

# Halbjahresbericht zum 29. Februar 2016

3ik-Strategiefonds I

# Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie über  
die Entwicklung des OGAW-Fonds

3ik-Strategiefonds I

in der Zeit vom 1. September 2015 bis 29. Februar 2016.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 2,11 % in der Class I  
sowie von - 2,21 % in der Class R.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des  
Sondervermögens im Detail per Ende Februar darstellte. Wenn Sie darüber hinaus einen  
aktuellen Einblick in den Fonds bekommen und unsere Einschätzung der Märkte  
kennenlernen möchten, besuchen Sie unseren Internetauftritt: Unter [www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)  
veröffentlichen wir regelmäßig einen Kommentar des Fondsmanagements. Im Rahmen  
des nächsten Jahresberichtes erhalten Sie zudem einen umfangreichen Marktbericht.  
Abseits dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und  
verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre  
HANSAINVEST-Geschäftsführung

Nicholas Brinckmann, Marc Drießen, Dr. Jörg W. Stotz

Hamburg, im April 2016

## So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 29. Februar 2016 .....	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV .....	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien .....	9

# Vermögensaufstellung per 29. Februar 2016

Fondsvermögen: EUR 17.679.575,65 (19.114.116,02)

Umlaufende Anteile: Stück Class I 163.701 (172.908)

Stück Class R 3.770 (3.489)

<b>Vermögensaufteilung in TEUR/%</b>			
<b>Renten</b>			
Inland	0	0,00	(0,00)
Ausland	0	0,00	(1,45)
<b>Investmentanteile</b>			
Ausland	10.764	60,88	(41,57)
Inland	5.224	29,55	(28,22)
<b>Zertifikate</b>			
Inland	0	0,00	(3,74)
Ausland	0	0,00	(0,00)
<b>Derivate</b>			
	8	0,04	(-0,06)
<b>Barvermögen</b>			
	1.705	9,65	(25,22)
<b>sonstige Vermögensgegenstände</b>			
	0	0,00	(0,03)
<b>sonstige Verbindlichkeiten</b>			
	-21	-0,12	(-0,17)
	<b>17.680</b>	<b>100,00</b>	

(Angaben in Klammern per 31.08.2015)

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
<b>Investmentanteile</b>									
<b>KVGeigene Investmentanteile 2)</b>									
4Q-INCOME FONDS I	DE0009781997		ANT	22.100	0	0	EUR 17,960000	396.916,00	2,25
4Q-SPECIAL INCOME	DE000A1JRQC3		ANT	10.860	0	0	EUR 114,230000	1.240.537,80	7,02
<b>Gruppenfremde Investmentanteile 3)</b>									
ACATIS IFK VALUE RENTEN UI	DE000A0X7582		ANT	11.450	0	10.500	EUR 47,700000	546.165,00	3,09
Bellevue Fds (Lux)-BB Gl.Macro Namens-Anteile I EUR o.N.	LU0494762056		ANT	7.150	0	0	EUR 158,750000	1.135.062,50	6,42
BILKU 1-EPOS Fonds Actions au Port.InstAL2 o.N.	LU0255487364		ANT	5.450	0	3.400	EUR 65,280000	355.776,00	2,01
Danske Inv.-Europ.L.-Sh.Dynam. Namens-Anteile A p EUR	LU0861185303		ANT	92.800	92.800	0	EUR 12,001000	1.113.692,80	6,30
DNCA Invest-Miura Namens-Anteile I Cap. EUR o.N.	LU0462973008		ANT	7.500	0	0	EUR 129,710000	972.825,00	5,50
Frankfurter Aktienfonds für Stiftungen	DE000A0M8HD2		ANT	4.950	4.950	0	EUR 113,790000	563.260,50	3,19
GREIFF 'spec.situations' Fd OP Inh.-Anteile	LU0228348941		ANT	23.200	0	8.600	EUR 70,500000	1.635.600,00	9,24
Hen.Gart.-UK Absolute Return Actions Nom.R Acc.EUR Hdgd oN	LU0490786174		ANT	106.000	106.000	0	EUR 6,886900	730.011,40	4,13
iShares MDAX UCITS ETF DE	DE0005933923		ANT	2.600	5.400	2.800	EUR 169,570000	440.882,00	2,49
iShares NASDAQ-100 UCITS ETF DE	DE000A0F5UF5		ANT	11.400	11.400	0	EUR 38,438000	438.193,20	2,48
JPMorg.I.-Glob.Capital Appr.Fd Namens-Ant. A (acc.) EO o.N.	LU0095938881		ANT	4.020	4.020	0	EUR 182,700000	734.454,00	4,15
LOYS - Global L/S I	LU0720542298		ANT	9.450	9.450	0	EUR 69,520000	656.964,00	3,72
MLIS - Marshall Wace Tops Ucits III Fund B Acc Eur	LU0333226826		ANT	6.810	6.810	0	EUR 137,040000	933.242,40	5,28
Pensato Capital Funds plc - Pensato Europa Absolute Return Fund -B-	IE00B3SZ5F75		ANT	4.320	4.320	0	EUR 123,400000	533.088,00	3,02
ProffittichSchmidlin Fonds UI Inhaber-Anteile Ant.klasse I	DE000A1W9A36		ANT	83	35	35	EUR 10.539,370000	874.767,71	4,95
Schroder ISF-Eur.Alpha Abs.Rtn Namens-Anteile C Acc. EUR o.N.	LU0995125985		ANT	5.450	5.450	0	EUR 109,720000	597.974,00	3,38
Tungsten PARAGON	DE000A1J31W8		ANT	6.790	6.790	0	EUR 106,490000	723.067,10	4,09
Tungsten TRYCON Basic Inv.HAIG Inh.-Ant. C (inst.) o.N.	LU0451958309		ANT	7.000	7.000	0	EUR 116,510000	815.570,00	4,61
UBS-ETF-Barcl.US Liq.C.1-5 Ye. Inhaber-Anteile A Dis.USD o.N.	LU1048314949		ANT	42.300	42.300	0	EUR 13,000000	549.900,00	3,11
<b>Summe der Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>15.987.949,41</b>	<b>90,43</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>15.987.949,41</b>	<b>90,43</b>
<b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b>									
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>									
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>									
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>									
Ten-Year Treasury Notes Futures 21.06.2016	XC0009690196			-9				2.059,31	0,01
<b>Summe der Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>2.059,31</b>	<b>0,01</b>
<b>Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
DAX Future 18.03.2016	DE0008469594		STK	-1				-212,50	0,00
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-212,50</b>	<b>0,00</b>
<b>Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>									
<b>Geschlossene Positionen</b>									
USD/EUR 0,47 Mio.		OTC						5.693,70	0,03
<b>Summe der Devisen-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>5.693,70</b>	<b>0,03</b>

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	1.705.156,78				1.705.156,78	9,65
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:</b>									
			USD	-91,43				-83,68	0,00
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.705.073,10</b>	<b>9,65</b>
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-20.987,37			EUR	-20.987,37	-0,12
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>17.679.575,65</b>	<b>100*</b>
<b>Anteilwert - 3ik-Strategiefonds I Class I</b>							<b>EUR</b>	<b>105,73</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>163.701</b>	
<b>Anteilwert - 3ik-Strategiefonds I Class R</b>							<b>EUR</b>	<b>98,62</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>3.770</b>	

### Fußnoten:

\*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Zinsen lfd. Konto  
Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 97,50%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 242.838.950,80 EUR.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 29.02.2016	
US-Dollar	USD	1,092600	= 1 Euro (EUR)
<b>Marktschlüssel</b>			
<b>b) Terminbörsen</b>			
CBOE	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE		
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND		
<b>c) OTC</b>			
	Over-the-Counter		

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
10,000000000% EIB RB/EO-MTN 14/18	XS1136802615	BRL	-	1.135	
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>					
<b>Zertifikate</b>					
Deutsche Bank Quanto XPERT Open End Zert. Gold	DE000DB0SEX9	STK	-	7.500	
<b>Investmentanteile</b>					
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>					
ACEVO Gl.Healthcare Abs.Ret.UI Inhaber-Anteile	DE000A1111D5	ANT	-	9.130	
Artemis Pan-Europ.Abs.Rtn Fund Reg. Shares I Acc.EUR Hgd o.N.	GB00BMMV4H91	ANT	680.000	680.000	
Deutsche Aktien Total Return	LU0216092006	ANT	-	9.450	
Hend.Horiz.Fd-Pan Europ.Alpha Actions Nom. A (Acc.) EUR o.N.	LU0264597617	ANT	43.400	43.400	
iShares DAX UCITS ETF DE	DE0005933931	ANT	10.400	10.400	
JPMorgan-Europe Eq.Abs.Alp.Fd Actions Nom. B (acc.) EUR o.N.	LU1001748042	ANT	-	6.000	
JPMorgan-Europe Eq.Abs.Alp.Fd Act.Nom.C (perf)(acc)EUR o.N.	LU1001748398	ANT	6.354	6.354	
JPM.I.Fds-Gl.Capital Pre.(USD) Namens-Ant.A(acc)EUR(hed.) o.N.	LU0917670407	ANT	7.500	7.500	
Nordea 1-Stable Return Fund BI-EUR	LU0351545230	ANT	-	52.450	
RP Vega Inhaber-Anteile IL	DE000A1JSUA7	ANT	-	6.120	
<b>Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			89.048,18
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			26.612,77
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>					
Kauf von Devisen auf Termin:					
USD		EUR			481,49

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

## Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 1.312.066,66

Der Wert ergibt sich unter Berücksichtigung von Netting- und Hedgingeffekten, der zugrundeliegenden Derivate im Investmentvermögen

## Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Baader Bank AG  
Donner & Reuschel AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	90,43
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,04

## Sonstige Angaben

Anteilwert - 3ik-Strategiefonds I Class I	EUR	105,73
Umlaufende Anteile	STK	163.701

Anteilwert - 3ik-Strategiefonds I Class R	EUR	98,62
Umlaufende Anteile	STK	3.770

Anteilklasse I: Verwaltungsvergütung 0,85% p.a.; Ertragsverwendung Thesaurierung

Anteilklasse R: Verwaltungsvergütung 1,05% p.a.; Ertragsverwendung Thesaurierung

## Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum amtlichen Markt zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Nicht notierte Rentenwerte und Schuldscheindarlehen werden mit Renditekursen bewertet. Investmentzertifikate werden zu den letzten veröffentlichten Rücknahmepreisen angesetzt.

Vermögenswerte, die weder an einer Börse zugelassen noch in einen organisierten Markt einbezogen sind oder für die ein handelbarer Kurs nicht verfügbar ist, werden mit von anerkannten Kursversorgern zur Verfügung gestellten Kursen bewertet. Sollten die ermittelten Kurse nicht belastbar sein, wird auf den mit geeigneten Bewertungsmodellen ermittelten Verkehrswert abgestellt (§ 28 KARBV).

## Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandsersatzungen. Die KVG gewährt sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

## Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

2) Die Verwaltungsvergütung für KVGeigene Investmentanteile beträgt:

4Q-INCOME FONDS I	0,5000% p.a.
4Q-SPECIAL INCOME	0,5600% p.a.

3) Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:

ACATIS IFK VALUE RENTEN UI	1,4000% p.a.
Bellevue Fds (Lux)-BB GI.Macro Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000% p.a.
BILKU 1-EPOS Fonds Actions au Port.InstAL2 o.N.	0,7500% p.a.
Danske Inv.-Europ.L.-Sh.Dynam. Namens-Anteile A p EUR	1,4000% p.a.
DNCA Invest-Miura Namens-Anteile I Cap. EUR o.N.	0,0700% p.a.
Frankfurter Aktienfonds für Stiftungen	1,0000% p.a.
GREIFF 'spec.situations' Fd OP Inh.-Anteile	1,7000% p.a.
Hen.Gart.-UK Absolute Return Actions Nom.R Acc.EUR Hdgd oN	1,5000% p.a.
iShares MDAX UCITS ETF DE	0,5000% p.a.
iShares NASDAQ-100 UCITS ETF DE	0,3000% p.a.
JPMorg.I.-Glob.Capital Appr.Fd Namens-Ant. A (acc.) EO o.N.	1,2500% p.a.
LOYS - Global L/S I	0,7500% p.a.
MLIS - Marshall Wace Tops Ucits III Fund B Acc Eur	1,7500% p.a.
Pensato Capital Funds plc - Pensato Europa Absolute Return Fund -B-	1,7500% p.a.
ProfitlichSchmidlin Fonds UI Inhaber-Anteile Ant.klasse I	1,2500% p.a.
Schroder ISF-Eur.Alpha Abs.Rtn Namens-Anteile C Acc.EUR o.N.	1,0000% p.a.
Tungsten PARAGON	1,2500% p.a.
Tungsten TRYCON Basic Inv.HAIG Inh.-Ant. C (inst.) o.N.	1,4500% p.a.
UBS-ETF-Barcl.US Liq.C.1-5 Ye. Inhaber-Anteile A Dis.USD o.N.	0,1800% p.a.

Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.



# Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

## Kapitalverwaltungsgesellschaft:

HANSAINVEST  
Hanseatische Investment-GmbH  
Postfach 60 09 45  
22209 Hamburg  
Hausanschrift:  
Kapstadtring 8  
22297 Hamburg

Kunden-Servicecenter:  
Telefon: (040) 3 00 57 - 62 96  
Telefax: (040) 3 00 57 - 61 42  
Internet: [www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)  
E-Mail: [service@hansainvest.de](mailto:service@hansainvest.de)

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:  
€ 10.500.000,-  
Haftendes Eigenkapital:  
€ 10.161.611,-  
(Stand: 31.12.2014)

## Gesellschafter:

SIGNAL IDUNA  
Allgemeine Versicherung AG, Dortmund  
IDUNA Vereinigte Lebensversicherung  
aG für Handwerk, Handel und Gewerbe,  
Hamburg

## Verwahrstelle:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:  
€ 20.500.000,-  
Haftendes Eigenkapital:  
€ 230.763.400,-  
(Stand: 31.12.2014)

## Einzahlungen:

UniCredit Bank AG, München  
(vorm. Bayerische Hypo- und  
Vereinsbank)  
BIC: HYVEDEMM300  
IBAN: DE15200300000000791178

## Aufsichtsrat:

Martin Berger (Vorsitzender),  
stv. Mitglied der Vorstände der  
SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg  
(zugleich Vorsitzender des Aufsichts-  
rates der SIGNAL IDUNA Asset  
Management GmbH)

Dr. Karl-Josef Bierth  
(stellvertretender Vorsitzender),  
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA  
Gruppe, Hamburg

Thomas Gollub,  
Vorstandsvorsitzender der Aramea Asset  
Management AG, Hamburg (zugleich  
stellvertretender Präsident des Verwal-  
tungsrats der HANSAINVEST LUX S.A.)

Thomas Janta,  
Direktor NRW.BANK, Düsseldorf

Dr. Thomas A. Lange,  
Vorsitzender des Vorstandes der  
National-Bank AG, Essen

Prof. Dr. Harald Stützer,  
Geschäftsführender Gesellschafter der  
STUETZER Real Estate Consulting  
GmbH, Neufahrn

## Wirtschaftsprüfer:

PricewaterhouseCoopers Aktiengesell-  
schaft Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,  
Hamburg

## Geschäftsführung:

Nicholas Brinckmann

Marc Drießen

Dr. Jörg W. Stotz  
(zugleich Präsident des Verwaltungsrats  
der HANSAINVEST LUX S.A. sowie  
Mitglied der Geschäftsführung der  
SIGNAL IDUNA Asset Management  
GmbH)

**HANSAINVEST**

**Hanseatische Investment-GmbH**

**Ein Unternehmen der  
SIGNAL IDUNA Gruppe**

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Telefon (040) 3 00 57 - 62 96

Fax (040) 3 00 57 - 61 42

[service@hansainvest.de](mailto:service@hansainvest.de)

[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)