

Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch


Deka Investment GmbH

Der Fonds erfüllt höchste Qualitätsstandards gemäß der Bewertungskriterien des TELOS Fonds Rating (TFR). Die Bewertung wurde durch die TELOS GmbH durchgeführt.

Der Deka-ESG Sigma Plus Dynamisch Fonds wurde im Dezember 2005 von der Deka Investment GmbH aufgelegt und fällt in die Kategorie Multi Asset. Angestrebt wird die Erzielung der größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse. Um dies zu erreichen, legt der quantitativ und aktiv gemanagte Fonds weltweit in unterschiedliche Anlageklassen wie Aktien und Anleihen an. Im Rahmen des Wertpapierauswahlprozesses werden neben wirtschaftlichen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien (Ökologie, Soziales und Governance) berücksichtigt. Der Investmentprozess erfolgt im Rahmen der quantitativen Anlagestrategie „Sigma Plus“. Bei dieser werden auf monatlicher Basis die erwarteten Erträge aller relevanten Anlageklassen und Märkte prognostiziert sowie die aktuelle Prognosegüte bewertet. Beides fließt anschließend in ein robustes Optimierungsverfahren ein, worüber die optimale Zusammensetzung des Portfolios auf Ebene der verschiedenen Kategorien von Vermögensgegenständen bestimmt wird.




Dr. Frank Wehlmann


Alexander Scholz