	3.901.766	(239)
ING GROUP NV	12.306	EUR	194.619	0
INGENICO GROUP ACT.	(463)	EUR	(41.031)	0
INGERSOLL-RAND PLC SHS	2.153	USD	189.206	1.851
INGREDION INC SHS	(1.644)	USD	(202.738)	(817)
INMARSAT PLC	(29.290)	GBP	(227.144)	0
INMOB COL /REIT	(111.723)	EUR	(882.500)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
INNOCEAN WORLDWIDE INC.	(118)	USD	(7.205)	(153)
INNOLUX DISPLAY USD EQUIV	(103.240)	USD	(50.432)	(20)
INPEX CORP	(49.185)	JPY	(52.775.505)	0
INT AIR GROUP	609	GBP	3.520	0
INTACT FIN	(30)	CAD	(2.906)	0
INTER GAME	49.509	USD	942.651	(39.203)
INTER PIPELINE LTD	4.635	CAD	114.114	(9)
INTERACTIVE BROKER GROUP INC	(1.678)	USD	(67.204)	(932)
INTERMEDIATE CAPITAL GROUP PLC	192	GBP	1.742	0
INTERNATIONAL PAPER CO	391	USD	21.497	(603)
INTERPUBLIC GROUP	(15.762)	USD	(340.617)	(148)
INTERTEK GROUP PLC	1.022	GBP	43.956	0
INTERTRUST N.V.	654	EUR	9.486	0
INTESA SANPAOLO SPA	(309.875)	EUR	(902.356)	0
INTL FLAVORS FRAG	(356)	USD	(47.412)	(70)
INTRUM JUSTITIA AB	(16.133)	SEK	(4.239.752)	0
INTU PROPERTIES PLC	2.692	GBP	6.873	0
INTUIT	4.570	USD	627.050	1.723
INTUITIVE SURGICAL INC	65	USD	60.987	316
INVENTEC CO USD EQUIV	(139.477)	USD	(111.554)	(42)
INVESCO LTD	643	USD	22.357	(860)
INVESTEC PLC	11.244	GBP	64.765	0
INVESTIMENTOS ITAU /PREF.	(34.359)	BRL	(317.821)	0
INVESTMENT AB KINNEVIK	870	SEK	215.760	0
INVESTOR AB B	17.013	SEK	6.515.979	0
INVESTORS BANCORP INC	(351)	USD	(4.661)	(63)
INVOCARE LTD	631	AUD	8.771	0
INWIDO AB	196	SEK	19.894	0
INWIT	(21.473)	EUR	(117.028)	0
IOCHPE MAXION SA	(9.687)	BRL	(163.517)	0
ION BEAM APPLICATIONS SA IBA	(2.619)	EUR	(78.413)	0
IONIS PHARMACEUTICALS INC	(3.541)	USD	(185.548)	3.070
IPG PHOTONICS CORP	(1.796)	USD	(274.141)	7.386
IPSEN	(180)	EUR	(19.485)	0
IPSOS SA PARIS	97	EUR	2.829	0
IREN S.P.A.	273.118	EUR	587.204	0
IRESS SHS	(4.277)	AUD	(55.216)	0
IRISH CONTINENTAL GROUP PLC	3.001	EUR	16.115	0
IS DONGSEO CO LTD	105	USD	3.896	(9)
ISS A/S	15	DKK	3.866	0
ISUZU MOTORS LTD	(4.095)	JPY	(6.208.020)	0
ITAU HOLDING /PREF	(54.308)	BRL	(2.026.775)	0
ITOCHU CORP	66.511	JPY	115.097.286	0
ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS	8.210	JPY	31.526.400	0
ITOHAM YONEKYU HOLDINGS INC.	2.251	JPY	2.307.275	0
ITS SKIN CO. LTD.	80	USD	2.789	(43)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ITT INC	5.301	USD	217.341	(5.231)
ITV PLC	(236.921)	GBP	(409.873)	0
IWG PLC	1.566	GBP	5.136	0
IYO BANK LTD	(58.040)	JPY	(52.294.040)	0
IZUMI CO LTD	134	JPY	771.840	0
J D WETHERSPOON PLC	59.754	GBP	611.283	0
J. FRONT RETAILING CO LTD	7.607	JPY	12.011.453	0
J.M.AB	50.044	SEK	14.182.470	0
J.SAINSBURY PLC	256.970	GBP	629.063	0
J2 GLOBAL INC	667	USD	56.448	(660)
JACK IN THE BOX INC	385	USD	35.713	(835)
JACOBS ENGINEER.GROUP	1.654	USD	87.199	(348)
JAMES HALSTEAD PLC	1.124	GBP	5.103	0
JAPAN AIR LINES CO JPY50	(80.682)	JPY	(287.873.376)	0
JAPAN HOTEL REIT INVEST CORP	(19)	JPY	(1.514.300)	0
JAPAN POST INSURANCE CO..LTD.	2.912	JPY	7.061.600	0
JAPAN TOBACCO INC.	3.518	JPY	13.488.012	0
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SHS	548	PLN	45.363	0
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	(255)	USD	(39.171)	1.721
JB FINANCIAL	(7.371)	USD	(45.666)	(1.178)
JB HI-FI LTD	2.440	AUD	63.464	0
JBS AS	5.156	BRL	39.701	0
JC DECAUX SA	(15.765)	EUR	(473.817)	0
JD SPORTS FASHION PLC	25.146	GBP	89.998	0
JEAN COUTU GROUP INC VOT	2.952	CAD	61.343	413
JEJUAIR CO. LTD.	2	USD	64	(1)
JENOPTIK AG. JENA	3.588	EUR	83.600	0
JERONIMO MARTINS SGPS SA	(2.439)	EUR	(40.548)	0
JETBLUE AIRWAYS CORP	(6.623)	USD	(145.242)	6.790
JFE HOLDINGS INC	683	JPY	1.456.498	0
JGC CORP.	(6.299)	JPY	(11.142.931)	0
JM SMUCKER CO	(65)	USD	(7.924)	(20)
JOHN LAING GROUP PLC	14.103	GBP	44.058	0
JOHN LAING INFRA -GBP-/DIS	209.416	GBP	284.596	0
JOHNSON & JOHNSON	6.239	USD	828.040	5.241
JOHNSON CTR INT SHS	918	USD	35.756	2.097
JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS LTD	(5.862)	HKD	(162.377)	75
JOHNSON MATTHEY PLC	2.125	GBP	59.713	0
JONES LANG LASALLE	(3.107)	USD	(395.273)	8.815
JOYFUL HONDA CO. LTD.	193	JPY	589.615	0
JPMORGAN CHASE & CO	405	USD	37.179	(405)
JTEKT CORP	374	JPY	589.050	0
JULIUS BAER GRP *OPR*	334	CHF	18.270	0
JUNIPER NETWORKS INC.	2.176	USD	60.819	436
JUPITER/ IPO	7.837	GBP	41.850	0
JUST EAT - SHS	(113.310)	GBP	(703.089)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
JUST GROUP RG REGISTERED SHS	(864)	GBP	(1.271)	0
K+S AKTIENGESELLSCHAFT	(39.738)	EUR	(874.037)	0
KABA HOLDING AG RUEMLANG	(348)	CHF	(299.976)	0
KAJIMA CORP.	6.042	JPY	5.812.404	0
KAKAKU COM INC TOKYO	51.189	JPY	79.701.273	0
KAMIGUMI CO LTD	255	JPY	301.410	0
KANEKA CORP.	(4.563)	JPY	(4.042.818)	0
KANGWON LAND INC- USD EQUIV	(484)	USD	(16.010)	(85)
KANSAI PAINT CO LTD OSAKA	(27.357)	JPY	(69.240.567)	0
KANSAS CITY SOUTHERN	1.966	USD	202.872	(113)
KAO CORP.	(1.997)	JPY	(13.407.858)	0
KAP INDUS	20.580	ZAR	165.052	0
KAR AUCTION SERVICES	4.924	USD	207.005	(169)
KAWASAKI HEAVY IND.	(25.977)	JPY	(9.143.904)	0
KAWASAKI KISEN	(124.557)	JPY	(34.128.618)	0
KAZAKHMYS LIMITED	(5.303)	GBP	(38.076)	0
KB FINANCIAL GROUP INC-USD EQ	6.889	USD	365.831	5.864
KCC CORP USD EQUIV	(403)	USD	(157.263)	(1.132)
KDDI CORP.	25.261	JPY	73.762.120	0
KEIHAN HOLDINGS CO..LTD.	13.607	JPY	9.715.398	0
KEIKYU CORP	(14.217)	JPY	(18.211.977)	0
KEIO CORP	9.925	JPY	9.170.700	0
KELLOGG CO	662	USD	45.016	285
KENDA RUBBER INDUSTRIAL CO LTD	65	USD	102	0
KEPCO PLANT SERV & ENG CO LTD	(611)	USD	(24.581)	(37)
KERING ACT.	1.765	EUR	521.558	0
KERNEL HOLDING SA	1.191	PLN	75.736	0
KERRY GROUP A	(2.336)	EUR	(178.354)	0
KERRY LOGISTICS	(3.762)	HKD	(42.285)	0
KERRY PROPERTIES LTD	8.902	HKD	243.470	(57)
KESKO OYJ /-B-	11.790	EUR	503.787	0
KEWPIE CORP	(7.027)	JPY	(19.492.898)	0
KEYCORP	10.624	USD	191.657	(3.559)
KEYENCE CORP	238	JPY	12.142.760	0
KEYERA	388	CAD	15.116	(131)
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	(6.646)	USD	(276.407)	7.388
KGHM POLSKA MIEDZ SA	(13.058)	PLN	(1.596.993)	0
KIA MOTORS CORP. USD EQUIV	(5.766)	USD	(188.666)	2.601
KIER GROUP PLC	58	GBP	748	0
KIKKOMAN CORP.	(2.113)	JPY	(7.141.940)	0
KILROY REALTY CORPORATION	5.800	USD	402.578	(11.486)
KIMBERLY CLARK CORP	2.241	USD	276.002	1.261
KIMBERLY CLARK MEX.SAB CV -A-	(40.288)	MXN	(1.442.310)	90
KIMCO REALTY CORP.	(33.767)	USD	(681.418)	6.204
KINDEN CORP	3.181	JPY	5.464.958	0
KINDER MORGAN INC	(5.690)	USD	(116.247)	(723)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
KINDRED GROUP	(12.046)	SEK	(1.082.333)	0
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	111.606	HKD	3.906.210	(2.858)
KINGBOARD LAMINATES HLDGS LTD	534.253	HKD	5.823.358	0
KINGFISHER PLC	581	GBP	1.710	0
KINGSOFT CORPORATION LTD	(2.714)	HKD	(55.908)	0
KINGSPAN GROUP PLC	2.799	EUR	78.708	0
KINROSS GOLD CORP	162.419	USD	669.166	1.624
KINTETSU GROUP HOLDINGS CO LTD	7.697	JPY	3.255.831	0
KION GROUP	(1.442)	EUR	(105.742)	0
KIRBY CORP.	(176)	USD	(10.718)	262
KIRIN HOLDINGS CO LTD	58.777	JPY	142.857.499	0
KIWI PROPERTY GROUP LTD	(7.312)	NZD	(10.017)	0
KIWOOM SECURITIES CO LTD	430	USD	32.637	507
KLA TENCOR CORPORATION	13.457	USD	1.246.522	(69.277)
KLABIN RIOCELL SA	(20.600)	BRL	(329.600)	0
KLEPIERRE	7.240	EUR	248.875	0
KOBE STEEL LTD	(51.201)	JPY	(70.759.782)	0
KOEI TECMO HOLDINGS SHS	(6.835)	JPY	(15.590.635)	0
KOHL S CORP.	3.638	USD	150.431	5.320
KONAMI HLDS SHS	3.930	JPY	22.597.500	0
KONE OYJ -B-	(15.273)	EUR	(672.165)	0
KONECRANES PLC	107	EUR	4.036	0
KONGSBERG GRUPPEN ASA	8.955	NOK	1.195.493	0
KONICA MINOLTA HOLD INC	(3.134)	JPY	(2.864.476)	0
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	(11.148)	EUR	(192.805)	0
KONINKLIJKE BAM GROEP NV	(203)	EUR	(1.020)	0
KONINKLIJKE DSM NV	8.245	EUR	514.323	0
KONINKLIJKE VOPAK	28	EUR	1.127	0
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	(7.214)	USD	(333.430)	525
KOREA ELECTRIC POWER CORP. USD EQUIV	(3.157)	USD	(125.736)	808
KOREA GAS CORP USD EQUIV	985	USD	44.206	110
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO- USD EQUIV	(440)	USD	(28.007)	(1.014)
KOREA KOLMAR	(344)	USD	(21.835)	870
KOREA KUHMO PETROCHEMICAL /USD EQUIV	(272)	USD	(18.384)	(29)
KOREA LIFE INSURANCE CO LTD-USD EQ	4.182	USD	28.227	(561)
KOREA ZINC CO LTD USD EQUIV	(4)	USD	(1.765)	(42)
KOREAN AIR- USD EQUIV	1.644	USD	52.323	1.441
KORIAN --- ACT.	4.067	EUR	113.632	0
KOSE CORP TOKYO	(2.202)	JPY	(27.040.560)	0
KROGER CO.	12.265	USD	300.738	10.252
KRONES AG	6.172	EUR	649.603	0
KROTON EDUCACIONAL7-OPEN/CV	38.999	BRL	588.105	0
KRUK S.A.	846	PLN	291.024	0
KT&G CORPORATION- USD EQUIV	869	USD	88.565	(4.032)
KUBOTA CORP	(89.087)	JPY	(171.002.497)	0
KUEHNE +NAGEL INTERNATIONAL	(145)	CHF	(24.418)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
KUMBA IRON ORE LTD	18.013	ZAR	3.539.555	0
KUNGSLEDEN	1.653	SEK	87.774	0
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	251.978	HKD	1.947.790	(1.936)
KWG PROPERTY HOLDING LTD	(6.860)	HKD	(39.788)	0
KWS SAAT AG	417	EUR	143.302	0
KYOCERA CORP	6.477	JPY	43.473.624	0
KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD	(15.990)	JPY	(32.011.980)	0
KYUDENKO CORP	(15.449)	JPY	(64.267.840)	0
L BRANDS INC	10	USD	464	10
L OCCITANE INTERNATIONAL SA	(5.852)	HKD	(105.921)	0
L OREAL	(11.310)	EUR	(1.980.381)	0
LABORATORY CORP OF AMER.HLD	(256)	USD	(40.681)	1.244
LAFARGEHOLCIM N NAMEN-AKT.	(406)	CHF	(23.487)	0
LAGARDERE SCA /NOM.	(898)	EUR	(24.920)	0
LAGERCRANTZ GROUP AB	4.220	SEK	385.075	0
LAM RESEARCH CORP	2.785	USD	444.096	(9.070)
LAMAR ADVERTISING CO	1.107	USD	78.121	(1.912)
LANCASHIRE HOLDINGS	(12.822)	GBP	(93.216)	0
LANCASTER COLONY CORP.	921	USD	112.933	(4.651)
LAND SEC GROUP PLC REIT/CAP	8.114	GBP	82.844	0
LANDSTAR SYSTEMS INC.	4.475	USD	372.096	(26.320)
LARGAN PRECISION CO USD EQUIV	(833)	USD	(152.006)	(60)
LAS VEGAS SANDS CORP	17.781	USD	1.095.487	(15.150)
LAZARD LTD CL.A	746	USD	34.846	(214)
LCY CHEMICAL CORP	2.396	USD	3.476	1
LEAR CORP	226	USD	33.491	78
LEE & MAN PAPER	148.685	HKD	1.238.546	0
LEG IMMOBILIEN	1.547	EUR	125.756	0
LEGEND HOLDINGS LTD /H	815	HKD	16.667	0
LEGG MASON INC.	(2.414)	USD	(96.584)	(24)
LEGGETT + PLATT INC.	1.264	USD	60.900	(5.827)
LEGRAND HOLDING ACT.PROV.OPO	1.335	EUR	77.964	0
LEIDOS HOLDINGS INC	601	USD	32.117	(145)
LENDLEASE GRP	(974)	AUD	(16.412)	0
LENNAR CORP. -A-	972	USD	50.972	(502)
LENNOX INTERNATIONAL INC.	2.431	USD	415.701	(522)
LENOVO GROUP LTD	(525.238)	HKD	(2.542.152)	0
LENZING AG	1.178	EUR	177.878	0
LEONARDO AZIONE POST RAGGRUPPA	891	EUR	13.124	0
LEONI AG /NAMEN-AKT.	388	EUR	19.394	0
LEROY SEAFOOD GROUP ASA	29.597	NOK	1.350.511	0
LEUCADIA NATIONAL CORP.	13.239	USD	344.611	(13.660)
LG CHEMICAL LTD USD EQUIV	(482)	USD	(141.338)	(2.516)
LG CORP- USD EQUIV	(1.350)	USD	(91.000)	(90)
LG ELECTRONICS INC USD EQUIV	5.528	USD	331.610	(265)
LG INNOTEK CO LTD-USD EQ	879	USD	117.874	(86)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
LG INTERNATIONAL CORP- USD EQUIV	(2.320)	USD	(60.978)	566
LG PHILIPS LCD CO LTD- USD EQUIV	1.463	USD	41.396	947
LG TELECOM LTD USD EQUIV	149	USD	2.218	40
LI & FUNG LTD	(103.108)	HKD	(293.858)	132
LIBERBANK S.A.	138.228	EUR	135.049	0
LIBERTY GLOBAL PLC -A-	2.768	USD	93.724	3.072
LIBERTY HOLDINGS LTD	62.466	ZAR	7.059.283	0
LIBERTY INT QVC GROUP COM -A-	34	USD	814	3
LIBERTY INTERACT -A LIB VENT-	(4.987)	USD	(302.112)	(25.672)
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDING	30.985	ZAR	783.921	0
LIFE STORAGE INC /REIT	(791)	USD	(57.775)	1.279
LIG NEX1 CO.. LTD.	11	USD	805	(4)
LIGHT SA	3.912	BRL	88.216	0
LILLY (ELI) & CO	(354)	USD	(29.262)	(7)
LINAMAR CORP	(67)	CAD	(4.578)	22
LINCOLN ELECTRIC HLDGS INC	2.779	USD	242.496	856
LINCOLN NATIONAL CORP.	(988)	USD	(72.183)	(241)
LINK ADMIN	(5.323)	AUD	(41.040)	0
LINK REIT --- UNITS	6.428	HKD	408.178	0
LINTEC CORP	(15.108)	JPY	(40.474.332)	0
LINX SHS	13.183	BRL	227.802	0
LION CORP.	(11.312)	JPY	(26.696.320)	0
LITE-ON TECHNOLOGY CORP USD EQUIV	(29.158)	USD	(47.172)	(18)
LITTELFUSE INC	(478)	USD	(86.126)	1.351
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.533	USD	690.725	12.904
LIXIL GROUP SHS	(42.330)	JPY	(120.174.870)	0
LKQ	(6.101)	USD	(210.851)	(10.144)
LLOYDS BANKING GROUP PLC	933.143	GBP	611.955	0
LOBLAW COMPANIES LTD	224	CAD	15.210	(622)
LOCALIZA RENTA A CAR	27.464	BRL	1.425.382	0
LOCKHEED MARTIN CORP	(1.060)	USD	(309.658)	(2.452)
LOEWS CORP	(44)	USD	(2.142)	(28)
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	(94.672)	HKD	(640.929)	0
LOGISTA	1.467	EUR	32.054	0
LOGITECH INTL SA	1.581	CHF	55.572	0
LOJAS AMERICANAS SA /PRIV.	27.728	BRL	434.498	0
LOJAS RENNER SA	(32.098)	BRL	(940.471)	0
LONGFOR PPT	(103.180)	HKD	(2.024.392)	0
LONZA GROUP AG /NOM.	229	CHF	52.670	0
LOOMIS -B-	(680)	SEK	(204.000)	0
LOTTE SAMKANG	(5)	USD	(2.789)	6
LOUISIANA-PACIFIC CO.	41.304	USD	1.037.143	(2.846)
LOWE S COMPANIES INC.	(5.928)	USD	(458.827)	(8.166)
LPL INVESTMENT HOLDINGS INC	(836)	USD	(38.255)	(93)
LSE GROUP	(5.428)	GBP	(203.441)	0
LULULEMON ATHLETICA INC	(410)	USD	(25.272)	(104)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
LUNDIN MINING CORP	(841)	CAD	(7.544)	9
LUNDIN PETROLEUM AB	(27.776)	SEK	(5.102.451)	0
LVMH ACT.	(2.353)	EUR	(500.483)	0
LYONDELLBASELL IND NV -A-	(2.661)	USD	(239.729)	(4.840)
M BANK	(622)	PLN	(283.010)	0
M&T BANK CORPORATION	(11)	USD	(1.795)	(4)
M. DIAS BRANCO SA IND E	2.012	BRL	102.129	0
MABUCHI MOTORS	7.140	JPY	41.554.800	0
MACERICH	(1.302)	USD	(74.722)	4.156
MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS HO	(363)	USD	(21.980)	1.815
MACQUARIE ATLAS ROADS GROUP	14.856	AUD	82.599	0
MACQUARIE GROUP LTD	5.807	AUD	498.415	0
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	409	USD	31.006	(168)
MACQUARIE KOREA INFRASTR.FUND	(23)	USD	(174)	(0)
MACRONIX INTERNATIONAL USD EQUIV	1.553	USD	849	0
MACY S	7.635	USD	181.331	1.954
MAEDA CORP.	(6.602)	JPY	(8.813.670)	0
MAEDA ROAD CONSTR.	(756)	JPY	(1.719.900)	0
MAGAZINE LUIZA SA	988	BRL	362.477	0
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	2.991	AUD	78.992	0
MAGELLAN MIDSTREAM PARTNERS	360	USD	25.114	(382)
MAHLE METAL LEVE	1.200	BRL	20.412	0
MAINFREIGHT LIMITED MFT	1.465	NZD	35.600	0
MAISON DU MONDE SAS	497	EUR	15.564	0
MAKEMYTRIP LIMITED	(1.713)	USD	(55.758)	2.490
MAKITA CORP	13.819	JPY	59.628.985	0
MALLINCKRODT PLC	(8.241)	USD	(377.438)	12.381
MAN WAH HOLDINGS	166.726	HKD	1.125.401	0
MANITOU BF SA	(116)	EUR	(3.439)	0
MANPOWERGROUP INC	2.204	USD	236.159	411
MANULIFE FINANCIAL CORP	(658)	CAD	(16.897)	(147)
MAPFRE SA	138.579	EUR	436.662	0
MAPLE LEAF FOODS INC	981	CAD	33.805	987
MARATHON PETROLEUM CORP	1.777	USD	99.494	385
MARKEL CORP.	(74)	USD	(79.292)	(1.685)
MARKETAXESS HOLDING INC	(622)	USD	(126.198)	(1.098)
MARKS AND SPENCER /NEW	5.349	GBP	17.234	0
MARRIOTT INTL INC. A	(18)	USD	(1.875)	1
MARSH & MC-LENNAN COS INC	(153)	USD	(11.929)	396
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC.	(968)	USD	(219.184)	105
MARUBENI CORP.	19.511	JPY	14.268.394	0
MARUI GROUP CO LTD	(40.284)	JPY	(60.506.568)	0
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	21.635	USD	336.641	(9.883)
MASCO CORP.	412	USD	15.710	(251)
MASIMO CORPORATION	10.868	USD	1.028.113	(43.957)
MASSMART HOLDINGS	35.142	ZAR	3.888.462	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
MASTEC INC	17.190	USD	794.178	(2.029)
MASTERCARD INC. SHS-A-	(3.198)	USD	(408.704)	643
MATCH GROUP INC	(1.148)	USD	(20.951)	686
MATSUMOTOKIYOSHI HOLDINGS CO	12.074	JPY	82.103.200	0
MATTEL INC.	(44.430)	USD	(889.489)	4.380
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22.175	USD	1.007.632	18.468
MAXIMUS	5.526	USD	333.549	(6.469)
MAYNE PHARMA GROUP LTD	4.851	AUD	4.657	0
MAZDA MOTOR CORP	(14.595)	JPY	(24.293.378)	0
MB FINANCIAL INC	632	USD	25.849	(81)
MC-CORMICK&CO/N.VOTING	745	USD	70.999	178
MCDONALD S CORP.	4.771	USD	740.173	(6.184)
MCDONALD S HOLDINGS CO (JAPAN)	(74)	JPY	(331.890)	0
MCKESSON CORP	(246)	USD	(39.820)	1.586
MDU RESOURCES GROUP INC	16.552	USD	436.145	8.094
MEDIASET ESPANA --- SHS	(18.306)	EUR	(194.959)	0
MEDIATEK INC USD EQUIV	(214.451)	USD	(1.889.182)	(748)
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23.550	USD	305.679	95
MEDICINES CO	(13.377)	USD	(514.346)	3.732
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	(96.158)	GBP	(711.569)	0
MEDIDATA SOLUTIONS	290	USD	22.275	(293)
MEDIOBANCA BCA CREDITO FINANZ.	(641)	EUR	(5.650)	0
MEDNAX	7.050	USD	331.209	(23.446)
MEDTRONIC HOLDINGS LIMITED	2.004	USD	168.276	(3.853)
MEGA FINANCIAL HLDG(CTB) USD EQUIV	(128.432)	USD	(108.675)	(47)
MEGACABLE HOLDINGS - CPO	12.133	MXN	895.658	184
MEGGITT PLC	7.518	GBP	37.816	0
MEIJI HLDG	(1.526)	JPY	(13.413.540)	0
MEKONOMEN AB	90	SEK	15.300	0
MELCO INTL DVPT LTD	84.619	HKD	1.558.682	(867)
MELEXIS NV IEPER	(6.016)	EUR	(437.243)	0
MELIA HOTELS --- SHS	1.979	EUR	25.955	0
MELROSE INDUSTRIES PLC	(121.982)	GBP	(283.486)	0
MERCADOLIBRE INC	390	USD	112.484	6.525
MERCIALYS /PROM.ACTION	5.715	EUR	97.727	0
MERCK	22.160	USD	1.415.581	34.335
MERCK KGAA	13.084	EUR	1.214.849	0
MERCURY NZ LTD	(18.110)	NZD	(63.023)	0
MERITZ FIR&MAR INSUR.CO USD EQ	1.231	USD	26.027	(152)
MERL SOCIMI /REIT	(46.267)	EUR	(526.518)	0
METHANEX CORP	8.133	USD	360.292	(3.297)
METLIFE INC	6.853	USD	376.915	(4.473)
METRO BANK PLC	(150)	GBP	(5.433)	0
METRO INC /-A- SUB VTG	1.384	CAD	58.446	(222)
METROPOLE TELEVISION SA M6	12.402	EUR	253.683	0
METSA BOARD CORPORATION -B-	352	EUR	2.103	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
METSO CORP	(25.492)	EUR	(685.225)	0
METTLER TOLEDO INTL INC.	(174)	USD	(99.716)	5.331
MEXICHEM SAB DE CV	(23.427)	MXN	(1.190.092)	(92)
MGIC INVESTMENT CORP	11.759	USD	137.228	162
MGM CHINA	(44.306)	HKD	(681.426)	0
MGM RESORTS INTERNATIONAL	(2.302)	USD	(75.805)	838
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	(1.228)	USD	(44.748)	(562)
MICHELIN B /NOM.	5.017	EUR	573.694	0
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	12.161	GBP	271.555	0
MICROCHIP TECHNOLOGY INC.	2.416	USD	193.377	(3.214)
MICRON TECHNOLOGY INC	4.215	USD	118.526	(6.604)
MICRONIC AB	31.310	SEK	2.637.868	0
MICROSEMI	(5.199)	USD	(270.764)	7.419
MICROSOFT CORP	(3.986)	USD	(289.782)	4.384
MICRO-STAR INTERNATIONAL USD EQUIV	(11.278)	USD	(29.283)	(12)
MID-AMERICA APARTMENT COMMUN.	751	USD	77.751	1.194
MIDDLEBY CORP	(1.795)	USD	(234.571)	(876)
MINEBEA CO LTD	(630)	JPY	(1.148.490)	0
MINERAL RESOURCES LTD	(11.481)	AUD	(140.872)	0
MINERVA SA	(415)	BRL	(5.146)	0
MINMETALS RESOURCES	578	HKD	2.006	(1)
MINTH GROUP LTD	(19.435)	HKD	(699.660)	0
MIRACA HOLDINGS INC	13.412	JPY	67.596.480	0
MIRVAC GROUP	59.389	AUD	128.874	0
MITCHELLS & BUTLERS PLC	453	GBP	1.095	0
MITSUBISHI CHEMICAL HLDGS CORP	18.602	JPY	17.281.258	0
MITSUBISHI CORP	(20.089)	JPY	(48.143.289)	0
MITSUBISHI ESTATE CO.	73.006	JPY	146.450.036	0
MITSUBISHI GAS CHEMICAL	(101)	JPY	(258.257)	0
MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES	(286.712)	JPY	(125.952.582)	0
MITSUBISHI LOGISTICS CORP	28.086	JPY	39.797.862	0
MITSUBISHI MATERIALS CORP	(1.183)	JPY	(4.388.930)	0
MITSUBISHI MOTOR CORP.	(115.827)	JPY	(92.429.946)	0
MITSUBISHI PENCIL CO LTD	(516)	JPY	(1.550.580)	0
MITSUBISHI TANABE PHARMA CORP	(2.917)	JPY	(7.668.793)	0
MITSUI CHEMICALS INC.	146.950	JPY	92.578.500	0
MITSUI FUDOSAN CO	1.045	JPY	2.648.553	0
MITSUI O.S.K.LINES LTD TOKYO	(250.104)	JPY	(86.035.776)	0
MKS INSTRUMENTS INC	(11.580)	USD	(968.667)	(21.324)
MOBILE TEL NET SHS	(83.098)	ZAR	(9.846.282)	0
MODERN TIMES GROUP AB B	437	SEK	122.710	0
MOHAWK INDUSTRIES	69	USD	17.180	550
MOLINA HEALTHCARE INC	(919)	USD	(61.389)	2.580
MOLSON COORS BREW-B-NON-VOT	(1.613)	USD	(143.525)	(588)
MONDELEZ INTERNATIONAL INC WI	(5.311)	USD	(233.790)	1.265
MONDI LTD	35.735	ZAR	12.228.517	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
MONDI PLC	377	GBP	7.521	0
MONEYSUPERMARKET.COM	1.107	GBP	3.676	0
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	(1.589)	USD	(162.586)	5.079
MONSTER BEVERAGE CORP	470	USD	24.793	(108)
MOODY S CORP	(1.480)	USD	(194.812)	2.000
MORINAGA + CO.LTD	(5.243)	JPY	(33.135.760)	0
MORINAGA MILK INDUSTRY CO LTD	67.118	JPY	54.097.108	0
MORNINGSTAR INC	(57)	USD	(4.706)	(41)
MOSAIC CO	(18.183)	USD	(438.938)	1.517
MOTOROLA SOLTN/EX-DISTR	34	USD	3.083	(5)
MPLX LP	(539)	USD	(19.593)	(61)
MR. PRICE GROUP LIMITED	(17.444)	ZAR	(3.020.080)	0
MRV ENGENHARIA	(12.637)	BRL	(181.088)	0
MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS	8.485	JPY	32.853.920	0
MSC INDUSTRIAL DIRECT CO -A-	20.593	USD	1.466.428	(22.608)
MSCI INC -A-	(384)	USD	(41.837)	506
MTR	(19.665)	HKD	(886.892)	126
MTU AERO ENGINES N NAMEN-AKT	190	EUR	23.551	0
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	(6.684)	BRL	(480.446)	0
MULTIPLUS	3.399	BRL	135.246	0
MURATA MANUFACTUR CO LTD	(3.784)	JPY	(65.009.120)	0
MYLAN N.V.	(69)	USD	(2.690)	4
MYOB LIMITED	(2.680)	AUD	(8.924)	0
NABTESCO CORP	(3.766)	JPY	(13.501.110)	0
NAGOYA RAILROAD CO LTD	7.206	JPY	3.646.236	0
NAN YA PLASTIC USD EQUIV	35.033	USD	88.177	34
NANYA TECHNOLOGY CORP USD EQUIV	18.745	USD	38.738	16
NASDAQ INC	(2.292)	USD	(170.456)	(2.017)
NASPERS LTD N	(3.314)	ZAR	(9.638.769)	0
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	18.638	AUD	558.208	0
NATIONAL BEVERAGE CORP	3.569	USD	364.466	(3.565)
NATIONAL EXPRESS GROUP PLC	30.584	GBP	111.356	0
NATIONAL FUEL GAS CO	(2.384)	USD	(141.157)	885
NATIONAL GRID PLC	(83.276)	GBP	(780.130)	0
NATIONAL INSTRUMENTS CORP	(22.973)	USD	(945.109)	54.073
NATIONAL OILWELL VARCO INC	(3.172)	USD	(103.756)	2.657
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	(724)	USD	(28.946)	431
NATIXIS	1.444	EUR	8.870	0
NATURA COSMETICOS SA	14.066	BRL	352.353	0
NAVIENT CORP	14.006	USD	206.589	(1.163)
NAVITAS LTD	(8.436)	AUD	(41.927)	0
NCC AB B	9.039	SEK	1.899.998	0
NCR CORP	11.707	USD	443.110	(29.731)
NCSOFT CORPORATION USD EQUIV	239	USD	77.133	3.030
NEDBANK GROUP	(4.293)	ZAR	(940.468)	0
NEMAK SAB DE CV	40.286	MXN	646.993	(158)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
NEMETSCHEK SE	(201)	EUR	(13.202)	0
NEOPOST	11.633	EUR	450.430	0
NESTE OIL OYJ	(78)	EUR	(2.857)	0
NESTLE / ACT NOM	(16.823)	CHF	(1.374.439)	0
NET ENTERTAINMENT NE AB	(203)	SEK	(15.814)	0
NETAPP INC	(2.549)	USD	(110.678)	2.270
NETCARE LTD	76.242	ZAR	1.871.741	0
NETFLIX INC	(1.484)	USD	(269.583)	8.145
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	(2.159)	USD	(103.697)	1.360
NEW FLYER INDUSTRIES *OPE*	295	CAD	14.995	(328)
NEW JERSEY RESOURCES CORP.	(240)	USD	(10.116)	(4)
NEW RESIDENTIAL INVESTMENT/REIT	(844)	USD	(14.348)	(276)
NEW WORLD DEVELOPMENT CO. LTD	(132.325)	HKD	(1.392.059)	678
NEW YORK COMM.BANCORP	3.079	USD	40.427	(820)
NEWCREST MINING	211	AUD	4.262	0
NEWELL BRANDS INC	(2.748)	USD	(144.875)	697
NEWFIELD EXPLORATION CO	(16.317)	USD	(468.787)	229
NEWMARKET CORP	8	USD	3.681	(11)
NEWMONT MINING CORP.	(1.306)	USD	(48.544)	76
NEWS CORPORATION /-A- WHEN ISS	1.157	USD	16.557	251
NEX GROUP PLC	91.843	GBP	613.052	0
NEXANS PARIS	(1.189)	EUR	(57.524)	0
NEXEN TIRE	(373)	USD	(4.435)	88
NEXITY / -A-	(2.245)	EUR	(101.777)	0
NEXON CO LTD	7.844	JPY	18.001.980	0
NEXT PLC	(7.829)	GBP	(309.246)	0
NEXTDC LTD	6.512	AUD	26.764	0
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	8.205	HKD	110.603	0
NEXTERA ENERGY	(482)	USD	(70.415)	(1.422)
NH HOTELES SA	(20.608)	EUR	(116.023)	0
NHK SPRING CO	21.633	JPY	25.808.169	0
NHN CORPORATION USD EQUIV	(88)	USD	(63.174)	1.581
NHN ENTERTAINMENT CORP	(935)	USD	(64.113)	517
NIB HOLDINGS LTD	17.657	AUD	101.351	0
NIDEC CORP	(3.858)	JPY	(46.913.280)	0
NIELSEN HOLDINGS PLC	(17.430)	USD	(749.664)	(45.196)
NIHON KOHDEN CORP	(9.471)	JPY	(24.993.969)	0
NIHON UNISYS LTD	1.637	JPY	3.012.080	0
NIKE INC B	(1.607)	USD	(94.893)	(565)
NIKON CORP.	1.174	JPY	2.283.430	0
NINE DRAGONS PAPER HLDGS LTD	42.538	HKD	495.142	0
NINE ENTERTAINMENT	2.076	AUD	2.989	0
NINTENDO CO.LTD	(1.683)	JPY	(63.078.840)	0
NIPPO CORP	(2.315)	JPY	(5.192.545)	0
NIPPON ELECTRIC GLASS	41	JPY	160.310	0
NIPPON EXPRESS CO.LTD	7.785	JPY	5.488.425	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
NIPPON MEAT PACKERS	6.706	JPY	21.895.090	0
NIPPON PAINT HOLDINGS CO.LTD.	(1.179)	JPY	(5.016.645)	0
NIPPON SHINKYAKU CO	91	JPY	634.270	0
NIPPON SHOKUBAI CO LTD	(2.176)	JPY	(15.732.480)	0
NIPPON TV HLDG	11.886	JPY	22.416.996	0
NIPPON YUSEN K K	(483.865)	JPY	(102.095.515)	0
NIPRO CORP	(4.461)	JPY	(6.682.578)	0
NISOURCE INC	(9.896)	USD	(257.890)	181
NISSAN CHEMICAL IND.	4.356	JPY	16.008.300	0
NISSHINBO HOLDINGS INC	(16.774)	JPY	(18.736.558)	0
NISSIN FOODS HOLDINGS CO LTD	(11.282)	JPY	(78.184.260)	0
NITORI HOLDINGS CO LTD	2.320	JPY	36.099.200	0
NITTO DENKO CORPO	(1.361)	JPY	(13.416.738)	0
NN GROUP N.V.	8.028	EUR	275.280	0
NOBIA AB	29.516	SEK	2.448.352	0
NOKIA OY	2.367	EUR	12.734	0
NOKIAN TYRES PLC	(815)	EUR	(28.101)	0
NOLATO AB /-B-	3.684	SEK	1.305.978	0
NOMURA REAL ESTATE HDGS INC	(27.452)	JPY	(60.064.976)	0
NONG SHIM CO LTD USD EQUIV	(105)	USD	(29.991)	(172)
NORBORD INC	(24)	CAD	(1.062)	0
NORDEA BANK AB	1.412	SEK	143.883	0
NORDEX SE ROSTOCK/KONV	878	EUR	10.132	0
NORDSON CORP	(605)	USD	(76.835)	(303)
NORDSTROM INC	214	USD	10.394	163
NORFOLK SOUTHERN CORP.	1.595	USD	179.565	(7.022)
NORMA GROUP	438	EUR	22.461	0
NORSK HYDRO AS	(1.042)	NOK	(52.882)	0
NORTHAM PLATINUM (PTY)LTD	(58.899)	ZAR	(2.704.642)	0
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	20.534	AUD	90.350	0
NORTHERN TRUST CORP	4.569	USD	399.833	(2.230)
NORTHLAND POWER	1.563	CAD	36.293	404
NORTHROP GRUMMAN CORP	(69)	USD	(18.156)	63
NORWEGIAN CRUISE LINE SHS	85	USD	4.681	(58)
NORWEGIAN FINANS HOLDING ASA	(2.890)	NOK	(244.205)	0
NOS SGPS SA	(6.442)	EUR	(34.658)	0
NOVARTIS AG BASEL/NAM.	(27.934)	CHF	(2.301.762)	0
NOVATEK MICROELECTRS USD EQUIV	(23.224)	USD	(88.450)	(34)
NOVO NORDISK A/S /-B-	(1.306)	DKK	(350.139)	0
NOVOZYMES SHS-B-	(18.822)	DKK	(5.462.144)	0
NP STL AND STOMO	(41.196)	JPY	(111.723.552)	0
NRG ENERGY INC	(16.282)	USD	(400.863)	3.449
NSK LTD	36.360	JPY	51.922.080	0
NTN CORP *OPR*	165	JPY	84.975	0
NTT DOCOMO INC	1.035	JPY	2.652.705	0
NTT URBAN DEV CORP	5.543	JPY	6.258.047	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
NUCOR CORP.	(954)	USD	(55.017)	(224)
NUFARM LIMITED	(1.928)	AUD	(16.311)	0
NUSTAR ENERGY /PARTNESHIP	2.535	USD	109.715	(1.163)
NUVASIVE INC	3.766	USD	247.765	(15.835)
NVIDIA CORP.	653	USD	106.119	(809)
NVR INC	221	USD	576.907	(9.628)
NWS HOLDINDS LTD	3.622	HKD	54.040	(19)
O REILLY AUTOMOTIVE INC	(2.070)	USD	(422.901)	(10.716)
OAKTREE CAPITAL GROUP -A- /LP	272	USD	13.165	99
OBAYASHI CORP.	7.377	JPY	9.796.656	0
OBIC BUSIN. CONSULTANTS CO LTD	367	JPY	2.055.200	0
OBIC CO LTD TOKYO	803	JPY	5.532.670	0
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	12.081	USD	748.176	7.477
OCEAN YIELD ASA	11.907	NOK	797.769	0
OCEANAGOLD CHESS DEPOS. INT.	4.626	AUD	15.867	0
OCI	11.597	EUR	210.080	0
ODAKYU EL.RAILWAY	7.378	JPY	16.120.930	0
ODONTOPREV S.A.	(1.398)	BRL	(18.188)	0
OGE ENERGY CORP	541	USD	19.400	106
OIL SEARCH LTD.	(2.525)	AUD	(16.766)	0
OJI HOLDINGS CORPORATION	828	JPY	468.648	0
OLD REPUBLIC INTL CORP.	20.766	USD	407.429	(10.360)
OLIN CORP	(1.662)	USD	(48.996)	4.167
OLYMPUS CORP	9.568	JPY	38.367.680	0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	(10.963)	USD	(346.321)	16.814
OMNICOM GROUP INC.	4.898	USD	385.669	(796)
OMRON CORP	(203)	JPY	(1.118.530)	0
OMV AG	12.041	EUR	575.801	0
ON SEMICONDUCTOR CORP	(4.291)	USD	(64.150)	556
ONEOK INC (NEW)	489	USD	27.663	153
ONESAVINGS BANK PLC	2.758	GBP	10.900	0
ONEX CORP /SUB.VOT.	14	CAD	1.399	(2)
ONTEX GROUP N.V.	(10.712)	EUR	(310.541)	0
OPEN TEXT CORP	(271)	USD	(9.079)	219
OPKO HEALTH INC	(143.246)	USD	(923.937)	(8.045)
ORACLE CORP	44	USD	2.197	(15)
ORACLE CORP JAPAN TOKY	(6.792)	JPY	(50.328.720)	0
ORANGE BE	8.765	EUR	182.750	0
ORGANIZAC.SORIANA SAB DE CV B	13.913	MXN	613.424	70
ORICA LIMITED	(3.436)	AUD	(68.342)	0
ORIENT CORP	(31.476)	JPY	(5.854.536)	0
ORIENTAL LAND CO LTD	(5.679)	JPY	(45.397.926)	0
ORIGIN ENERGY LTD	20.101	AUD	139.099	0
ORION CORP (NEW)- SHS-B-	23.243	EUR	993.173	0
ORIX CORP	72.494	JPY	126.973.241	0
ORKLA AS A	17.497	NOK	1.417.257	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ORORA LTD	38.349	AUD	105.843	0
ORPEA	2.608	EUR	252.715	0
OSHKOSH CORP	14.878	USD	1.024.499	(32.978)
OSRAM LICHT AKT.	9.839	EUR	693.748	0
OUTFRONT MEDIA SHS	74	USD	1.692	(48)
OUTOKUMPU OYJ A	(84.058)	EUR	(597.652)	0
OUTOTEC OYJ	(19.336)	EUR	(106.541)	0
OWENS CORNING INC	4.024	USD	269.809	(680)
OWENS-ILLINOIS INC.	149	USD	3.561	(7)
PACCAR INC.	15.179	USD	1.039.003	1.099
PACIFIC CORP- USD EQUIV	(133)	USD	(14.447)	437
PACKAGING CORP OF AMERICA	158	USD	17.298	492
PACWEST BANCORP	(3.108)	USD	(149.246)	1.376
PADDY POWER PLC	(3.801)	GBP	(287.736)	0
PAGEGROUP SHS	2.620	GBP	12.830	0
PALO ALTO NETWORKS INC	740	USD	97.517	(3.555)
PANALPINA WELTR./NAMEN-AKT.	(5.925)	CHF	(725.813)	0
PANASONIC CORP	(17.634)	JPY	(26.821.314)	0
PANDORA A/S	(8.255)	DKK	(5.968.365)	0
PARAGON GROUP OF COMPANIES PLC	209.319	GBP	906.351	0
PAREXEL INTERNATIONAL CORP	(13)	USD	(1.138)	(2)
PARGESA HOLDING SA	(11.996)	CHF	(926.091)	0
PARKER-HANNIFIN	(8)	USD	(1.328)	(7)
PARKLAND FUEL CORP	2.793	CAD	74.713	(1.314)
PARSLEY ENERGY SHS -A-	(3.804)	USD	(111.381)	1.208
PARTNERS GROUP HOLDING	2.244	CHF	1.409.232	0
PATRIZIA IMMOBILIEN AG /REG.	(15.538)	EUR	(237.498)	0
PATTERSON COMPANIES INC	3.402	USD	141.931	(4.098)
PATTERSON UTI ENERGY INC	(24.728)	USD	(478.240)	8.346
PAYCHEX INC.	213	USD	12.322	89
PAYCOM SOFTWARE INC	(829)	USD	(58.105)	589
PCCW LTD	(191.539)	HKD	(840.856)	245
PDC ENERGY	3.981	USD	187.744	(711)
PEAB AB / B FRIA	2.020	SEK	191.496	0
PEARSON PLC	(44.530)	GBP	(292.785)	0
PEGASYSTEMS INC.	341	USD	20.613	(307)
PEGATRON CORPORATION - USD EQ.	109.848	USD	358.701	147
PEMBINA PIPELINE CORP	326	CAD	13.852	5
PENNON GROUP PLC	92.313	GBP	743.120	0
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC	634	USD	27.604	(352)
PENTAIR PLC	807	USD	50.897	(10)
PEOPLE S UNITED FINANCIAL INC	715	USD	12.470	(329)
PERKINELMER INC	191	USD	12.574	(123)
PERMAN TSB	38.580	EUR	79.089	0
PERNOD-RICARD	1.638	EUR	192.056	0
PERPETUAL LTD	(1.053)	AUD	(53.155)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
PERRIGO COMPANY PLC	(15.818)	USD	(1.185.085)	20.401
PERSIMMON PLC	14.397	GBP	360.501	0
PERSOL HOLDINGS CO. LTD.	101	JPY	211.090	0
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	8.711	TRY	56.012	0
PETROCHINA CO LTD /-H-	(671.564)	HKD	(3.377.967)	0
PETROFAC LTD	174.001	GBP	777.784	0
PETROLEO BRASILEIRO/PRF.SHS	111.375	BRL	1.480.174	0
PEUGEOT SA	6.078	EUR	110.528	0
PEYTO EXPL	2.519	CAD	55.821	(1.789)
PFEIFFER VACUUM TECHNOLOGY	1.864	EUR	267.018	0
PG&E CORP	1.061	USD	71.819	191
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	(4.132)	PLN	(54.129)	0
PHILIP MORRIS INT.	(115)	USD	(13.422)	115
PHILIPS LIGHTING NEWCO B.V.	33.045	EUR	1.060.745	0
PHILLIPS 66	(528)	USD	(44.220)	358
PHILLIPS-VAN HEUSEN CORP	(95)	USD	(11.333)	21
PHISON ELECTRONICS CORP	14.797	USD	205.820	81
PICC GRP CN SHS -H- INACTIF	179.218	HKD	652.354	0
PICC PROPERTY AND CASUALTY H	(78.467)	HKD	(1.142.480)	0
PICK N PAY STORES LTD	(9.024)	ZAR	(572.212)	0
PILGRIMS PRIDE	(5.664)	USD	(137.579)	(2.293)
PING AN INSUR.(GRP)CO -H-	39.070	HKD	2.264.107	0
PINNACLE FOODS INC	530	USD	31.471	(882)
PIONEER FOODS GROUP LTD	(12.420)	ZAR	(1.740.539)	0
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	(257)	USD	(41.917)	(127)
PKP CARGO S.A.	115	PLN	7.130	0
PLAINS ALLAMERICAN PIPELINE/LP	(87)	USD	(2.294)	10
PLASTIC OMNIUM	6.871	EUR	223.308	0
PLATINUM ASSET MGMT LTD	(6.269)	AUD	(34.291)	0
PLAYTECH LIMITED	12.236	GBP	117.527	0
PNC FINANCIAL SERVICES GP	(114)	USD	(14.683)	(19)
POLA ORBIS HOLDINGS INC	9.357	JPY	28.679.205	0
POLARIS INDUSTRIES INC	(3.358)	USD	(301.078)	13.027
POLISH OIL & GAS CO	(1.759)	PLN	(11.750)	0
POLO RALPH LAUREN	13.053	USD	987.459	8.701
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	1.515	PLN	161.120	0
POLYMETAL	(3.522)	GBP	(32.508)	0
POOL CORP	6.284	USD	679.426	5.324
POPULAR INC	4.266	USD	179.769	(695)
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING/PREF	211	EUR	10.209	0
PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO	34	USD	1.519	0
PORTO SEGURO SA	4.498	BRL	141.687	0
POSCO USD EQUIV	923	USD	273.954	4.415
POST HOLDING SHS-WHEN ISSUED	(1.099)	USD	(91.437)	235
POSTE ITALIANE SPA	(14.510)	EUR	(90.252)	0
POSTNL	102.850	EUR	411.400	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
POTASH CORP SASKATCHEWAN	(58.757)	USD	(1.051.750)	4.966
POU CHEN CORP USD EQUIV	3.443	USD	4.652	2
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	34.311	HKD	2.659.103	439
POWER CORP.CANADA	(49)	CAD	(1.486)	0
POWER FINANCIAL CORP	1.770	CAD	59.791	(203)
POWERTECH TECHNOLOGY USD EQUIV	(53.220)	USD	(172.553)	(67)
POWSZECHNA KASA OSZCZED.POLSKI	(50.793)	PLN	(1.870.706)	0
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN	4.154	PLN	183.981	0
PPG INDUSTRIES INC.	(7.220)	USD	(759.905)	13.345
PPL CORP	1.434	USD	54.965	407
PRA HEALTH SCIENCES INC	13.738	USD	1.022.107	(32.430)
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1.646	CAD	50.960	2.168
PRECINCT PROPER - REIT	12.372	NZD	15.589	0
PREMIER INC	1.754	USD	61.215	(910)
PREMIER INVESTMENTS LTD	73	AUD	996	0
PREMIUM BRANDS HOLDINGS CORP	83	CAD	7.472	1
PRIMARY HEALTH CARE LIMITED	(16.756)	AUD	(56.803)	0
PRIMERICA --- SHS	(1.228)	USD	(99.529)	161
PROBI AB	294	SEK	108.780	0
PROCTER & GAMBLE CO.	107	USD	9.718	180
PROGRESSIVE CORP	6.151	USD	289.897	1.366
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRA	6.702	MXN	1.308.968	(64)
PROOFPOINT INC	70	USD	5.967	225
PROSEGUR COMPANIA DE SEGURIDAD	(1.356)	EUR	(7.851)	0
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA	1.300	EUR	44.005	0
PROSPERITY BANCSHARES INC	(5.740)	USD	(367.934)	10.181
PROVIDENT FINANCIAL	(2.401)	GBP	(49.509)	0
PROXIMUS SA	6.639	EUR	197.145	0
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3.778	USD	427.783	272
PRUDENTIAL PLC	(19.480)	GBP	(359.990)	0
PSG GROUP LTD SOUTH AFRICA	360	ZAR	93.110	0
PSP SWISS PROPERTY/NAM.	(10.465)	CHF	(920.920)	0
PTC INC SHS	(142)	USD	(7.837)	1
PUBL.SERV.ENTERPRISE	(3.761)	USD	(169.132)	(1.249)
PUBLIC STORAGE	1.093	USD	224.688	(2.239)
PUBLICIS GROUPE SA	(3.866)	EUR	(247.076)	0
PUMA SE	282	EUR	95.612	0
PZ CUSSONS PLC	(1.680)	GBP	(6.093)	0
QANTAS AIRWAYS LTD	(58.274)	AUD	(310.018)	0
QBE INSURANCE GROUP	1.927	AUD	22.835	0
QIAGEN NV	(8.383)	EUR	(235.772)	0
QINETIC GROUP PLC	487.441	GBP	1.175.708	0
QINGDAO PORT INT -H-	86.932	HKD	384.239	0
QISDA CORP USD EQUIV	2.031	USD	1.608	1
QORVO INC	(4.649)	USD	(318.735)	3.352
QUALCOMM INC.	(18.799)	USD	(999.919)	1.098

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
QUALICORP SA	(19.145)	BRL	(627.956)	0
QUANTA COMPUTER USD EQUIV	(24.691)	USD	(58.549)	(23)
QUBE HOLDINGS LTD	(34.808)	AUD	(92.589)	0
QUEBECOR INC	(614)	CAD	(26.531)	38
QUEST DIAGNOSTICS INC.	4.440	USD	480.896	(275)
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	(175)	USD	(15.846)	200
RADIAN GROUP INC	6.959	USD	121.226	825
RAIA DROGASIL	12.423	BRL	857.187	0
RAIFFEISEN BANK INTL AG	1.217	EUR	30.328	0
RAKUTEN INC TOKYO	(308.019)	JPY	(415.209.612)	0
RAMSAY HEALTH CARE LTD RHC	(799)	AUD	(56.393)	0
RANDSTAD HOLDING (EUR 0.1)	11.304	EUR	576.278	0
RANGE RESOURCES	(52.114)	USD	(1.100.127)	37.484
RATHBONE BROTHERS PLC	(410)	GBP	(10.963)	0
RATIONAL AG. LANDSBERG AM LECH	(51)	EUR	(27.084)	0
RAYMOND JAMES FIN.INC	3.741	USD	311.214	(6.682)
RAYONIER INC REIT	15	USD	436	(0)
RAYTHEON COMPANY	(853)	USD	(146.520)	(2.191)
REA GROUP LTD	(1.377)	AUD	(95.041)	0
REALOGY HOLDINGS CORP SHS	(2.375)	USD	(78.850)	1.254
REALTEK SEMICONDUCTOR USD EQUIV	(2.328)	USD	(8.712)	(3)
REALTY INCOME CORP	(1.557)	USD	(88.842)	727
RECIPHARM AB	816	SEK	79.152	0
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	(9.291)	GBP	(684.654)	0
RECORDATI IND CHIMICA/POST RAG	11.218	EUR	404.970	0
RECRUIT HOLDINGS CO.LTD.	26.009	JPY	49.651.181	0
RED ELECTRICA CORPORACION. SA	(22.112)	EUR	(400.669)	0
RED HAT INC	(579)	USD	(57.246)	608
RED ST /H	(6.198)	HKD	(50.266)	0
REDEFINE PROPERTIES LTD /REIT	237.963	ZAR	2.562.862	0
REDES ENERGETICAS NACIONAIS	171.908	EUR	471.028	0
REDROW PLC	109.381	GBP	647.536	0
REFRESCO GERBER UNIT 144A REGS	(1.123)	EUR	(18.541)	0
REGAL BELOIT CORP	(976)	USD	(81.350)	1.780
REGENCY CENTERS CORP.	(15.999)	USD	(1.059.454)	(18.077)
REGIONS FINANCIAL CORP	14.668	USD	214.153	1.014
REGIS RESOURCES LTD	(4.019)	AUD	(15.393)	0
REINSURANCE GRP AMERICA INC	1.959	USD	274.652	8.260
RELIANCE STEEL & ALUMINIUM CO	(262)	USD	(18.958)	445
RELIANCE WORLDWIDE CORP LTD	(12.455)	AUD	(41.600)	0
RELO HOLDINGS INC	(34.643)	JPY	(76.664.959)	0
RELX PLC	29.497	GBP	487.290	0
REMGRO LTD	(1.546)	ZAR	(330.458)	0
REMY COINTREAU SA	223	EUR	21.691	0
RENAISSANCERE HLD LTD	(286)	USD	(42.016)	(345)
RENAULT SA	5.294	EUR	403.191	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
RENESAS ELECTRONICS CORP	(8.998)	JPY	(9.348.922)	0
RENEWABLES INFR GRP -GBP-	36.413	GBP	39.945	0
RENISHAW PLC	(464)	GBP	(19.349)	0
RENTOKIL INITIAL PLC	29.350	GBP	85.291	0
REPLY SPA TORINO	1.060	EUR	189.422	0
REPUBLIC SERVICES INC.	752	USD	48.293	(71)
RESILIENT /REIT	18.716	ZAR	2.452.545	0
RESMED INC	279	USD	21.516	(156)
RESTAURANT BRANDS INTL INC	1.716	CAD	127.464	(3.894)
RETAIL PRPTIES OF AMERICA/REIT	9.392	USD	124.256	1.590
RHEINMETALL AG DUESSELDORF	7.850	EUR	662.540	0
RHOEN KLINIKUM AG	(4.775)	EUR	(127.111)	0
RICOH CO.LTD	(137.985)	JPY	(143.090.445)	0
RIGHT AEDIFICA SICAFI SA	4.201	EUR	0	0
RIO TINTO LIMITED	56	AUD	3.684	0
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT	2.429	CAD	58.515	(142)
RITE AID CORP.	(700.541)	USD	(1.569.212)	99.839
RMB HOLDINGS LTD	(4.520)	ZAR	(287.427)	0
ROBERT HALF INTL INC.	7.785	USD	352.271	23
ROCHE HOLDING AG /GENUSSSCHEIN	(1.373)	CHF	(336.248)	0
ROCKET INTERNET SE	699	EUR	12.173	0
ROCKWELL AUTOMATION	1.154	USD	190.445	1.556
ROCKWELL COLLINS INC	(2.662)	USD	(283.583)	(1.242)
ROGERS COMMUN./B. N-V. *OPR*	(60)	CAD	(3.890)	0
ROLLINS INC	849	USD	36.855	1.528
ROLLS ROYCE HLD	(34.301)	GBP	(304.593)	0
ROPER TECHNOLOGIES INC	(94)	USD	(21.851)	90
ROSS STORES INC	27.258	USD	1.507.913	35.352
ROYAL BANK OF CANADA	98	CAD	9.115	(71)
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A-	(3.751)	EUR	(89.705)	0
ROYAL GOLD INC	(2.176)	USD	(188.572)	(1.324)
ROYAL MAIL PLC	268.502	GBP	1.082.332	0
ROYAL PHILIPS NV /EUR 0.2	24.604	EUR	796.678	0
RPC INC	(685)	USD	(14.186)	369
RPM INTERNATIONAL INC	18	USD	934	(2)
RSA INSURANCE GROUP PLC	(119.090)	GBP	(777.062)	0
RSP PERMIAN INC	(2.518)	USD	(86.518)	657
RTL GROUP SA	(9)	EUR	(592)	1
RUBIS SHS	2.263	EUR	121.659	0
RUENTEX INDUSTRIES LIMITED-USD EQ	117	USD	174	0
RUNTEX DEVELOPMENT CO LTD-USD EQ	73.844	USD	79.970	34
RWE	2.106	EUR	37.518	0
RYANAIR HOLDINGS PLC	70.712	EUR	1.256.552	417
RYDER SYSTEM INC.	3.910	USD	284.492	(4.758)
RYOHIN KEIKAKU CO LTD	(51)	JPY	(1.438.200)	0
SA D IETEREN NV	49	EUR	1.962	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SA DES CIMENTS VICAT-VICAT	(355)	EUR	(21.904)	0
SAAB AB B	8.808	SEK	3.300.358	0
SABANCI HOLDING	(182.768)	TRY	(1.975.722)	0
SABESP.CIA SANEAM.BASESTADO	17.719	BRL	594.472	0
SABRE CORP	(24)	USD	(531)	(1)
SACYR SA	117.975	EUR	266.388	0
SAGA PLC	(6.889)	GBP	(14.377)	0
SAGE GRP	152	GBP	1.024	0
SAINT-GOBAIN	6.882	EUR	322.697	0
SAIPEM SPA	(1.413)	EUR	(4.889)	0
SALESFORCE COM INC	(2.040)	USD	(185.232)	(107)
SALINI IMPREG AZ. POST RAGRUPP	(1.448)	EUR	(4.303)	0
SALMAR ASA	3.479	NOK	711.456	0
SALVATORE FERRAGAMO SPA	(16.575)	EUR	(406.253)	0
SALZGITTER AG	2.514	EUR	95.318	0
SAM YANG CORP	524	USD	53.872	132
SAMLIP GENERAL FOODS CO. LTD - USD CFD	7	USD	1.033	(10)
SAMPO PLC A	1.354	EUR	62.595	0
SAMSONITE INTERNATIONAL	(121.719)	HKD	(3.986.297)	0
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO- USD EQUIV	1.290	USD	108.060	(4.586)
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD -USD EQUIV	30	USD	64.636	160
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD- USD EQUIV	(214)	USD	(1.951)	186
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES- USD EQUIV	(19.758)	USD	(197.833)	15.401
SAMSUNG LIFE-USD EQ	2.076	USD	232.921	(2.172)
SAMSUNG SDI CO LTD- USD EQUIV	(670)	USD	(100.928)	1.559
SAMSUNG SDS CO.LTD	(37)	USD	(5.921)	(212)
SAMSUNG SECURITIES CO LTD USD EQUIV	(1.169)	USD	(42.378)	(840)
SAMSUNG TECHWIN CO LTD- USD EQUIV	(1.026)	USD	(36.598)	(111)
SANDS CHINA /IPO	(175.913)	HKD	(6.376.846)	0
SANDVIK AB	5.515	SEK	702.060	0
SANEPAR /PREF	(18.499)	BRL	(196.089)	0
SANKYU INC	41.696	JPY	34.691.072	0
SANOFI	28	EUR	2.260	0
SANOMA CORPORATION	11.462	EUR	90.091	0
SANRIO CO LTD	(2.416)	JPY	(5.351.440)	0
SANTAM LTD	116	ZAR	28.118	0
SANTANDER BR/UNITS(55SH+50PFD)	12.328	BRL	314.487	0
SANTANDER USA	(5.809)	USD	(74.413)	4.322
SANTEN PHARMACEUTICAL	(131.256)	JPY	(204.365.592)	0
SANTOS LTD	(163.803)	AUD	(555.292)	0
SANWA HOLDINGS CORP	(3.472)	JPY	(4.145.568)	0
SAO MARTINHO SA	(20.700)	BRL	(363.492)	0
SAP SE	(2.316)	EUR	(207.699)	0
SAPPI	217.366	ZAR	18.978.225	0
SAPUTO GRP I./WHEN ISSUED	6.201	CAD	262.054	6.947
SARAS RAFFINERIE SARDE	61.854	EUR	120.182	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SARTORIUS AG /VORZUG.	(1.528)	EUR	(122.164)	0
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	834	EUR	50.223	0
SASOL LTD /REG.	(4.379)	ZAR	(1.738.507)	0
SAVILLS PLC	20.934	GBP	191.337	0
SBA COMMUNICATIONS CORP/REIT	325	USD	44.704	168
SBM OFFSHORE NV	32.433	EUR	473.846	0
SCANA CORPORATION	1.308	USD	84.196	29
SCANDIC HOTELS GROUP AB	45.177	SEK	5.071.118	0
SCENTRE GROUP /REIT	(8.853)	AUD	(36.563)	0
SCHAEFFLER AG /PFD	90.882	EUR	1.071.499	0
SCHIBSTED -A-	(33.044)	NOK	(6.631.931)	0
SCHINDLER HOLDING/PARTIC	464	CHF	96.790	0
SCHLUMBERGER LTD	13.255	USD	909.293	21.284
SCHNEIDER ELECTRIC SE	(10.264)	EUR	(681.016)	0
SCHOELLER-BLECKMANN OIL	(22)	EUR	(1.408)	0
SCHRODERS PLC	3.248	GBP	111.894	0
SCOR SE	389	EUR	13.854	0
SCOUT24 HOLDING GMBH	15	EUR	483	0
SCREEN HLDG --- SHS	3.324	JPY	24.597.600	0
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE I	268	USD	23.426	286
SCSK --- SHS	(8.097)	JPY	(37.772.505)	0
SEAGATE TECHNOLOGIE PLC	(4.765)	USD	(157.054)	(2.201)
SEAH BESTEEL CORP - USD EQ	748	USD	23.305	1.528
SEALED AIR CORP (NEW)	2.204	USD	95.896	(466)
SEATTLE GENETICS INC	(3.422)	USD	(172.811)	2.954
SEB SA	245	EUR	36.836	0
SECOM LTD	3.973	JPY	32.884.521	0
SEEK LTD	(47.505)	AUD	(812.336)	0
SEGA SAMMY HOLDING INC	378	JPY	562.086	0
SEGRO PLC /REIT	(4.705)	GBP	(24.795)	0
SEI INVESTMENTS CO	(274)	USD	(15.484)	60
SEIBU HOLDINGS INC	26.705	JPY	51.433.830	0
SEIKO EPSON CORP	(15.093)	JPY	(43.935.723)	0
SEINO HOLDINGS CO LTD	16.643	JPY	24.731.498	0
SEKISUI CHEMICAL CO LTD	7.629	JPY	15.502.128	0
SEKISUI HOUSE LTD	8.588	JPY	16.415.962	0
SEMICONDUCT	(550.508)	HKD	(4.734.369)	0
SEMPRA ENERGY	(3.159)	USD	(356.999)	(727)
SENIOR HSG PR./SHS OF BEN.INT	31.483	USD	612.344	5.321
SENSATA TEC	(22.921)	USD	(1.034.196)	35.115
SENSIENT TECHNOLOGIES CO	4.850	USD	360.646	(7.245)
SER EDUCACIONAL SA	(11.400)	BRL	(291.726)	0
SERCO GROUP PLC	(221.171)	GBP	(245.500)	0
SERVICE CORP INTERNATIONAL	1.009	USD	35.043	(438)
SERVICEMAST	(387)	USD	(17.013)	(764)
SERVICENOW INC	8.256	USD	911.875	(397)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SES SA /FDR	(352)	EUR	(6.996)	0
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	1.517	CAD	32.873	362
SEVEN GROUP HOLDINGS	19.948	AUD	238.578	0
SEVEN WEST MEDIA	(22.738)	AUD	(18.418)	0
SEVERN TRENT PLC	52.168	GBP	1.168.563	0
SFR GROUP SA	(62.645)	EUR	(1.973.318)	0
SFS GROUP LTD	352	CHF	38.720	0
SGCLN	9.459	GBP	17.055	0
SGS SA /NOM.	(115)	CHF	(245.870)	0
SHAFTESBURY PLC /REIT	543	GBP	5.338	0
SHANGDONG WEIGAO MED.POLY -H-	(1.827)	HKD	(11.510)	0
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	7.518	HKD	169.531	(48)
SHANGRI-LA ASIA LTD	28.182	HKD	357.911	0
SHARP CORP.	216.474	JPY	83.991.912	0
SHAW COMMUNICATIONS -B/NON-VOT	4.553	CAD	126.391	388
SHELL MIDST /LP	1.013	USD	28.952	(316)
SHENZHEN INTL HOLD	(7.549)	HKD	(100.553)	58
SHENZHOU INTL GROUP LTD	(36.442)	HKD	(1.904.095)	0
SHERWIN-WILLIAMS CO	(720)	USD	(242.834)	(790)
SHIMAMURA CORP.	11.037	JPY	151.427.640	0
SHIMANO INC.	(4.653)	JPY	(75.285.540)	0
SHIMAO PROPERTY HLD LTD	(13.039)	HKD	(203.148)	0
SHIN KONG FINL HLDGS USD EQUIV	(235.323)	USD	(62.893)	(15)
SHIN-ETSU CHEMICAL CO	6.903	JPY	69.789.330	0
SHINHAN FINANCIAL GROUP USD EQUIV	7.175	USD	341.249	3.445
SHINSEGAE CO LTD- USD EQUIV	537	USD	114.259	(1.379)
SHIONOGI & CO LTD	31.055	JPY	183.100.280	0
SHIRE PLC	(35.643)	GBP	(1.518.748)	0
SHISEIDO CO.LTD	(11.764)	JPY	(45.879.600)	0
SHOCHIKU CO LTD	(2.137)	JPY	(3.231.144)	0
SHOPRITE HOLDINGS LTD	(265)	ZAR	(53.445)	0
SHOWA DENKO KK	3.950	JPY	11.399.700	0
SIAS	(365)	EUR	(4.241)	0
SIBANYE GOLD	(111.148)	ZAR	(1.868.398)	0
SIEMENS AG /NAM.	(1.119)	EUR	(128.405)	0
SIGNET JEWELERS LTD	(17.671)	USD	(1.080.758)	4.146
SILGAN HOLDINGS INC	124	USD	3.757	24
SILTRONIC AG	5.085	EUR	467.820	0
SIMON PROPERTY/PAIRED SHS	1.084	USD	171.814	(1.894)
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	7.171	AUD	111.437	0
SINA CORPORATION	7.285	USD	690.691	3.793
SINO BIOPHARMA	(444.147)	HKD	(3.051.290)	1.706
SINO LAND CO LTD	(40.994)	HKD	(527.183)	210
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	(181.740)	HKD	(794.204)	0
SINOPAC HOLDINGS USD EQUIV	(119.897)	USD	(37.603)	(15)
SINOPEC ENGINEERING GRP CO LTD	(47.707)	HKD	(333.949)	61

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SINOPHARM GROUP CO -H-	(34.976)	HKD	(1.145.464)	0
SIRIUS MINERALS PLC	108.153	GBP	32.662	0
SIRIUS XM HOLDINGS INC	8.694	USD	50.947	4.086
SIX FLAGS ENTMT	60	USD	3.412	(54)
SIXT SE	5.573	EUR	332.820	0
SJM HOLDINGS LTD	(50.233)	HKD	(392.822)	0
SK C&C CO LTD-USD EQ	78	USD	18.932	357
SK CHEMICALS EQ USD	(382)	USD	(23.393)	389
SK GAS	(8)	USD	(822)	(44)
SK NETWORKS CO LTD- USD EQUIV	(942)	USD	(5.331)	(31)
SKANDINAV.ENSK.BANKEN A	55.711	SEK	5.699.235	0
SKANSKA B	(50.353)	SEK	(9.244.811)	0
SKC /USD-EQUIV	(236)	USD	(7.648)	(72)
SKECHERS USA INC /-A-	2.129	USD	59.804	(1.842)
SKF AB B	5.198	SEK	834.799	0
SKISTAR AB -B-	2.292	SEK	411.414	0
SKY NETWORK TELEVISIO.LTD*OPA*	(35.171)	NZD	(116.416)	0
SKYCITY ENTERT SHS	(32.526)	NZD	(131.405)	0
SKYLARK CO.LTD	18.246	JPY	30.397.836	0
SKYWORKS SOLUTIONS INC *OPA*	(1.685)	USD	(176.706)	2.196
SL GREEN REALTY CORPORATION	2.908	USD	300.309	3.878
SLM CORP	1.746	USD	19.346	10
SMC CORP	5.364	JPY	188.330.040	0
SMILES SA	8.367	BRL	544.608	0
SMITH AND NEPHEW PLC	3.818	GBP	50.398	0
SMITH CORP..A.O.	6.596	USD	353.216	(1.555)
SMITHS GROUP PLC	1.994	GBP	30.608	0
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	(210)	EUR	(5.275)	0
SNAM AZ	(108.987)	EUR	(435.512)	0
SNAP-ON INC	(89)	USD	(13.724)	(33)
SNYDER S-LANCE INC	(1.298)	USD	(45.157)	1.092
SOC.DE INVESTIMENTO E GESTAO	15.447	EUR	253.408	0
SODA SANAYII AS	480.832	TRY	2.740.742	0
SODEXO	54	EUR	5.391	0
SOFTBANK GROUP SHS	(13.680)	JPY	(122.545.440)	0
SOFTWARE AG	(426)	EUR	(15.747)	0
SOHGO SECURITY SERVICES CO	183	JPY	855.525	0
SOHO CHINA LTD	(28.633)	HKD	(121.977)	0
SOITEC	5.561	EUR	297.792	0
SOLVAY SA	860	EUR	104.318	0
SOMFY SA	6	EUR	480	0
SOMPO HLDGS SHS	1.939	JPY	8.399.748	0
SONAE SGPS SA	(5.898)	EUR	(5.733)	0
SONIC HEALTHCARE	(7.184)	AUD	(160.131)	0
SONOCO PRODUCTS CO	2.127	USD	103.117	(727)
SONOVA HOLDING AG /NOM.	(1.379)	CHF	(216.365)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SONY CORP JPY 50	3.514	JPY	15.953.560	0
SONY FINANCIAL HOLDING INC	(3.373)	JPY	(6.445.803)	0
SOPHOS GROUP PLC	10.166	GBP	45.899	0
SOPRA STERIA ACT.	(852)	EUR	(124.435)	0
SOTETSU HOLDINGS INC	23.175	JPY	12.514.500	0
SOUTH32 LTD	10.085	AUD	29.347	0
SOUTHERN CO.	(96)	USD	(4.601)	(34)
SOUTHWEST AIRLINES CO	9.536	USD	529.343	(25.388)
SOUTHWEST GAS HOLDINGS INC	(6.328)	USD	(506.873)	13.580
SOUTHWESTERN ENERGY CO	(88.712)	USD	(505.658)	19.616
SPAR GROUP LTD	24.768	ZAR	4.090.435	0
SPARK INFRASTRUCTUR GROUP	1.569	AUD	3.923	0
SPBK 1 SR-BANK	11.144	NOK	874.804	0
SPECTRA ENERGY PARTNERSHIP UNT	(726)	USD	(32.815)	188
SPIE SA	(622)	EUR	(14.760)	0
SPIN MASTER CORP	30	CAD	1.147	9
SPIRE HEALTHCARE GROUP PLC	(25.473)	GBP	(87.882)	0
SPIRIT AEROSYSTEMS HLDG /-A-	154	USD	9.306	(62)
SPIRIT AIRLINES INC	4.697	USD	182.478	(18.785)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	(6.216)	USD	(49.293)	853
SPLUNK INC	(2.258)	USD	(135.503)	3.685
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	7.428	GBP	28.160	0
SPTRM BRD HLDGS	(2.961)	USD	(341.818)	714
SQUARE ENIX HOLDINGS CO LTD	(4.269)	JPY	(15.432.435)	0
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	(2)	USD	(78)	2
SSAB CORPORATION /-A-	21.037	SEK	858.099	0
SSANGYONG MOTOR CO	4.096	USD	22.850	(661)
SSE PLC	12.447	GBP	171.644	0
SSP GROUP PLC	3.017	GBP	15.372	0
ST BARBARA LTD	21.003	AUD	56.918	0
ST JAMES PLACE PLC	16.721	GBP	203.495	0
STABILUS SA	(74)	EUR	(5.201)	0
STANDARD BANK GROUP LIMITED	(7.679)	ZAR	(1.257.283)	0
STANDARD CHARTERED PLC	(31.265)	GBP	(264.721)	0
STANDARD FOOD CORPORATION	(1.420)	USD	(3.781)	(2)
STANDARD LIFE ORD GBP0.1222222	2.080	GBP	9.077	0
STANLEY BLACK & DECKER INC	412	USD	57.964	(448)
STANTEC INC	200	CAD	6.344	(106)
STARBUCKS CORP.	(4.222)	USD	(227.904)	16.772
START TODAY	36.034	JPY	112.245.910	0
STARWOOD PROPERTY TRUST	(15.674)	USD	(345.455)	(2.822)
STATOIL ASA	(30.768)	NOK	(4.535.203)	0
STE CATTOLICA DI ASSICURAZIONI	(1.846)	EUR	(13.485)	0
STE GEN.PARIS -A-	(14.680)	EUR	(728.128)	0
STEADFAST GROUP LTD SHS	13.387	AUD	34.672	0
STEEL DYNAMICS INC.	2.969	USD	105.132	(6.734)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
STEINHOFF IN HD	(8.124)	EUR	(34.771)	0
STELLA JONES	(151)	CAD	(6.588)	0
STERICYCLE INC	(1.734)	USD	(133.657)	(902)
STMICROELECTRONICS NV	70	EUR	1.010	0
STOCKLAND /UNITS	47.823	AUD	200.857	0
STORA ENSO AB /-R-	47.856	EUR	540.773	0
STORE CAPITAL CORP /REIT	(6.438)	USD	(150.585)	(224)
STOREBRAND AS /BUNDNA	15.204	NOK	998.143	0
STRABAG SE	(23)	EUR	(862)	0
STRAUMANN HOLDING AG/NOM.	121	CHF	66.127	0
STRYKER CORP.	(23)	USD	(3.383)	(24)
SUBARU SHS	(23.122)	JPY	(92.349.268)	0
SUBSEA 7 SA	28.947	NOK	3.369.431	0
SUEDZUCKER AKT.	30.054	EUR	541.874	0
SUGI HOLDINGS CO LTD	(3.572)	JPY	(20.110.360)	0
SUL AMER/UNITS(1SH+2PREF)	2.200	BRL	38.610	0
SULZER AG/ NAMENSAKTIEN	(39)	CHF	(4.232)	0
SUMCO CORP	773	JPY	1.388.308	0
SUMI DAI PHARMA SHS	8.377	JPY	12.967.596	0
SUMITOMO CHEMICAL CO.LTD	11.792	JPY	7.641.216	0
SUMITOMO FORESTRY CO.	6.877	JPY	11.622.130	0
SUMITOMO METAL MINING CO.LTD	(66.847)	JPY	(111.534.220)	0
SUMITOMO OSAKA CEMENT CO LTD	(15.715)	JPY	(8.124.655)	0
SUMITOMO REALTY+DEVELPMNT	39.398	JPY	131.707.514	0
SUMITOMO RUBBER IND.	(722)	JPY	(1.383.352)	0
SUN COMMUNITIES INC	3.828	USD	340.730	1.853
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	16.023	HKD	1.930.772	(1.026)
SUN LIFE FINANCIAL INC	(13)	CAD	(621)	2
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	(64.038)	HKD	(1.331.990)	0
SUNCOR ENERGY	(3.988)	CAD	(162.192)	(241)
SUNCORP GROUP LTD	(8.682)	AUD	(124.066)	0
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY	46.622	HKD	4.335.846	0
SUNRISE	4.850	CHF	369.570	0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3.983	USD	64.843	904
SUNTORY B & F	(259)	JPY	(1.401.190)	0
SUPER RETAIL GROUP LTD	19.413	AUD	162.875	0
SUPERGROUP PLC	446	GBP	6.681	0
SUZANO PAPEL E CELULOSE-A-/PFD	51.915	BRL	727.848	0
SUZUKEN CO	736	JPY	2.712.160	0
SUZUKI MOTOR CORP	41.830	JPY	218.770.900	0
SVB FINANCIAL GROUP	1.997	USD	356.345	1.259
SVENSKA CELLUL.-B-	59.260	SEK	3.961.531	0
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	60.706	SEK	7.296.861	0
SWECO AB -B-	5.028	SEK	992.024	0
SWEDBANK AB -A-	15.641	SEK	3.297.123	0
SWEDISH MATCH AB	3.571	SEK	1.014.164	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	3.757	SEK	462.111	0
SWIRE PACIFIC LTD A	1.494	HKD	116.084	(38)
SWIRE PROPERTIES LTD	13.485	HKD	364.095	0
SWISS LIFE HOLDING /NAM	61	CHF	21.533	0
SWISS PRIME SITE AG /NOM.	2.768	CHF	241.508	0
SWISS RE-NAMEN	(4.654)	CHF	(433.986)	0
SWISSCOM /NAM.	(725)	CHF	(342.708)	0
SYDNEY AIRPORT-STAPLED SECURITY	24.880	AUD	167.442	0
SYMANTEC CORP.	(373)	USD	(11.559)	58
SYMRISE AG	588	EUR	34.827	0
SYNCHRONY FINANCIAL	5.127	USD	155.451	(439)
SYNNEX CORP	69	USD	8.205	(151)
SYNNEX TECHNOLOGY INTL USD EQUIV	17.230	USD	19.173	8
SYNOPSYS INC.	11.999	USD	918.763	1.701
SYNOVUS FINANCIAL CORP	277	USD	12.044	(173)
SYNTHOMER SHS	54.711	GBP	268.631	0
SYNTHOS S.A	312.930	PLN	1.389.409	0
SYSCO CORP.	(10.414)	USD	(547.985)	(5.301)
T ROWE PRICE GROUP INC.	(5.664)	USD	(468.526)	9.961
T&D HOLDINGS INC TOKYO	4.428	JPY	7.226.496	0
TABCORP HOLDINGS LTD	(2.766)	AUD	(11.562)	0
TABLEAU SOFTWARE INC	(1.795)	USD	(115.688)	783
TAESA (1 SH +2 PFD SH)	(8.038)	BRL	(186.642)	0
TAG IMMOBILIEN AG	24.339	EUR	337.582	0
TAHOE RESOURCES INC	16.301	CAD	111.173	(992)
TAIHEIYO CEMENT CORP. TOKYO	(47.640)	JPY	(19.770.600)	0
TAIMED BIOLOGICS INC	14.488	USD	106.039	42
TAISEI CORP.	63.993	JPY	67.576.608	0
TAISHIN FINANCIAL HLDGS USD EQUIV	(100.501)	USD	(47.263)	(18)
TAISHO PHARMACEUTICAL HOLDINGS	3.799	JPY	31.417.730	0
TAIWAN CEMENT CORP-USD EQUIV	161	USD	187	0
TAIWAN MOBILE USD EQUIV	(19.185)	USD	(68.620)	(28)
TAIWAN SECOM USD EQUIV	17.527	USD	51.893	20
TAIWAN SEMICONDUCTOR MFG USD EQUIV	(148.295)	USD	(1.053.460)	(417)
TAIYO NIP.SANSO CORP	2.387	JPY	3.050.586	0
TAIYO YUDEN CO LTD	(48.347)	JPY	(89.828.726)	0
TAKARA HOLDINGS INC	280	JPY	308.560	0
TAKASHIMAYA CO LTD	63.941	JPY	64.580.410	0
TAKE TWO INTERACT. SOFTWARE	(3.504)	USD	(278.498)	5.957
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	(10)	JPY	(58.320)	0
TAKKT AG. STUTTGART	717	EUR	14.867	0
TALANX AG - NAMEN-AKT	14.187	EUR	494.630	0
TARGA RESOURCES	6.505	USD	301.897	(1.446)
TARGET CORP	(21.142)	USD	(1.198.117)	(33.638)
TARKETT SA	284	EUR	9.933	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
TATE + LYLE PLC	68.905	GBP	463.042	0
TAURON POLSKA ENERGIA SA	5.982	PLN	22.791	0
TAV HAVALIMALARI HOLDING AS	(36.262)	TRY	(773.106)	0
TAYLOR WIMPEY PLC	59.847	GBP	113.949	0
TC PIPELINES /PARTNERSHIP	6.075	USD	348.037	(1.233)
TCC INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	444.400	HKD	1.586.508	0
TD AMERITRADE HOLDING CORP NEW	1.542	USD	70.516	(1.898)
TECH DATA CORP	502	USD	51.405	(951)
TECHNICOLOR /PROV.REGRPMT	32.024	EUR	98.378	0
TECHNOGYM S.P.A.	608	EUR	3.794	0
TECHNOLOGY ONE LIMITED	1.232	AUD	6.616	0
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	8.592	HKD	298.142	(55)
TECK RESOURCES / -B-	(5.231)	CAD	(141.551)	(6.652)
TECNICAS REUNIDAS SA	20.223	EUR	605.982	0
TECO ELECTRIC & MACH. USD EQUIV	(13)	USD	(12)	(0)
TED BAKER PLC LONDON	48	GBP	1.209	0
TEGNA INC	61.966	USD	918.956	(28.542)
TEIJIN LTD	41	JPY	90.938	0
TELECOM ITALIA SPA	1.380.239	EUR	1.201.498	0
TELECOM SAO PAULO / PFD	(11.327)	BRL	(529.084)	0
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	(825)	USD	(112.481)	483
TELEFLEX INC	(129)	USD	(26.731)	1.065
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLD	(2.072)	EUR	(9.048)	0
TELEFONICA SA	(50.735)	EUR	(485.027)	0
TELEKOM AUSTRIA AG	(350)	EUR	(2.672)	0
TELENET GROUP HOLDING	547	EUR	32.268	0
TELENOR AS	(1.994)	NOK	(313.656)	0
TELEVISION FRANCAISE 1	(13.704)	EUR	(169.793)	0
TELIASONERA AB	(89.982)	SEK	(3.414.817)	0
TELKOM SA SOC --- SHS	156.602	ZAR	10.186.960	0
TELSTRA CORPORATION LTD	(164.881)	AUD	(676.012)	0
TELUS CORP	4.825	CAD	217.270	2.038
TEMENOS GROUP AG /NAMEN.	(430)	CHF	(40.205)	0
TENARIS SA	2.789	EUR	37.345	0
TENCENT HOLDINGS LTD	(15.152)	HKD	(4.736.515)	1.552
TERADATA	(187)	USD	(5.950)	16
TERADYNE INC	(21.312)	USD	(737.182)	30.166
TERNA- RETE ELETTRICA NAZIONAL	151.037	EUR	728.905	0
TERUMO CORP.	44	JPY	183.700	0
TESARO INC SHS	(724)	USD	(92.426)	869
TESCO PLC	(341.665)	GBP	(595.180)	0
TESLA INC	(1.066)	USD	(344.819)	16.406
TESORO CORP.	315	USD	31.352	545
TESORO LOGISTIC/PARTNERSHIP	(131)	USD	(6.829)	1
TEXAS INSTRUMENTS INC	4.890	USD	397.948	(54)
TEXAS ROADHOUSE INC	4.511	USD	213.370	(3.367)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
TFS FINANCIAL CORP	409	USD	6.536	20
TGS NOPEC GEOPHYSICAL CO	26.942	NOK	4.477.760	0
THE FOSCHINI GROUP	(2.519)	ZAR	(382.107)	0
THE GEO GROUP REIT INC	2.041	USD	59.903	(1.501)
THE HERSHEY CO	2.202	USD	231.893	(3.613)
THE HOWARD HUGHES	(132)	USD	(16.607)	(47)
THE KOREA EXPRESS CO LTD-USD EQ	(77)	USD	(12.838)	(515)
THE KRAFT HEINZ COMPANY	(1.922)	USD	(168.098)	310
THE MICHAELS COMPANIES INC	(3.997)	USD	(80.500)	(878)
THE PRICELINE GROUP INC SHS	363	USD	736.346	4.560
THE SCOTTS MIRACLE-GRO CO A	(10.834)	USD	(1.039.956)	2.848
THE STAR ENTERTAINMENT GRP LTD	(71.431)	AUD	(360.012)	0
THE SWATCH GROUP AG	(2.068)	CHF	(793.905)	0
THE ULTIMATE SOFTWARE GROUP	(5.177)	USD	(1.168.501)	29.650
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	(1.063)	USD	(186.588)	4.748
THK CO LTD	893	JPY	3.013.875	0
THOMAS COOK GP	(162.762)	GBP	(178.875)	0
THOMSON-REUTERS CORP	2.774	CAD	158.395	(1.601)
THOR INDUSTRIES INC.	3.543	USD	373.255	(6.066)
THULE GROUP AB	903	SEK	141.952	0
THYSSENKRUPP AG DUESSELDORF	10.016	EUR	251.251	0
TIETO CORPORATION	1.780	EUR	47.704	0
TIFFANY & CO	265	USD	25.310	146
TIGER BRANDS LTD	689	ZAR	275.256	0
TIM PARTICIPACOES SA	34.287	BRL	364.814	0
TIMKEN CO	(1.990)	USD	(90.545)	6.074
TINGYI HLD CORP.(CAYMAN ISL.)	16.178	HKD	161.133	21
TIS INC	974	JPY	3.248.290	0
TKH GROUP CERT	(1.239)	EUR	(64.044)	0
TLG IMMOBILIEN AG	1.406	EUR	25.744	0
T-MOBILE US INC	(893)	USD	(55.062)	617
TMX GROUP LTD	47	CAD	3.107	(2)
TOBU RAILWAY CO.LTD	21.382	JPY	12.487.088	0
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI	(248)	TRY	(7.663)	0
TOHO CO LTD .TOKYO	300	JPY	1.192.500	0
TOHO HOLDINGS CO LTD	1.561	JPY	3.409.224	0
TOHOKU ELECTR.POWER JPY 500	(24.473)	JPY	(36.758.446)	0
TOKAI RIKA CO LTD	7.536	JPY	15.305.616	0
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	(249)	JPY	(1.156.605)	0
TOKYO EL HLDG SHS	521.562	JPY	244.091.016	0
TOKYO ELECTRON CO LTD	3.473	JPY	54.091.975	0
TOKYO TATEMONO CO LTD	11.604	JPY	17.429.208	0
TOKYU CORP	15.366	JPY	24.939.018	0
TOKYU FUDOS HLDG CRP/REIT	56.716	JPY	37.545.992	0
TOLL BROTHERS	905	USD	34.924	(605)
TOMRA SYSTEMS AS	473	NOK	52.976	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
TOMTOM NV	49.243	EUR	442.350	0
TONG YANG LIFE INSURANCE	28.232	USD	245.579	(3.149)
TONGAAT HULETT LIMITED	41.007	ZAR	4.869.991	0
TOPCON CORP	15.180	JPY	28.690.200	0
TORAY INDUSTRIES INC.	(1.450)	JPY	(1.445.650)	0
TORCHMARK CORP.	3.385	USD	267.313	642
TORO CO	5.087	USD	361.635	(2.135)
TOROMONT INDUSTRIES LTD	73	CAD	3.379	0
TORONTO DOMINION BK	2.627	CAD	168.837	(541)
TOSOH CORP	66.017	JPY	86.812.355	0
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	(197)	USD	(12.502)	(37)
TOTVS SA	12.087	BRL	362.610	0
TOURMALINE OIL CORP	476	CAD	13.161	374
TOYO SEIKAN KAISHA LTD	40.795	JPY	73.798.155	0
TOYO SUISAN KAISHA	5.658	JPY	22.688.580	0
TOYOTA INDUSTRIES CORP	(6.822)	JPY	(40.454.460)	0
TOYOTA MOTOR CORP	(4.281)	JPY	(26.687.754)	0
TOYOTA TSUSHO CORP.	2.534	JPY	8.995.700	0
TP ICAP PLC	17.691	GBP	86.137	0
TPG TELECOM	(7.864)	AUD	(44.117)	0
TPK HOLDINGS CO / USD EQUIV	30.796	USD	103.520	42
TRACTOR SUPPLY CO	(36.749)	USD	(2.062.354)	(87.939)
TRADE ME GROUP	(3.470)	AUD	(17.766)	0
TRAN PAULIST PREF	(4.200)	BRL	(294.000)	0
TRANSALTA RENEWABLES INC SHS	1.368	CAD	20.000	42
TRANSCEND INFORMATION USD EQUIV	5.236	USD	15.520	6
TRANSDIGM GROUP INC	(3.830)	USD	(1.080.596)	20.545
TRANSOCEAN LTD	(36.145)	USD	(312.654)	3.495
TRANSUNION	(74)	USD	(3.391)	(10)
TRANSURBAN GROUP	(301)	AUD	(3.434)	0
TRAVELERS COMPANIES INC *OPR*	(401)	USD	(51.364)	(798)
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD -H-	(13.824)	HKD	(284.774)	177
TRAVIS PERKINS PLC	(73.821)	GBP	(1.120.603)	0
TREASURY WINE ESTATES	731	AUD	8.904	0
TREEHOUSE FOODS /WHEN ISSUED	(638)	USD	(54.122)	333
TRELLEBORG B	(4.762)	SEK	(905.732)	0
TREND MICRO INC..TOKYO	656	JPY	3.621.120	0
TRIGANO SA	134	EUR	14.901	0
TRIMBLE NAVIGATION LTD	1.470	USD	55.022	(1.582)
TRINITY IND.INC	4.193	USD	114.930	265
TRIPADVISOR INC	(16.117)	USD	(628.885)	(1.628)
TRIPOD TECHNOLOGY CORP USD EQUIV	28.660	USD	93.587	38
TRUWORTHS INTL LTD	(8.249)	ZAR	(623.624)	0
TSINGTAO BREWERY CO LTD H	(397)	HKD	(13.280)	3
TSOGO SUN HOLDINGS LIMITED	251.787	ZAR	5.748.297	0
TUI AG - NAM.AKT	(12.411)	EUR	(165.439)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
TULLOW OIL PLC	1.600	GBP	2.690	0
TUPPERWARE BRANDS CORPORATION	3.510	USD	213.092	(6.551)
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINEL	787	TRY	85.311	0
TURK SISE CAM	11.829	TRY	53.231	0
TURK TELEKOMUNIKASYON	(220.927)	TRY	(1.601.721)	0
TURKIYE GARANTI BANKASI /NOM.	87.326	TRY	920.416	0
TURKIYE IS BANKASI AS C	7.474	TRY	56.578	0
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	89.430	TRY	629.587	0
TV ASAHI CORP	949	JPY	1.903.694	0
TWITTER INC	(32.077)	USD	(516.119)	119.891
TWO HARBORS INV/REIT	4.619	USD	45.682	924
TYLER TECHNOLOGIES INC	(1.155)	USD	(198.441)	9.807
TYSON FOODS INC.-A-	15.959	USD	1.011.162	10.167
UBIQUITI NETWORKS INC	1.860	USD	101.370	2.347
UBISOFT ENTERTAINMENT	3.710	EUR	198.225	0
UBM FINANCIAL CORP	(178)	USD	(12.399)	962
UBM PLC	(1.511)	GBP	(10.955)	0
UDG HEALTHCARE PLC	34.067	GBP	288.547	0
UDR INC /REIT	441	USD	17.239	(43)
UGI CORP	320	USD	16.150	(75)
ULKER BISKUVI	(19.053)	TRY	(404.686)	0
ULTA BEAUTY INC	5.527	USD	1.388.438	(24.568)
ULTRA ELECTRONICS HLDGS PLC	35.799	GBP	750.705	0
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	(22.231)	BRL	(1.645.094)	0
ULVAC INC	3.360	JPY	19.891.200	0
UMICORE SA	(1.386)	EUR	(94.082)	0
UMPQUA HOLDINGS CORP	(5.583)	USD	(103.509)	2.573
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.449	EUR	517.596	0
UNICHARM CORP	(10.857)	JPY	(30.719.882)	0
UNICREDIT SPA	(18.063)	EUR	(300.568)	0
UNIFIN FIN	7.263	MXN	421.181	0
UNILEVER CERT.OF SHS	9.263	EUR	456.666	0
UNION PACIFIC CORP.	5.300	USD	545.688	(9.785)
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	(7.527)	EUR	(30.755)	0
UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA	16.679	EUR	66.049	0
UNIPOLSAI - SAI NPV SHS	21.138	EUR	41.367	0
UNI-PRESIDENT CHINA HLDGS LTD	(116.963)	HKD	(709.965)	0
UNI-PRESIDENT ENT. USD EQUIV	19.625	USD	37.567	14
UNIQA VERSICHERUNGEN AG	56.997	EUR	498.553	0
UNITE GROUP PLC	50.670	GBP	339.996	0
UNITED BANKSHARES INC	241	USD	8.315	(392)
UNITED COMPANY RUSAL PLC	107.729	HKD	458.926	0
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	4.287	USD	290.144	(6.361)
UNITED INTERN.&CO/NAMENSAKT	(15.686)	EUR	(807.672)	0
UNITED MICROELECTRONICS USD EQUIV	(2.355.816)	USD	(1.084.477)	(330)
UNITED RENTALS INC.	376	USD	44.729	(823)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
UNITED STATES STEEL	2.995	USD	70.353	(1.775)
UNITED TECHNOLOGIES CORP	472	USD	55.965	138
UNITED URBAN INVESTMENT	51	JPY	8.384.400	0
UNITEDHEALTH GROUP INC	5.785	USD	1.109.621	9.154
UNIV.HEALTH SERV.INC B	(4.344)	USD	(481.446)	3.416
UNIVAR INC	(1.070)	USD	(33.213)	(380)
UNIVERSAL DISPLAY CORP.	(7.700)	USD	(928.620)	29.052
UNUM GROUP	(31)	USD	(1.554)	(19)
UPM-KYMMENE CORP	17.163	EUR	394.921	0
UPONOR OYJ A	(14.500)	EUR	(197.780)	0
US BANCORP	(8.518)	USD	(449.580)	1.909
US FOODS HOLDING CORP	(499)	USD	(14.047)	87
USG CORP	(664)	USD	(17.955)	(28)
USHIO INC	137	JPY	212.487	0
UTD PARCEL SERVICE INC B	(15)	USD	(1.654)	4
VALEANT PHARMACEUTICALS INTL	(1.169)	USD	(19.242)	1.558
VALEO SA	7.276	EUR	425.937	0
VALERO ENER. CORP	1.128	USD	77.798	2.433
VALIDUS HOLDINGS	263	USD	14.147	213
VALMET CORPORATION	17.474	EUR	269.100	0
VANTIV INC	1.033	USD	65.647	(30)
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2.711	USD	263.292	(1.618)
VAT GROUP LTD	7.214	CHF	917.621	0
VECTREN CORP	1.491	USD	89.624	620
VEDANTA RESOURCES PLC	4.564	GBP	35.120	0
VEEVA SYSTEMS INC	665	USD	42.400	(771)
VEIDEKKE A/S	26.699	NOK	2.776.696	0
VENTAS INC.	3.043	USD	204.946	541
VEOLIA ENVIRONNEMENT	(4.404)	EUR	(83.918)	0
VERBUND AG/-A-	2.679	EUR	44.806	0
VERISIGN INC	(5.360)	USD	(542.271)	4.081
VERISK ANLYTCS	(11.913)	USD	(1.039.528)	(3.967)
VERIZON COMMUNICATIONS INC	(478)	USD	(23.135)	(447)
VERMILION ENERGY INC	4.630	CAD	190.108	3.653
VERTEX PHARMACEUTICALS	(773)	USD	(117.357)	4.552
VESTAS WIND SYSTEMS AS / REG	11.019	DKK	6.765.666	0
VESUVIUS PLC	6.301	GBP	34.246	0
VF CORP	(16.885)	USD	(1.050.078)	(19.425)
VIA VAREJO SA /UNIT(1SHS+2PFD)	126	BRL	1.813	0
VIASAT INC. CARLSBAD. CALIF.	(11.971)	USD	(791.163)	15.928
VICINITY CENTRES	58.686	AUD	161.387	0
VICTREX PLC	36.406	GBP	717.562	0
VIDRALA SA	176	EUR	11.598	0
VIENNA INTERNATIONAL AIRPORT	(161)	EUR	(5.346)	0
VIFOR PHARMA AG	(2.532)	CHF	(261.556)	0
VILMORIN ET CIE	1.292	EUR	96.202	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
VINCI	1.657	EUR	125.501	0
VIRBAC	(201)	EUR	(30.301)	0
VISA INC -A	(7.195)	USD	(716.334)	3.097
VISCOFAN --- SHS	(21.245)	EUR	(1.070.536)	0
VITRO SAB DE CV-A-	519	MXN	41.484	1
VITROLIFE AB	(1.270)	SEK	(830.580)	0
VIVENDI	(10.563)	EUR	(206.718)	0
VMWARE INC	7.675	USD	711.549	2.802
VODACOM	(1.244)	ZAR	(221.519)	0
VODAFONE GROUP PLC	271.710	GBP	603.196	0
VOESTALPINE AG	(23.170)	EUR	(993.066)	0
VOLARIS	107.092	MXN	2.621.612	(480)
VOLKSWAGEN AG /VORZUG.	(3.767)	EUR	(490.087)	0
VOLVO B	84.929	SEK	11.652.259	0
VONOVIA SE /NAMEN	18.201	EUR	623.475	0
VONTOBEL HOLDING AG /NAM.	80	CHF	5.148	0
VORNADO REALTY TRUST	2.609	USD	207.024	2.955
VOYA FINANCIAL	(139)	USD	(5.454)	(3)
VTECH HLDGS SHS	2.490	HKD	280.623	(96)
VULCAN MATERL CO HOLD.CO*OPE*	(1.307)	USD	(160.918)	5.018
WABTEC CORP	(9.594)	USD	(723.004)	35.880
WACKER CHEMIE AG MUENCHEN	(671)	EUR	(70.388)	0
WACKER NEUSON SE /NAMEN	(460)	EUR	(10.440)	0
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	(3.202)	USD	(258.305)	(964)
WAL-MART DE MEXICO SAB DECV	(127.019)	MXN	(5.233.183)	(854)
WAL-MART STORES INC	3.586	USD	286.844	6.337
WALT DISNEY	(4.796)	USD	(527.224)	(13.909)
WAN HAI LINES USD EQUIV	36.283	USD	20.788	9
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	(305.982)	HKD	(1.615.585)	0
WAREHOUSES DE PAUW SCA WDP	90	EUR	8.441	0
WARSAW STOCK EXCHANGE	723	PLN	33.945	0
WARTSILA CORPORATION -B-	(15.299)	EUR	(859.039)	0
WASHINGTON H.SOUL PATTINSON	2.736	AUD	48.263	0
WASTE CONNECTIONS INC	585	USD	38.013	(4)
WASTE MANAGEMENT INC	13.760	USD	1.034.064	(6.434)
WATERS CORPORATION	2.136	USD	370.468	(1.043)
WATSCO INC	3.978	USD	599.763	3.506
WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	(127.241)	USD	(567.495)	(10.992)
WEBJET LTD	1.390	AUD	16.013	0
WEC ENERGY GROUP INC	3.021	USD	190.232	2.362
WEG SA	(27.455)	BRL	(519.998)	0
WEINGARTEN REALTY INV.	(8.098)	USD	(262.861)	(5.676)
WEIR GROUP PLC	19.280	GBP	353.595	0
WELCIA HOLDINGS CO LTD	2.922	JPY	12.257.790	0
WELLCARE HEALTH PLANS INC	7.062	USD	1.249.903	(24.280)
WELLS FARGO & CO	19.952	USD	1.076.211	(17.110)

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
WELLTOWER INC /REIT	5.827	USD	427.644	2.093
WENDY S CO	585	USD	9.032	(6)
WERELDHAVE(BELEG.MIJ)(EUR 10)	(4.404)	EUR	(180.212)	0
WESFARMERS - SHS	6.185	AUD	251.915	0
WEST FRASER TIMBER CO	(253)	CAD	(16.761)	(118)
WEST GAS EQUITY /PARTNERSHIP	2.607	USD	110.198	833
WEST JAPAN RAILWAY CO	290	JPY	2.296.220	0
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1.883	USD	167.022	(4.878)
WESTERN DIGITAL CORP.	10.829	USD	921.764	(845)
WESTERN GAS PARTNERS LP	7.466	USD	387.709	(4.194)
WESTERN UNION COMPANY	3.685	USD	72.779	1.040
WESTFIELD CORPORATION /REIT	(121.255)	AUD	(931.238)	0
WESTPAC BANKING CORP	173	AUD	5.505	0
WESTROCK CO	239	USD	13.723	(255)
WEX	(3.008)	USD	(326.909)	16.586
WEYERHAEUSER CO	3.979	USD	131.387	(2.074)
WGL HOLDINGS INC	(465)	USD	(39.860)	(224)
WH GROUP LTD	630.245	HKD	4.619.696	0
WH SMITH PLC	1.859	GBP	32.718	0
WHARF HOLDINGS LIMITED .THE	85.357	HKD	5.663.437	(1.093)
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	(16.622)	USD	(337.593)	(11.043)
WHEELOCK & CO	13.580	HKD	795.109	(609)
WHIRLPOOL CORP.	(168)	USD	(29.884)	(2.125)
WHITE MOUNTAINS INSUR GRP	492	USD	425.383	(2.827)
WHITECAP RESOURCES INC	410	CAD	3.776	35
WHITEHAVEN COAL	152.056	AUD	451.606	0
WIEN ST VERSICH	552	EUR	14.065	(85)
WIENERBERGER AG	(937)	EUR	(18.215)	0
WIHLBORG FASTIGHETE AB	21.397	SEK	4.202.371	0
WILHEMSEN	(6.262)	NOK	(308.717)	0
WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	113	DKK	18.882	0
WILLIAM HILL PLC	(45.716)	GBP	(114.519)	0
WILLIAMS COMPANIES INC	4.411	USD	140.182	769
WILLIAMS-SONOMA INC	1.214	USD	56.366	1.627
WILLIS TOWERS WATS NPV	(131)	USD	(19.503)	5
WINBOND ELECTRONICS CORP USD EQUIV	154.979	USD	93.670	32
WINCOR NIXDORF AG	(1.305)	EUR	(93.856)	0
WISETECH GLOBAL LTD	640	AUD	4.499	0
WISTRON CORP USD EQUIV	633.119	USD	639.513	253
WIZ SOLUCOES E CORRETAGEM DE SEG	19.620	BRL	388.476	0
WM MORRISON SUPERMARKETS PLC	142.143	GBP	341.712	0
WOOD GROUP	56.220	GBP	343.223	0
WOODSIDE PETROLEUM LTD	1.270	AUD	37.046	0
WOOLWORTHS	(7.952)	AUD	(212.318)	0
WOOLWORTHS HLD LTD	(1.286)	ZAR	(81.018)	0
WOONG JIN COWAY CO LTD USD EQUIV	(16)	USD	(1.418)	17

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
WOORI BANK	(2.788)	USD	(47.606)	(124)
WORKDAY INC - CLASS A	(62)	USD	(6.331)	41
WORKSPACE GP R.E.I.T.	3.929	GBP	35.950	0
WORLDLINE SA	1.431	EUR	49.083	0
WORLEYPARSONS LTD	(1)	AUD	(12)	0
WP CAREY INC REIT	(1.368)	USD	(93.722)	(970)
WPG HOLDING CO LTD-USD EQ	4.880	USD	6.836	3
WPP PLC SHS	92.487	GBP	1.429.849	0
WPX ENERGY INC	(9.921)	USD	(106.948)	(1.885)
WR BERKLEY CORP.	3.444	USD	237.533	(12.485)
WUESTENROT & WUERTEMBERG./NAM	2.381	EUR	51.942	0
WW GRAINGER INC	(500)	USD	(83.370)	(251)
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	(1.857)	USD	(193.815)	91
WYNN MACAU	40.486	HKD	685.833	0
WYNN RESORTS LTD	828	USD	107.094	(213)
XCEL ENERGY INC	(2.627)	USD	(124.283)	(308)
XEROX CORP	14.379	USD	441.004	(2.550)
XILINX INC.	7.963	USD	503.739	(9.938)
XING AG	(68)	EUR	(16.864)	0
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	(29.579)	HKD	(238.998)	0
XL GROUP LTD	(7.029)	USD	(312.088)	12.904
XPO LOGISTICS INC	(616)	USD	(37.028)	601
XXL ASA	(44.686)	NOK	(3.418.479)	0
XYLEM INC	(20.786)	USD	(1.179.190)	9.377
YAGEO CORP USD EQUIV	54.153	USD	206.245	80
YAHOO JAPAN CORP TOKYO	(522.121)	JPY	(261.060.500)	0
YAKULT HONSHA	(3.701)	JPY	(27.831.520)	0
YAMADA DENKI CO LTD	34.456	JPY	20.294.584	0
YAMAHA MOTOR CO LTD	13.657	JPY	37.966.460	0
YAMANA GOLD INC	6.751	CAD	21.941	1.404
YAMATO HOLDINGS CO LTD	(1)	JPY	(2.215)	0
YAMAZAKI BAKING CO	26.753	JPY	59.231.142	0
YANDEX NV -A-	(2.255)	USD	(65.350)	6.068
YAPI KREDI BANKASA	69.069	TRY	313.573	0
YARA INTERNATIONAL ASA	(25.207)	NOK	(7.897.353)	0
YASKAWA ELECTRIC CORP.	(9.473)	JPY	(28.049.553)	0
YOKOGAWA ELECTRIC CORP	3.113	JPY	5.787.067	0
YOKOHAMA RUBBER CO LTD	(6.513)	JPY	(14.510.964)	0
YOOX S.P.A	(4.624)	EUR	(129.241)	0
YOUNGPOONG	(16)	USD	(17.708)	(141)
YPSOMED HOLDING AG	(24)	CHF	(3.624)	0
YUANTA FINANCIAL HOLDING USD EQUIV	(4.978)	USD	(2.135)	(1)
YUHAN CORP- USD EQUIV	111	USD	23.469	(681)
YULON NISSAN MOTOR - USD EQ	5.833	USD	55.345	22
YUM BRANDS SHS	214	USD	16.153	92
Z ENERGY LTD	(4.161)	NZD	(32.206)	0

11. Differenzgeschäfte (CFD) (Fortsetzung)

Beschreibung	Menge	Währung	Kontrakt-volumen in der Währung des CFD	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) USD
ZALANDO SE	(32.363)	EUR	(1.223.807)	0
ZARDOYA OTIS / SPLIT ISSUE	(2.200)	EUR	(19.514)	0
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	(1.934)	USD	(63.416)	7
ZEBRA TECHNOLOGIES A	891	USD	90.633	1.364
ZENKOKU HOSHO CO LTD	4.898	JPY	23.216.520	0
ZENSHO HOLDINGS CO LTD	1.612	JPY	3.215.940	0
ZEON CORP	(384)	JPY	(531.072)	0
ZHAOJIN MINING IND.-H-	47.005	HKD	301.302	0
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD H	(9.439)	HKD	(92.219)	(24)
ZHEN DING TECH HLDG/REG SH -	(24.523)	USD	(57.013)	(22)
ZHONGSHENG GRP	481.990	HKD	8.242.029	0
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC -H-	(28.344)	HKD	(1.054.397)	0
ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	2.683	USD	325.502	(19.070)
ZIONS BANCORP	208	USD	9.427	(73)
ZOETIS INC -A-	690	USD	43.139	868
ZOOPLUS	(146)	EUR	(23.550)	0
ZURICH INSURANCE GROUP/NAM	(524)	CHF	(154.475)	0
Gesamt				**20.547**

Zum 31. Juli 2017 beträgt der nicht realisierte Nettogewinn aus CFD USD 20.547.
Kontrahent der CFD war Morgan Stanley & Co. International PLC.

12. Ausgegebene Optionen

Zum 31. Juli 2017 wurden keine Optionen ausgegeben.

13. Sicherheiten

Die Gesellschaft hat für bestimmte Teilfonds das Gesamt-Kontrahentenrisiko der OTC-Swap-Transaktionen der Teilfonds reduziert, indem sie von dem Swap-Kontrahenten die Stellung oder Verpfändung von Sicherheiten zugunsten des jeweiligen Teilfonds in Übereinstimmung mit den geltenden OGAW-Vorschriften und CSSF-Rundschreiben (z. B. CSSF-Rundschreiben 11/512 und 13/559) verlangt hat. Diese Sicherheiten können von der Gesellschaft jederzeit verwertet werden, und ihr Marktwert wird an jedem Bewertungstag ermittelt. Der Betrag der zu stellenden oder verpfändeten Sicherheiten muss mindestens dem Wert entsprechen, um den der Grenzwert des Gesamt-Exposure (wie im Prospekt festgelegt) überschritten wurde.

A) Sicherheiten - Funded Swaps

Jeder Teilfonds mit Indirekter Anlagepolitik, der Funded Swaps mit der Deutsche Bank AG, Niederlassung London, als Swap-Kontrahent eingeht, kann die bei der RBC Investor Services Bank S.A. ("RBC") eingerichtete Sicherheitenvereinbarung treffen.

Im Rahmen einer Verpfändungsvereinbarung zwischen der Gesellschaft, der Verwaltungsgesellschaft, der Deutschen Bank, handelnd über ihre Niederlassung London, in ihrer Funktion als Swap-Kontrahent und RBC hat die Gesellschaft gemäß einer Verwahrstellenvereinbarung zwischen RBC und dem Swap-Kontrahenten bei der RBC im Namen des Swap-Kontrahenten eingerichtete Sicherheitenvereinbarungen geschlossen.

Im Falle eines Durchsetzungsereignisses (z. B. Nichterfüllung von Verpflichtungen durch den Swap-Kontrahenten) ermöglicht die Verpfändungsvereinbarung der Depotbank des Pool-Kontos die Übertragung der Sicherheit auf die Teilfonds, ohne die Zustimmung des Swap-Kontrahenten einholen oder den Swap-Kontrahenten vorab informieren zu müssen. Des Weiteren wird ausgeführt, dass die Gesellschaft, die Verwaltungsgesellschaft oder deren jeweilige Vertreter vollständigen und unbegrenzten Handlungsspielraum in Bezug auf die Art der Durchsetzung haben und die Interessen des Swap-Kontrahenten nicht berücksichtigen müssen.

13. Sicherheiten (Fortsetzung)

A) Sicherheiten - Funded Swaps (Fortsetzung)

Die Sicherheiten können in Form von Barmitteln oder Wertpapieren gestellt werden (Letztere sind zum 31. Juli 2017 bewertet).

Name des Teilfonds	Währung der Sicherheit	Sicherheitenbetrag nach Haircut	Besicherungsquote
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	EUR	419.552.056,70	96,30 %

In der nachfolgenden Tabelle sind die Positionen der Sicherheitenbestandteile zum 31. Juli 2017 aufgeführt:

Teilfonds	Beschreibung	Art	Währung	Anzahl der Wertpapiere	Wert in EUR	Gewichtung
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	k. A.	Barmittel	EUR	67.620.992,61	64.239.942,98	15,31 %
	FRANCE 4% 04-25.04.55 OAT	Anleihe	EUR	5.364.000,00	7.589.011,34	1,81 %
	BELGCOOPDOM 1,6% 16-22.06.47	Anleihe	EUR	19.780.000,00	16.828.105,99	4,01 %
	EFSF 1,375% 16-31.05.47	Anleihe	EUR	25.190.000,00	20.744.214,38	4,94 %
	FRANCE 4% 09-25.4.60 OAT	Anleihe	EUR	29.280.000,00	42.393.252,96	10,10 %
	FRANCE 3,25% 12-25.05.45 OAT	Anleihe	EUR	54.767.000,00	65.548.459,00	15,62 %
	BELGIUM OLO 3,75%	Anleihe	EUR	41.940.000,00	54.463.325,94	12,98 %
	EIB 1,75% 14-15.09.45	Anleihe	EUR	19.895.000,00	20.743.959,44	4,94 %
	EFSF 1,2% 15-17.02.45	Anleihe	EUR	45.729.000,00	36.408.332,30	8,68 %
	AUSTRIA 1,5% 16-20.02.47	Anleihe	EUR	14.360.000,00	14.011.382,28	3,34 %
	NETHERLANDS 2,75% 14-15.01.47	Anleihe	EUR	32.834.000,00	39.763.671,52	9,48 %
	GERMANY 2,5% 14-15.08.46	Anleihe	EUR	15.557.000,00	18.317.774,78	4,37 %
	ESM 1,75% 15-20.10.45	Anleihe	EUR	19.784.000,00	18.500.623,79	4,41 %
	Gesamt				**419.552.056,70**	**100,00 %**

B) Sicherheiten – Alle Teilfonds

In der nachstehenden Tabelle sind für die Teilfonds die zehn größten Emittenten unbarer Sicherheiten nach Wert (der erhaltenen Sicherheiten) zum 31. Juli 2017 aufgeführt:

Teilfonds	Währung des Teilfonds	Emittent der Sicherheiten[1]	Marktwert der Sicherheiten in der Währung des Teilfonds	% des Netto-vermögens
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	USD	French Government	136.210.723	26,53 %
		European Financial Stability Facility	67.382.853	13,12 %
		Belgium Government	64.212.261	12,50 %
		Dutch Government	46.881.369	9,13 %
		Europäische Investitionsbank	24.457.128	4,76 %
		Euro Stability Mechanism	21.812.235	4,25 %
		German Government	21.596.656	4,21 %
		Belgium Government	19.840.337	3,86 %
		Austrian Government	16.519.420	3,22 %

[1] Nur neun Emittenten unbarer Sicherheiten

13. Sicherheiten (Fortsetzung)

B) Sicherheiten - Alle Teilfonds (Fortsetzung)

In der nachfolgenden Tabelle ist der Wert der erhaltenen Sicherheiten nach Art der Instrumente und Rating der Anleihen zum 31. Juli 2017 aufgeführt:

Teilfonds	Währung des Teilfonds	Art der Sicherheit	Rating	Erhaltene Sicherheiten in der Währung des Teilfonds	% des Nettovermögens
DB Platinum IV Basso	USD	Barmittel	n. a.	1.710.945	3,17 %
			Gesamt	**1.710.945**	**3,17 %**
DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	USD	Barmittel	n. a.	890.000	1,09 %
			Gesamt	**890.000**	**1,09 %**
DB Platinum IV Systematic	USD	Barmittel	n. a.	3.423.097	0,23 %
			Gesamt	**3.423.097**	**0,23 %**
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	USD	Anleihe	Aaa	92.935.153	18,10 %
		Anleihe	Aa1	105.714.508	20,59 %
		Anleihe	Aa2	136.210.723	26,53 %
		Anleihe	Aa3	84.052.598	16,37 %
		Barmittel	n. a.	75.738.893	14,75 %
			Gesamt	**494.651.875**	**96,33 %**

Die folgende Tabelle enthält eine Übersicht der Laufzeiten der von den Teilfonds erhaltenen Sicherheiten zum 31. Juli 2017:

Teilfonds	Währung des Teilfonds	Laufzeit	Erhaltene Sicherheiten in der Währung des Teilfonds	% des Netto-vermögens
DB Platinum IV Basso	USD	Restlaufzeit	1.710.945	3,17 %
		Gesamt	**1.710.945**	**3,17 %**
DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	USD	Restlaufzeit	890.000	1,09 %
		Gesamt	**890.000**	**1,09 %**
DB Platinum IV Systematic	USD	Restlaufzeit	3.423.097	0,23 %
		Gesamt	**3.423.097**	**0,23 %**
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	USD	über 365 Tage	418.912.982	81,58 %
		Restlaufzeit	75.738.893	14,75 %
		Gesamt	**494.651.875**	**96,33 %**

Die folgende Tabelle enthält eine Übersicht der Währungen der von den Teilfonds erhaltenen Sicherheiten zum 31. Juli 2017:

Teilfonds	Währung des Teilfonds	Währung der Sicherheit	Erhaltene Sicherheiten in der Währung der Sicherheit
DB Platinum IV Basso	USD	USD	1.710.945
DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	USD	USD	890.000
DB Platinum IV Systematic Alpha	USD	USD	3.423.097
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	USD	EUR	419.552.057

Zum 31. Juli 2017 werden alle in Bezug auf die STFs erhaltenen Barsicherheiten nicht wiederverwendet.
Zum 31. Juli 2017 werden alle erhaltenen Sicherheiten durch die RBC Investor Services Bank S.A. verwahrt.

13. Sicherheiten (Fortsetzung)

B) Sicherheiten - Alle Teilfonds (Fortsetzung)

In der nachstehenden Tabelle ist das Volumen der von den Teilfonds gestellten Sicherheiten zum 31. Juli 2017 dargestellt:

Teilfonds	Währung des Teilfonds	Gestellte Sicherheiten in der Währung des Teilfonds	% des Nettovermögens
DB Platinum IV Basso	USD	34.223.204	63,41 %
DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	USD	65.652.998	80,46 %
DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	EUR	1.066.425	46,82 %
DB Platinum IV Systematic Alpha	USD	391.674.929	26,47 %

In Bezug auf einen Teilfonds, der die (eventuell) entstehenden Kosten aus der Stellung von Sicherheiten durch den OTC-Derivatekontrahenten ("Kosten für Sicherheiten") trägt, wie im entsprechenden Produktanhang dargelegt, werden diese Kosten nicht aus der Fixgebühr, sondern von dem Teilfonds direkt gezahlt.

Während des Berichtszeitraums sind keine solchen Kosten angefallen.

14. Vertrieb der Teilfonds

Außer im Großherzogtum Luxemburg hat die Gesellschaft zum 31. Juli 2017 bestimmte Teilfonds für den öffentlichen Vertrieb in den folgenden Rechtsordnungen registriert: Belgien, Chile, Dänemark, Deutschland, Finnland, Frankreich, Irland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Österreich, Portugal, Schweden, der Schweiz, Singapur, Spanien und im Vereinigten Königreich.

15. Portfolioumschichtungen

Eine detaillierte Aufstellung von Portfolioumschichtungen zum 31. Juli 2017 ist auf Anfrage kostenlos am Sitz der Gesellschaft erhältlich.

16. Ausschüttung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat die nachstehend näher beschriebenen Ausschüttungen beschlossen. Die Ausschüttungen wurden auf der Jahreshauptversammlung der Anteilsinhaber der Gesellschaft genehmigt.

Name des Teilfonds	Anteils-klasse	Stichta	Ex-Tag	Ausschüttungs datur	Währung	Betrag je Anteil
DB Platinum IV CROCI Euro	R1D	20.04.2017	21.04.2017	28.04.2017	EUR	2,66
DB Platinum IV CROCI US	I1D-E	20.04.2017	21.04.2017	28.04.2017	EUR	1,35
DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control	I1D	20.04.2017	21.04.2017	28.04.2017	EUR	2,90
DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control	I2D	20.04.2017	21.04.2017	28.04.2017	EUR	2,90

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat die nachstehend näher beschriebenen Zwischenausschüttungen beschlossen.

Name des Teilfonds	Anteils-klasse	Stichtag	Ex-Tag	Ausschüttungs-datum	Währung	Betrag je Anteil
DB Platinum IV Sovereign Optima 2034 liquid (am 6. April 2017 vollständig zurückgenommen)	I1D-S	23.03.2017	24.03.2017	31.03.2017	SEK	2.430,00

17. Wertpapierleihe

DB Platinum IV hat für den Teilfonds DB Platinum IV CROCI Euro am 3. April 2006 eine am 17. Mai 2010 geänderte Vereinbarung über Wertpapierleihgeschäfte mit der Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Niederlassung London, abgeschlossen. Die Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Niederlassung London, zahlt DB Platinum IV CROCI Euro eine dem Marktstandard entsprechende Gebühr für die Wertpapierleihe, wie mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart.

Zum 31. Juli 2017 waren keine Wertpapiere im Zusammenhang mit dem DB Platinum IV CROCI Euro verliehen.

18. Soft Commissions

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch Clinton Group, Inc., State Street Global Advisors Limited, GAM Investment Management (Switzerland) Ltd oder Winton Capital Management Limited haben während des Berichtszeitraums Soft-Commission-Vereinbarungen mit Brokern in Bezug auf die Gesellschaft abgeschlossen.

Die Anlageverwalter haben die folgenden Soft-Commission-Vereinbarungen abgeschlossen:
Basso Capital Management, L.P. hat eine Soft-Dollar-Vereinbarung abgeschlossen. Alle Kontotransaktionen erfolgten im Einklang mit Section 28(e) des US Securities Exchange Act of 1934.

19. Pre-Hedging

Teilfonds, für die ein Fälligkeitstermin vorgesehen ist, verfolgen eine Anlagestrategie die darauf abzielt, Anlegern bei Fälligkeit des Teilfonds einen oder mehrere vorab festgelegte(n) Auszahlungsbetrag bzw. Auszahlungsbeträge zukommen zu lassen. Der bzw. die vorab festgelegte(n) Auszahlungsbetrag bzw. Auszahlungsbeträge können Mindestbeträge oder Festbeträge sein.

Ob tatsächlich ein solcher vorab festgelegter Betrag an die Anleger ausgezahlt werden kann, ist von einer Reihe von Parametern abhängig, unter anderem Marktbewegungen zwischen der Festlegung dieses Betrages bei Gründung des Teilfonds und dem Zeitpunkt, an dem der Teilfonds oder eine seiner jeweiligen Anteilsklassen aufgelegt wird.

Um negative Auswirkungen solcher Marktbewegungen zu vermeiden, beabsichtigt der Teilfonds, Pre-Hedging-Vereinbarungen einzugehen, die im Einklang mit den Anlagebeschränkungen in dem Umfang vereinbart werden, der erforderlich ist, um die vorab festgelegte Auszahlung zu leisten.

Die Kosten dieser Pre-Hedging-Transaktionen je Anteil entsprechen der Differenz zwischen dem Erstausgabepreis je Anteil und dem Wert je Anteil des Portfolios des Teilfonds (oder, für den Fall der Auflegung einer neuen Anteilsklasse, dem dieser Anteilsklasse zuzuordnenden Wert je Anteil des Portfolios des Teilfonds) (einschließlich dieser Pre-Hedging-Transaktionen) am Auflegungstermin.

Diese Kosten (die "Pre-Hedging-Kosten") stellen die Kosten des Swap Kontrahenten dar, der das Marktrisiko der Eingehung solcher Pre-Hedging-Vereinbarungen vor dem Auflegungstermin trägt. Diese Pre-Hedging-Kosten werden in der/den jeweiligen OTC-Swap-Transaktion(en) berücksichtigt und dementsprechend auch in der Bestimmung des NAV je Anteil. Sofern positiv, sind diese Pre-Hedging-Kosten daher bei der Anteilszeichnung von den Anlegern zu tragen. Für den Fall, dass der Wert je Anteil des Portfolios des Teilfonds am Auflegungstermin höher ist als der Erstausgabepreis je Anteil, sind die Pre-Hedging-Kosten negativ und von dem Swap-Kontrahenten zu tragen.

Die gemäß Vorstehendem bestimmten Pre-Hedging-Kosten können für einen Zeitraum nach dem Auflegungstermin weiterhin von neuen Anlegern in den Teilfonds bzw. die Anteilsklassen zu tragen sein, um eine Verwässerung der Anlagen von Anlegern, die am Auflegungstermin oder innerhalb dieses Zeitraums nach dem Auflegungstermin in den Teilfonds investiert haben, zu vermeiden. Dieser Zeitraum wird von dem Swap-Kontrahenten und der Verwaltungsgesellschaft am oder um den Auflegungstermin vereinbart und darf nicht länger als ein Jahr ab dem Auflegungstermin sein.

Nach diesem Zeitraum werden die Pre-Hedging-Kosten entweder abgeschrieben oder fließen über einen festgelegten Zeitraum zu, soweit im Produktanhang des Teilfonds nicht anderweitig bestimmt.

Diese Erläuterung gilt nicht für diesen Berichtszeitraum.

20. Ernannte Anlageverwalter

State Street Global Advisors Limited fungiert als Anlageverwalter für die folgenden Teilfonds:

- DB Platinum IV Sovereign Plus
- DB Platinum IV CROCI Euro
- DB Platinum IV CROCI US
- DB Platinum IV CROCI Japan
- DB Platinum IV Systematic Alpha*
- DB Platinum IV CROCI Europe

GAM Investment Management (Switzerland) Ltd fungiert als Anlageverwalter für folgenden Teilfonds:

- DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity

Basso Capital Management, L.P. fungiert als Anlageverwalter für folgenden Teilfonds:

- DB Platinum IV Basso

Clinton Group, Inc. fungiert als Anlageverwalter für folgenden Teilfonds:

- DB Platinum IV Clinton Equity Strategies

Veritas Institutional GmbH fungiert als Anlageverwalter für die folgenden Teilfonds:

- DB Platinum IV Dividend Equity Risk Control

21. Französischer Aktiensparplan ("Plan d'épargne en actions")

Folgender Teilfonds erfüllt die Kriterien für eine Anlage im Rahmen eines Plan d'Epargne en Actions ("PEA"):

- DB Platinum IV CROCI Euro

Während des am 31. Juli 2017 endenden Berichtszeitraums erfüllte der Teilfonds DB Platinum IV CROCI Euro die im französischen Währungs- und Finanzgesetz ("Code monétaire et financier") dargelegten PEA-Eignungskriterien.

22. Sonstige Vermögenswerte / Sonstige Verbindlichkeiten

In der Vermögensaufstellung sind Dividendenforderungen und -verbindlichkeiten aus CFD für die Teilfonds DB Platinum IV Systematic Alpha, DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity, DB Platinum IV Basso und DB Platinum IV Clinton Equity Strategies unter der Position "Sonstige Vermögenswerte" und "Sonstige Verbindlichkeiten" erfasst.

23. Verordnung zur Regulierung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (*Securities Financing Transactions Regulation*, SFTR)

Die Gesellschaft unterliegt der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments ("SFTR"). Die am 25. November 2015 erlassene SFTR gilt seit 12. Januar 2016 für alle OGAW-Fonds. Die in der SFTR dargelegten Offenlegungspflichten gelten für nach dem 13. Januar 2017 veröffentlichte Jahres- und Halbjahresberichte.

* Als Ergänzung zu State Street Global Advisors Limited als Anlageverwalter wird die Portfolioverwaltung für den DB Platinum IV Systematic Alpha an Winton Capital Management Limited übertragen.

23. Verordnung zur Regulierung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR) (Fortsetzung)

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß Definition in Artikel 3 Abs. 11 der SFTR:

- ein Pensionsgeschäft oder ein umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft;
- ein Lombardgeschäft.

Die SFTR umfasst auch als Gesamtrendite-Swaps (Total Return Swaps, "TRS") bezeichnete Transaktionen, die gemäß dem Prospekt auch Differenzgeschäfte (Contracts for Difference; "CFD") umfassen (siehe nachstehende Tabellen).

Nachstehend ist das Volumen der von der Gesellschaft gehaltenen Total Return Swaps und Differenzgeschäfte zum 31. Juli 2017 aufgeführt:

Teilfonds	**Währung**	**Exposure – Basiswert(e)**	**Exposure – Basiswert(e) in % des Nettovermögens**
DB Platinum IV Systematic Alpha	USD	532.813.060	36,00 %
DB Platinum IV Basso	USD	261.110.486	483,82 %
DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	USD	717.072.431	878,81 %
DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	EUR	4.292.966	188,48 %
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	USD	871.204.397	169,66 %
DB Platinum IV Sovereign Plus	EUR	72.816.267	97,26 %

Gemäß Vorgabe der SFTR muss die Gesellschaft die Höhe der Anlage in Total Return Swaps (gemäß Prospekt einschließlich Differenzgeschäften) unter Angabe des absoluten Betrags und des Anteils am Nettoinventarwert der Teilfonds offenlegen. Der oben angegebene prozentuale Anteil berechnet sich aus dem fiktiven Exposure aus den Wertpapierfinanzierungsgeschäften auf absoluter Basis, dividiert durch den Gesamtnettoinventarwert. Dieser Wert ist jedoch nicht mit der Berechnung des Kontrahentenrisikos gleichzusetzen.

Gemäß Vorgabe der SFTR ist die Gesellschaft verpflichtet, die zehn wichtigsten Kontrahenten der Total Return Swaps (gemäß Prospekt einschließlich der Differenzgeschäfte) separat offenzulegen.

Teilfonds	**WFG**	**Währung**	**Kontrahent**	**Exposure – Basiswert(e)**	**Exposure – Basiswert(e) in % des Netto-vermögens**
DB Platinum IV Systematic Alpha	CFD	USD	GOLDMAN SACHS	515.528.177	34,83 %
	CFD	USD	CREDIT SUISSE AG	17.284.883	1,17 %
			Gesamt	**532.813.060**	**36,00 %**
DB Platinum IV Basso	CFD	USD	DEUTSCHE BANK AG	82.178.912	152,27 %
		USD	BNP PARIBAS LONDON	7.845.765	14,54 %
		USD	NOMURA INTERNATIONAL PLC	4.894.966	9,07 %
		USD	CITIBANK	320.410	0,59 %
	TRS	USD	DEUTSCHE BANK AG	126.206.377	233,85 %
		USD	BNP PARIBAS LONDON	19.545.508	36,22 %
		USD	NOMURA INTL. LONDON	18.045.112	33,44 %
		USD	CITIBANK	2.073.436	3,84 %
			Gesamt	**261.110.486**	**483,82 %**

23. Verordnung zur Regulierung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR) (Fortsetzung)

Teilfonds	WFG	Währung	Kontrahent	Exposure – Basiswert(e)	Exposure – Basiswert(e) in % des Nettovermöge
DB Platinum IV Clinton Equity Strategies	CFD	USD	MORGAN STANLEY AND CO. INTL PLC	717.072.431	878,81 %
			Gesamt	**717.072.431**	**878,81 %**
DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	CFD	EUR	DEUTSCHE BANK AG	1.521.753	66,81 %
	CFD	EUR	CREDIT SUISSE AG	2.771.214	121,67 %
			Gesamt	**4.292.966**	**188,48 %**
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	TRS	USD	DEUTSCHE BANK AG	871.204.397	169,66 %
			Gesamt	**871.204.397**	**169,66 %**
DB Platinum IV Sovereign Plus	TRS	EUR	DEUTSCHE BANK AG	72.816.267	97,26 %
			Gesamt	**72.816.267**	**97,26 %**

Bei allen Teilfonds sind die Laufzeiten der vorstehend aufgeführten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unbefristet.

Alle Kontrahenten der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte wurden im Vereinigten Königreich errichtet, mit Ausnahme der CITIBANK, bei der es sich je nach Transaktion um das in den USA oder im Vereinigten Königreich errichtete Unternehmen handelt.

Alle zum Ende des Berichtszeitraums am 31. Juli 2017 offenen Transaktionen wurden trilateral abgewickelt, mit Ausnahme folgender Transaktionen:

Teilfonds	WFG	Währung	Kontrahent
DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity	CFD	EUR	CREDIT SUISSE AG
DB Platinum IV Systematic Alpha	CFD	USD	CREDIT SUISSE AG
DB Platinum IV Institutional Fixed Income	TRS	USD	DEUTSCHE BANK AG
DB Platinum IV Sovereign Plus	TRS	EUR	DEUTSCHE BANK AG

Die vorstehenden Transaktionen wurden bilateral abgewickelt.

24. Nachfolgendes Ereignis

Am 22. September 2017 wurden die Anteilsinhaber des Teilfonds DB Platinum IV GAM Absolute Return Europe Equity über die Schließung des Teilfonds informiert. Die Schließung wird zum 23. Oktober 2017 wirksam.

A) Weitere Ereignisse während des Berichtszeitraums

Im Juli 2017 wurde eine Bekanntmachung in Bezug auf den Teilfonds DB Platinum IV Systematic Alpha veröffentlicht, in der eine Senkung der Verwaltungsgesellschaftsgebühr und der Anlageerfolgsprämie für den Teilfonds angekündigt wurde. Diese Senkung der genannten Gebühren ist zum 19. Juli 2017 in Kraft getreten.

B) Weitere Informationen zu DB Platinum IV Institutional Fixed Income

Die in der vorstehenden Anmerkung 8 des Anhangs für den DB Platinum IV Institutional Fixed Income genannten Swap-Beträge entsprechen jeweils der Summe der nachstehend im Einzelnen aufgeführten Swap-Nennbeträge:

DB Platinum IV Institutional Fixed Income				
Anteilsklasse I4D				
Zugrunde Liegende Referenzanleihe				
ISIN	**Emittentenname**	**Kupon**	**Fälligkeitstermin**	**Swap-Nennbetrag in EUR**
FR0013257524	FRANKREICH (STAAT)	2,00 %	25.05.2048	5.000.000,00
BE0000338476	KÖNIGREICH BELGIEN	1,60 %	22.06.2047	4.000.000,00
AT0000A1K9F1	REPUBLIK ÖSTERREICH	1,50 %	20.02.2047	2.000.000,00
EU000A1U9936	EUROPÄISCHER	1,85 %	12.01.2055	4.000.000,00
EU000A1G0DW4	EUROPÄISCHE FINANZSTABILISIERU	1,80 %	07.10.2048	4.000.000,00
XS1641457277	EUROPÄISCHE	1,50 %	15.11.2047	1.000.000,00
			Gesamt	**20.000.000,00**

DB Platinum IV Institutional Fixed Income				
Anteilsklasse I5D				
Zugrunde Liegende Referenzanleihe				
ISIN	**Emittentenname**	**Kupon**	**Fälligkeitstermin**	**Swap-Nennbetrag in EUR**
FR0013257524	FRANKREICH (STAAT)	2,00 %	25.05.2048	5.000.000,00
BE0000338476	KÖNIGREICH BELGIEN	1,60 %	22.06.2047	4.000.000,00
AT0000A1K9F1	REPUBLIK ÖSTERREICH	1,50 %	20.02.2047	2.000.000,00
EU000A1U9936	EUROPÄISCHER	1,85 %	12.01.2055	4.000.000,00
EU000A1G0DW4	EUROPÄISCHE FINANZSTABILISIERU	1,80 %	07.10.2048	4.000.000,00
XS1641457277	EUROPÄISCHE	1,50 %	15.11.2047	1.000.000,00
			Gesamt	**20.000.000,00**

DB Platinum IV Institutional Fixed Income				
Anteilsklasse I6D				
Zugrunde Liegende Referenzanleihe				
ISIN	**Emittentenname**	**Kupon**	**Fälligkeitstermin**	**Swap-Nennbetrag in EUR**
EU000A1G0DD4	EUROPÄISCHE FINANZSTABILISIERU	1,20 %	17.02.2045	18.760.000,00
FR0010870956	FRANKREICH (STAAT)	4,00 %	25.04.2060	50.340.000,00
DE0001102341	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,50 %	15.08.2046	26.960.000,00
BE0000331406	KÖNIGREICH BELGIEN	3,75 %	22.06.2045	44.500.000,00
NL0010721999	NIEDERLANDE (STAAT)	2,75 %	15.01.2047	31.800.000,00
FR0011461037	FRANKREICH (STAAT)	3,25 %	25.05.2045	27.640.000,00
			Gesamt	**200.000.000,00**

B) Weitere Informationen zu DB Platinum IV Institutional Fixed Income (Fortsetzung)

DB Platinum IV Institutional Fixed Income				
Anteilsklasse I7D				
Zugrunde Liegende Referenzanleihe				
ISIN	**Emittentenname**	**Kupon**	**Fälligkeitstermin**	**Swap-Nennbetrag in EUR**
XS1107247725	EUROPÄISCHE	1,75 %	15.09.2045	22.500.000,00
EU000A1U9902	EUROPÄISCHER	1,75 %	20.10.2045	12.000.000,00
FR0010171975	FRANKREICH (STAAT)	4,00 %	25.04.2055	15.000.000,00
BE0000331406	KÖNIGREICH BELGIEN	3,75 %	22.06.2045	37.500.000,00
NL0010721999	NIEDERLANDE (STAAT)	2,75 %	15.01.2047	15.000.000,00
FR0011461037	FRANKREICH (STAAT)	3,25 %	25.05.2045	22.500.000,00
EU000A1G0DD4	EUROPÄISCHE FINANZSTABILISIERU	1,20 %	17.02.2045	25.500.000,00
			Gesamt	**150.000.000,00**

DB Platinum IV Institutional Fixed Income				
Anteilsklasse I8D				
Zugrunde Liegende Referenzanleihe				
ISIN	**Emittentenname**	**Kupon**	**Fälligkeitstermin**	**Swap-Nennbetrag in EUR**
EU000A1U9902	EUROPÄISCHER	1,75 %	20.10.2045	10.000.000,00
AT0000A1K9F1	REPUBLIK ÖSTERREICH	1,50 %	20.02.2047	15.000.000,00
EU000A1G0DJ1	EUROPÄISCHE FINANZSTABILISIERU	1,375 %	31.05.2047	25.000.000,00
BE0000338476	KÖNIGREICH BELGIEN	1,60 %	22.06.2047	20.000.000,00
FR0011461037	FRANKREICH (STAAT)	3,25 %	25.05.2045	20.000.000,00
FR0010171975	FRANKREICH (STAAT)	4,00 %	25.04.2055	10.000.000,00
			Gesamt	**100.000.000,00**

C) Tracking-Differenz und Tracking Error

Name des Teilfonds	**Bezeichnung der Anteilsklasse**	**Währung der Anteils-klasse**	**Wertentwicklung der Anteilsklasse im Berichtszeitraum**	**Index-Performance im Berichtszeitraum**	**Unterschied in der Wertentwicklung**	**Tatsächlicher Tracking Error für den Berichts-zeitraum**
DB Platinum IV Sovereign Plus	R1C	EUR	-1,89 %	-2,18 %	0,29 %	0,93 %
	R1C-A	EUR	-1,85 %	-2,18 %	0,32 %	0,93 %
	R1D	EUR	-1,89 %	-2,18 %	0,29 %	0,92 %